

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年7月28日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	バランスセレクト70
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

バランスセレクト70

（以下「ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託・受益権(以下「受益権」といいます。)

なお、当初元本は1口当り1円です。

信用格付

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、午後3時までに、取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

## (5) 【申込手数料】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%（税抜1.0%）以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

## (6) 【申込単位】

一般コース (分配金を受取るコース)	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
自動けいぞく投資コース (分配金が再投資されるコース)	1万円以上1円単位

ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。

## (7) 【申込期間】

2022年7月29日から2023年7月31日まで

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

## (8) 【申込取扱場所】

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

## (9) 【払込期日】

取得申込日から起算して5営業日目までに申込代金を申込みの販売会社にお支払いください。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に取得申込代金をお支払いいただく場合があります。

各取得申込日の発行価額の総額は、各販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、野村アセットマネジメント株式会社(「委託者」または「委託会社」といいます。)の指定する口座を經由して、野村信託銀行株式会社(「受託者」または「受託会社」といいます。)の指定するファンド口座に払い込まれます。

## (10) 【払込取扱場所】

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

までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社  
サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）  
<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時  
インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

#### （１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

#### （１２）【その他】

##### 申込みの方法

受益権の取得申込に際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

分配金の受取方法により、収益の分配時に分配金を受け取る「一般コース」と、分配金が税引き後無手数料で再投資される「自動けいぞく投資コース」の２つの申込方法があります。

受益権の申込みを行なう投資者は、取得申込をする際に、「一般コース」か「自動けいぞく投資コース」か、どちらかのコースを申し出ます。（原則として、お買付け後のコース変更はできません。）

なお、販売会社や申込形態によっては、どちらか一方のコースのみのお取り扱いとなる場合や、買付単位が異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

取得申込みの受付けの中止、既に受付けた取得申込みの受付けの取り消し

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止、その他やむを得ない事情等があるときは、取得申込みの受付けを中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付けを取り消す場合があります。

##### 振替受益権について

ファンドの受益権は、投資信託振替制度（「振替制度」と称する場合があります。）に移行したため、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

##### （参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

内外の株式および公社債を実質的な主要投資対象とし、これらに分散投資するバランス運用を行なうことで、キャピタルゲインとインカムゲインを総合したトータルリターンを獲得を目指します。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」「国内債券マザーファンド」「外国債券マザーファンド」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、当該限度額を変更することができます。

## &lt;商品分類&gt;

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。

（バランスセレクト70）

## 《商品分類表》

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

## 《属性区分表》

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

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

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

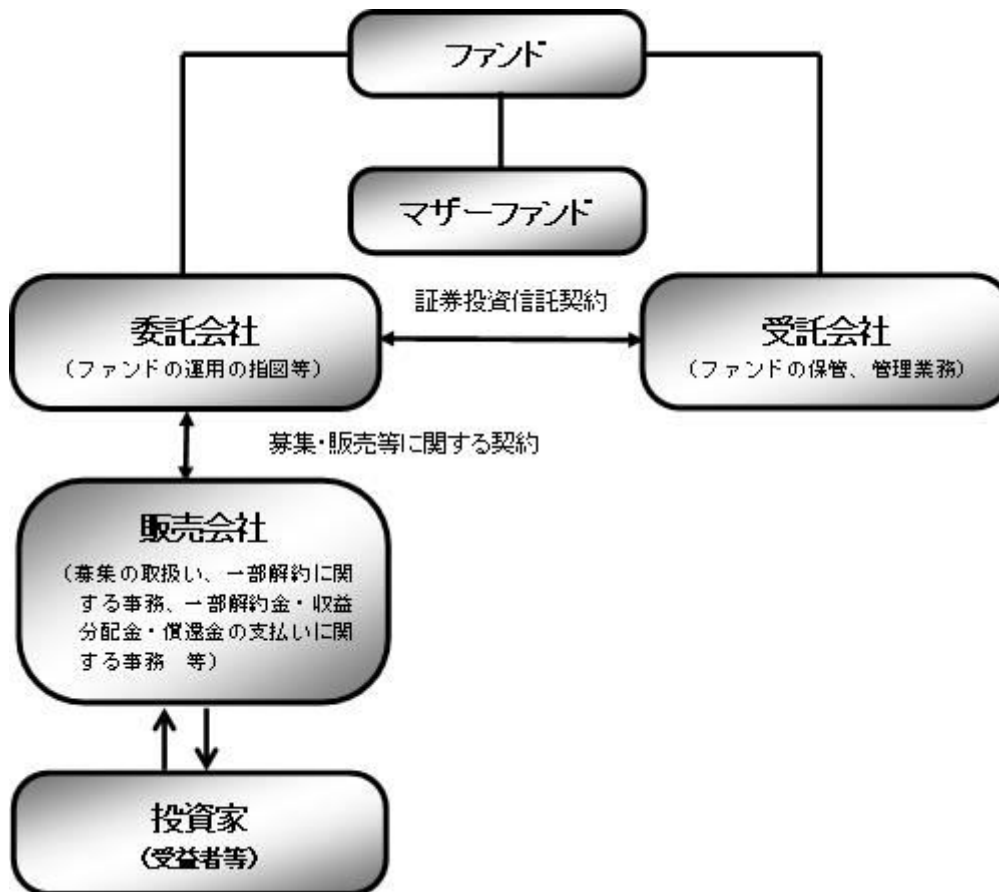
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定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

2001年5月11日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

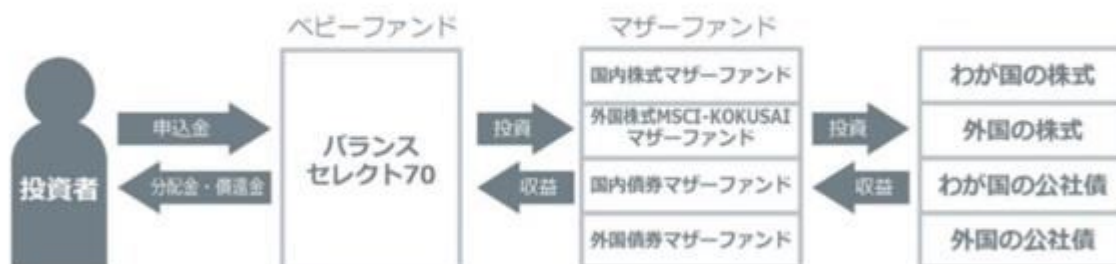
## ( 3 ) 【ファンドの仕組み】





ファンド	バランスセレクト70
マザーファンド (親投資信託)	国内株式マザーファンド 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド 国内債券マザーファンド 外国債券マザーファンド
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

- ファンドはマザーファンドを通じて投資するファミリーファンド方式で運用します。



委託会社の概況(2022年6月末現在)

- ・ 名称  
野村アセットマネジメント株式会社
- ・ 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1-13-1	5,150,693株	100%

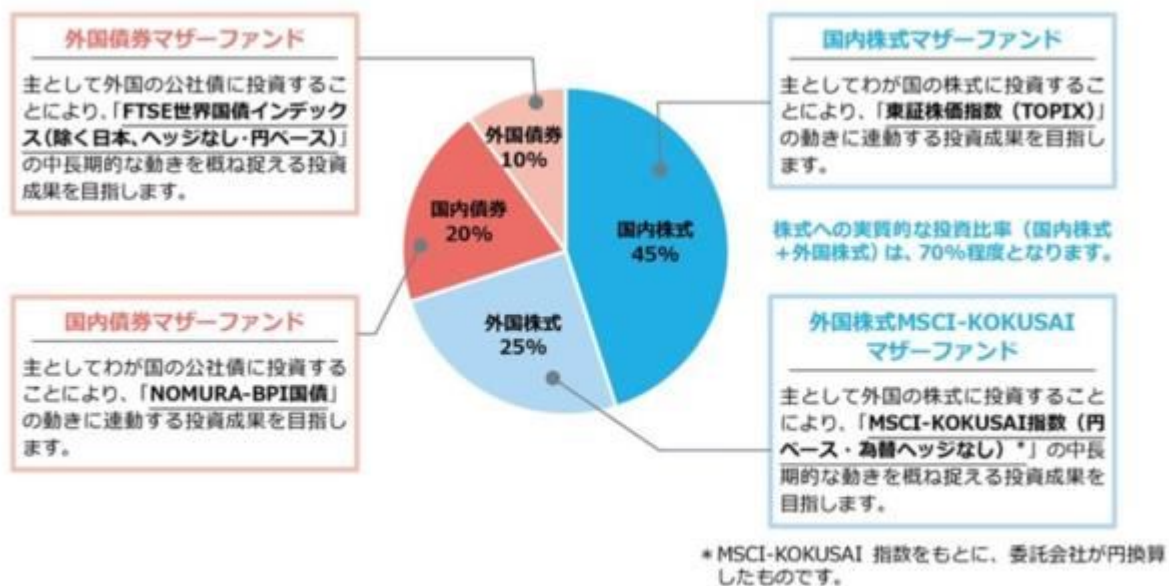
## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

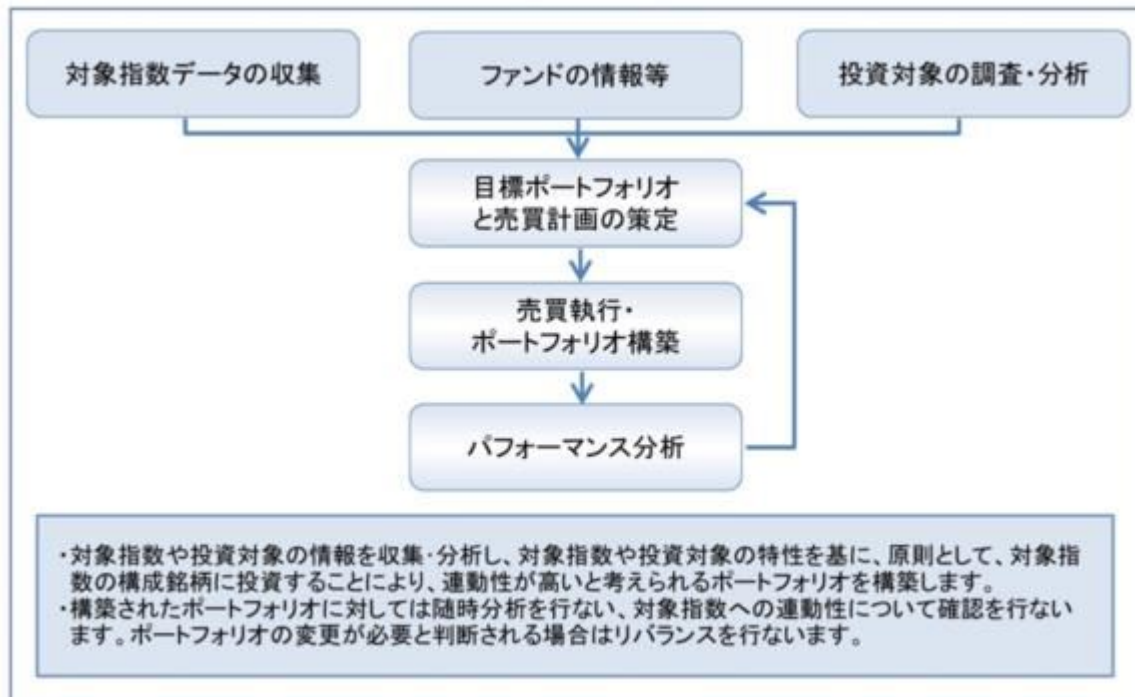
[1] 内外の株式および公社債に実質的に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

運用にあたっては、「国内株式マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」「国内債券マザーファンド」「外国債券マザーファンド」の各受益証券に投資を行ないます。

各マザーファンドへの投資比率は以下を基本とし、原則として3ヵ月毎にリバランスを行ないます。



## ■投資プロセス■



\* 上記の投資プロセスは、今後変更となる場合があります。

## 各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について

## 東証株価指数（TOPIX）

東証株価指数（TOPIX）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有する。

J P X は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証株価指数（TOPIX）に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。

J P X は、東証株価指数（TOPIX）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではない。

J P X は、東証株価指数（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ない。また、J P X は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。

本件商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではない。

J P X は、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。

J P X は、当社又は本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。

以上の項目に限らず、J P X は本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

## MSCI-KOKUSAI 指数

MSCI-KOKUSAI 指数の著作権、知的所有権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

MSCI は、自らが信頼できると考える情報源から本件指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI、MSCI の関連会社及び MSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本件指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性及び / または完全性について保証するものではありません。MSCI、MSCI の関連会社及び MSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、本件ファンドの発行会社、本件ファンドの所有者その他の個人・法人が、本契約にもとづき許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連して本件指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証をおこなうものではありません。MSCI、MSCI の関連会社及び MSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本件指数及びそれに含まれるデータの、またはそれに関連す

る過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。本件指数及びそれに含まれるデータに関し、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。本証券の購入者、販売者、または所有者あるいはいかなる個人・法人は、MSCIの許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCIに問い合わせることなく、本証券を保証、推奨、売買、又は宣伝するためにいかなるMSCIのトレードネーム、トレードマーク、又はサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCIの書面による許諾を得ることなくMSCIとの関係を一切主張することはできません。

#### NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権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、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

#### FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

[2] 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

外貨建資産に投資するマザーファンドにおいても、外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (2) 【投資対象】

内外の株式および公社債を実質的な主要投資対象とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」「国内債券マザーファンド」「外国債券マザーファンド」の各受益証券を主要投資対象とします。なお、株式および公社債に直接投資する場合があります。また、デリバティブの使用は、ヘッジ目的に限定します。

投資の対象とする資産の種類(約款第20条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)

イ 有価証券

ロ デリバティブ取引(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、下記「(5)投資制限

および」に定めるものに限ります。)に係る権利

八 約束手形(イに掲げるものに該当するものを除きます。)

二 金銭債権(イ及び八に掲げるものに該当するものを除きます。)

2 次に掲げる特定資産以外の資産

イ 為替手形

有価証券の指図範囲(約款第21条第1項)

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下記の各マザーファンド受益証券のほか、

国内株式マザーファンド受益証券(以下「国内株式マザーファンド」といいます。)

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド受益証券(以下「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」といいます。)

国内債券マザーファンド受益証券(以下「国内債券マザーファンド」といいます。)

外国債券マザーファンド受益証券(以下「外国債券マザーファンド」といいます。)

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(金融商品取引法第2条第1項第3号で定めるものをいいます。)
- 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(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10 コマーシャル・ペーパー
- 11 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 12 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 13 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 14 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 15 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 16 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。)
- 17 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 18 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

- 19 外国の者に対する権利で前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
- 20 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 21 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第16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「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第16号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを「公社債」といい、第13号および第14号の証券を「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲(約款第21条第2項)

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

- 1 預金
- 2 指定金銭信託（上記「(2)投資対象 有価証券の指図範囲」に掲げるものを除く。）
- 3 コール・ローン
- 4 手形割引市場において売買される手形
- 5 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

その他の投資対象

- 1 先物取引等
- 2 スワップ取引

(参考)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

主としてわが国の株式に投資することにより、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指します。

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。



同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

(外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド)

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

10%以内とします。

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

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

(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。

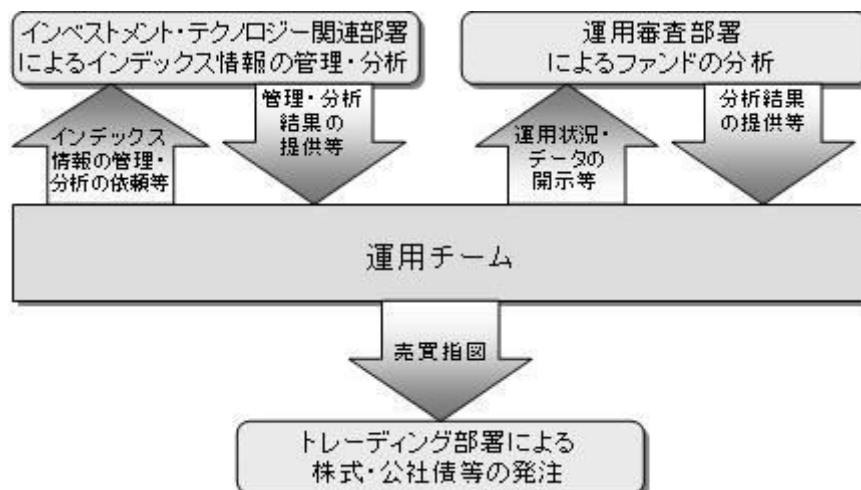
スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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。

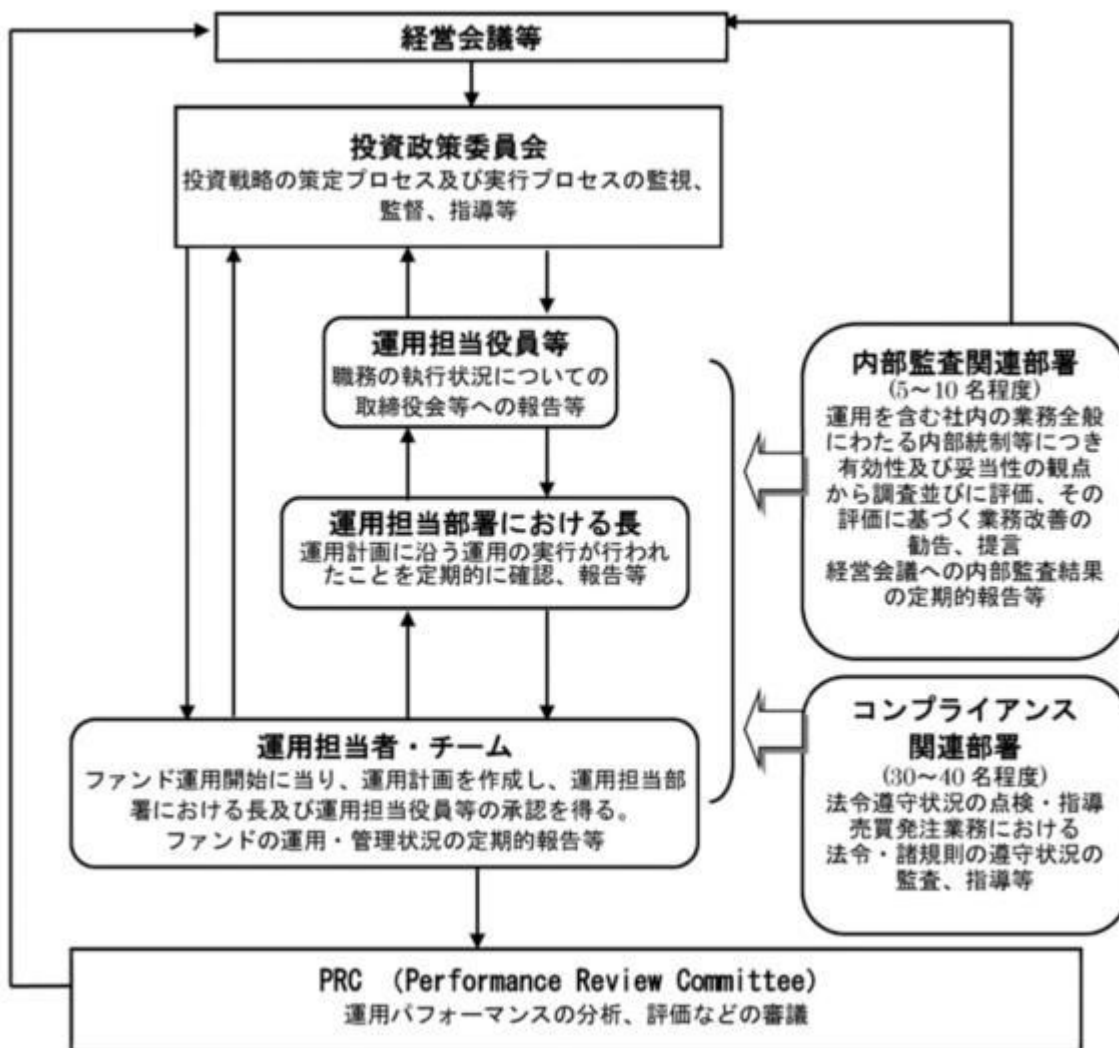
### (3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。



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】

年1回の毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等

の全額とします。

収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。

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

利子・配当収入とは、配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

売買益とは、売買損益に評価損益を加減した利益金額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

\* 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5月10日**（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

#### 分配金のお支払い

分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）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。なお、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、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。

#### （５）【投資制限】

株式への投資割合(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。

外貨建資産への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以内とします。

デリバティブの使用はヘッジ目的に限定します。

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。(運用の基本方針 2 . 運用方法 (3)投資制限)

先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第27条)

( )委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、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次の範囲で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。)

- 1 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- 2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等(株式、株価指数に係る先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- 3 コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

( )委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

- 1 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。)、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の時価総額と各マザーファンド(国内株式マザーファンド、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド、国内債券マザーファンドおよび外国債券マザーファンドをいいます。以下本項において同じ。)の信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属する各マザーファンドの時価総額に各マザーファンドの信託財産純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
- 2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- 3 コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

( )委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

- 1 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- 2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額(本号において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建

資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

- 3 コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第28条)

- ( )委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、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(「スワップ取引」)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。
- ( )スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額と各マザーファンド(国内株式マザーファンド、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド、国内債券マザーファンドおよび外国債券マザーファンドをいいます。以下本項において同じ。)の信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ( )上記( )において各マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、各マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額に各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ( )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。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

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。

投資信託証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

投資信託証券(マザーファンド受益証券を除きます。)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。

投資する株式等の範囲(約款第23条)

- ( )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、運用の基本方針の範囲内(新株引受権証券および新株予約権証券については、運用の基本方針に特別の規定がない場合、株式の範囲と同じものとする。)で、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( )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。

同一銘柄の株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

同一銘柄の株式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。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資  
制限)

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5%  
以内とします。

同一銘柄の転換社債等への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

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。

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。

信用取引の指図範囲(約款第26条)

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。

信用取引の指図は、次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、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

- 1 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- 2 株式分割により取得する株券
- 3 有償増資により取得する株券
- 4 売り出しにより取得する株券
- 5 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権  
に限ります。)の行使により取得可能な株券
- 6 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産  
に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号のものを除きます。)の行使に  
より取得可能な株券

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第30条)

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

( )上記( )に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当



する契約の一部の解約を指図するものとします。

- ( )委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第32条)

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た場合には、制約されることがあります。

外国為替予約の指図(約款第33条)

- ( )委託者は、信託財産に属する外貨建資産と外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンドおよび外国債券マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属する外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンドおよび外国債券マザーファンドの時価総額に外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンドおよび外国債券マザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

- ( )委託者は、外国為替の売買の予約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(約款第42条)

- ( )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。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。(運用の基本方針 2. 運用方法 (3)投資制限)

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<sup>（注）</sup>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<sup>（注）</sup>の投資元金は保証されているものではなく、基準価額<sup>（注）</sup>の下落により、損失を被り、投資元金が割り込むことがあります。なお、投資信託は預貯金と異なります。

#### [株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

#### [為替変動リスク]

ファンドは、実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行ないませんので、為替変動の影響を受けます。

#### [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。

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。

ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付けが中止等となる可能性、換金代金の支払いが遅延する可能性等があります。

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遅延す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。

## 委託会社におけるリスクマネジメント体制

### リスク管理関連の委員会

#### パフォーマンスの考査

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

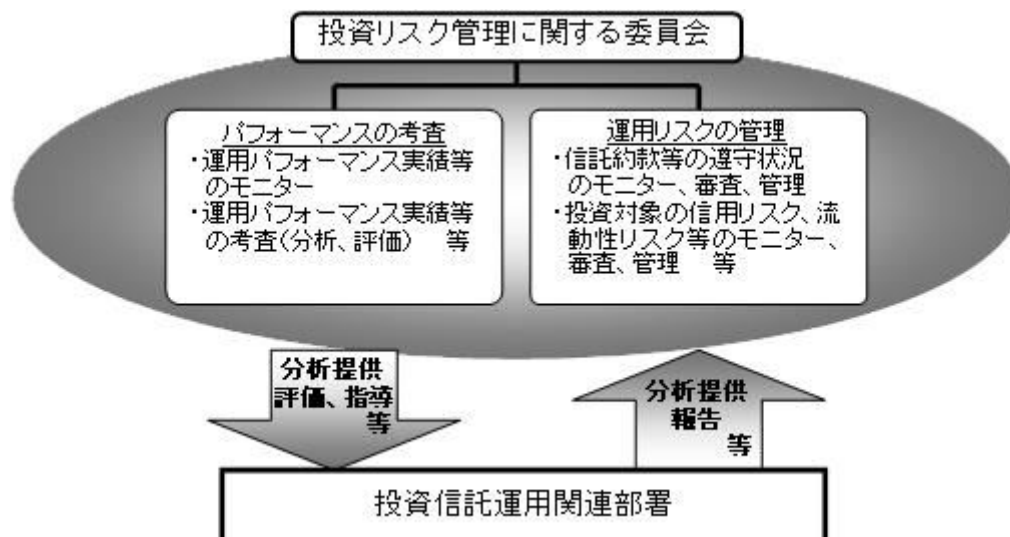
#### 運用リスクの管理

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

#### 流動性リスク管理について

流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。リスク管理関連の委員会が、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について監督します。

### リスク管理体制図



投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。



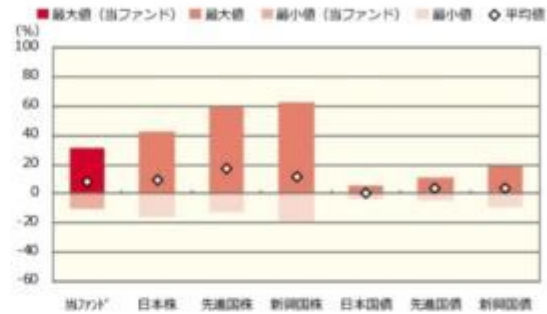
## 投資リスク

### ■ リスクの定量的比較（2017年6月末～2022年5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 (%)	30.9	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 10.7	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	8.1	9.6	17.1	11.8	0.1	3.7	3.3

\* 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。2017年6月末を10,000として指数化しております。

\* 年間騰落率は、2017年6月から2022年5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。

\* 2017年6月から2022年5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。



## 投資リスク

### <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）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標準又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標準又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。
  - 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、知的所有権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
  - NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
  - FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
  - JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンプライアーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や額段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は誰かのもと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または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）についての種別、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連動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。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JP51, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

## 4 【手数料等及び税金】

### （1）【申込手数料】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率）（税抜1.0%）以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

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

収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

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

## （２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

## （３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.792%（税抜年0.72%）の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り（税抜）とします。

< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
年0.29%	年0.38%	年0.05%

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

### 支払先の役務の内容

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

## （４）【その他の手数料等】

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

ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

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

ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額 をご負担いただきます。信託財産留保額

は、基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

なお、配当控除の適用があります。

< 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》 <sup>(注2)</sup>	《配当所得》
・特定公社債 <sup>(注1)</sup> の利子 ・公募公社債投資信託の収益分配金	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の ・譲渡益 ・譲渡損	・上場株式の配当 ・公募株式投資信託の収益分配金

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

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

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

法人の投資家に対する課税

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

は、15.315%（国税15.315%）の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### 換金（解約）時および償還時の課税について

##### [個人の投資家の場合]

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

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

##### [法人の投資家の場合]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

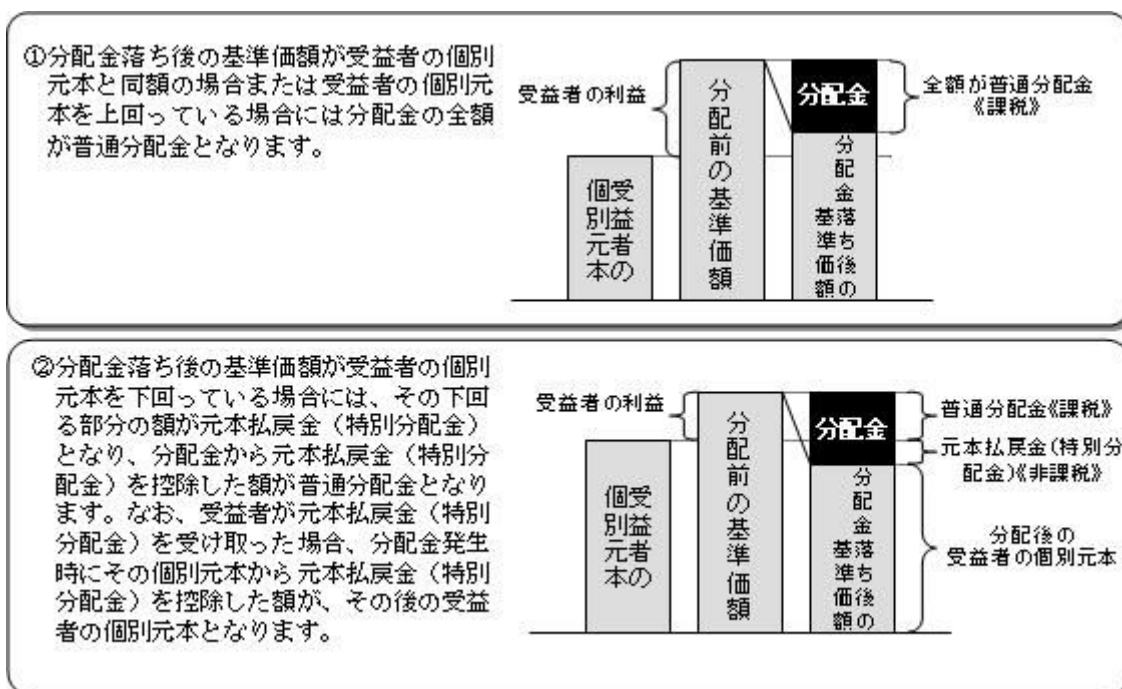
#### 個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

#### 分配金の課税について

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





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

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（2022年5月末現在）が変更となる場合があります。

## 5【運用状況】

以下は2022年5月31日現在の運用状況であります。

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

### (1)【投資状況】

#### バランスセレクト70

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	2,064,922,858	99.90
現金・預金・その他資産(負債控除後)		2,063,941	0.09
合計(純資産総額)		2,066,986,799	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	422,079,661,420	97.11
現金・預金・その他資産(負債控除後)		12,549,990,871	2.88
合計(純資産総額)		434,629,652,291	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	11,186,740,000	2.57

#### (参考)外国株式MSCI-KOKUSA I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	897,316,953,515	69.96
	カナダ	49,549,071,945	3.86
	ドイツ	30,942,636,321	2.41
	イタリア	9,005,999,388	0.70

	フランス	42,046,097,672	3.27
	オランダ	16,740,017,709	1.30
	スペイン	9,439,920,772	0.73
	ベルギー	3,098,703,044	0.24
	オーストリア	763,097,962	0.05
	ルクセンブルグ	465,555,787	0.03
	フィンランド	3,744,806,262	0.29
	アイルランド	2,309,308,488	0.18
	ポルトガル	852,520,597	0.06
	イギリス	58,757,914,352	4.58
	スイス	38,444,411,852	2.99
	スウェーデン	13,218,158,340	1.03
	ノルウェー	2,889,335,934	0.22
	デンマーク	10,011,854,217	0.78
	オーストラリア	28,762,763,406	2.24
	ニュージーランド	690,427,313	0.05
	香港	10,128,063,150	0.78
	シンガポール	3,964,310,824	0.30
	イスラエル	1,611,941,240	0.12
	小計	1,234,753,870,090	96.27
投資証券	アメリカ	26,981,175,143	2.10
	カナダ	138,377,187	0.01
	フランス	586,059,418	0.04
	イギリス	742,839,448	0.05
	オーストラリア	1,876,876,963	0.14
	香港	540,900,223	0.04
	シンガポール	529,557,033	0.04
	小計	31,395,785,415	2.44
現金・預金・その他資産（負債控除後）		16,367,724,819	1.27
合計（純資産総額）		1,282,517,380,324	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	11,109,061,529	0.86
	買建	カナダ	638,648,700	0.04
	買建	ドイツ	1,539,385,344	0.12
	買建	イギリス	761,360,640	0.05
	買建	スイス	485,305,599	0.03
	買建	オーストラリア	385,695,763	0.03

## （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	19,901,043,530	99.34
現金・預金・その他資産（負債控除後）		131,280,346	0.65
合計（純資産総額）		20,032,323,876	100.00

## （参考）外国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	320,893,076,826	49.34
	カナダ	13,347,481,584	2.05
	メキシコ	4,946,056,623	0.76
	ドイツ	37,698,818,733	5.79
	イタリア	59,064,048,627	9.08
	フランス	54,023,100,754	8.30
	オランダ	8,750,640,522	1.34
	スペイン	41,126,842,363	6.32
	ベルギー	13,328,061,184	2.04
	オーストリア	8,037,030,093	1.23
	フィンランド	2,554,000,693	0.39
	アイルランド	8,186,758,047	1.25
	イギリス	33,843,547,838	5.20
	スウェーデン	1,779,666,233	0.27
	ノルウェー	1,646,936,362	0.25
	デンマーク	2,539,091,364	0.39
	ポーランド	2,729,987,933	0.41
	オーストラリア	10,117,259,340	1.55
	シンガポール	2,835,733,029	0.43
	マレーシア	3,197,808,806	0.49
中国	11,086,006,465	1.70	
イスラエル	2,593,090,381	0.39	
	小計	644,325,043,800	99.07
現金・預金・その他資産（負債控除後）		5,992,250,002	0.92
合計（純資産総額）		650,317,293,802	100.00

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## バランスセレクト70

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	455,356,370	1.9929	907,479,710	2.0478	932,478,774	45.11
2	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	114,198,538	4.3596	497,860,621	4.5345	517,833,270	25.05
3	日本	親投資信託 受益証券	国内債券マザーファンド	306,709,727	1.3336	409,028,092	1.3364	409,886,879	19.83
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	79,848,643	2.5485	203,494,266	2.5639	204,723,935	9.90

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

## (参考) 国内株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	7,947,400	2,176.77	17,299,661,898	2,122.50	16,868,356,500	3.88
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,053,000	10,537.69	11,096,195,147	12,115.00	12,757,095,000	2.93
3	日本	株式	キーエンス	電気機器	152,300	50,435.55	7,681,334,386	51,590.00	7,857,157,000	1.80
4	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	9,935,800	749.80	7,449,862,840	729.70	7,250,153,260	1.66
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	1,807,700	3,856.09	6,970,663,980	3,911.00	7,069,914,700	1.62
6	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	106,700	53,629.60	5,722,278,331	58,980.00	6,293,166,000	1.44
7	日本	株式	リクルートホール ディングス	サービス 業	1,180,200	4,372.95	5,160,955,590	4,734.00	5,587,066,800	1.28
8	日本	株式	任天堂	その他製 品	94,900	56,409.77	5,353,287,615	57,420.00	5,449,158,000	1.25
9	日本	株式	日立製作所	電気機器	808,500	6,454.12	5,218,163,510	6,725.00	5,437,162,500	1.25
10	日本	株式	KDDI	情報・通 信業	1,202,500	4,348.63	5,229,231,829	4,486.00	5,394,415,000	1.24
11	日本	株式	ソフトバンクグル ープ	情報・通 信業	989,100	4,911.52	4,857,986,568	5,379.00	5,320,368,900	1.22
12	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,137,300	4,128.77	4,695,650,121	4,433.00	5,041,650,900	1.15
13	日本	株式	信越化学工業	化学	268,200	17,856.41	4,789,089,162	18,335.00	4,917,447,000	1.13
14	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,321,200	3,772.30	4,983,970,996	3,703.00	4,892,403,600	1.12
15	日本	株式	H O Y A	精密機器	324,500	12,524.40	4,064,170,287	13,810.00	4,481,345,000	1.03
16	日本	株式	三井住友フィナン シャルグループ	銀行業	1,099,800	3,921.08	4,312,403,784	3,922.00	4,313,415,600	0.99
17	日本	株式	第一三共	医薬品	1,253,300	3,288.52	4,121,502,116	3,419.00	4,285,032,700	0.98
18	日本	株式	本田技研工業	輸送用機 器	1,260,500	3,346.94	4,218,817,870	3,187.00	4,017,213,500	0.92
19	日本	株式	ダイキン工業	機械	193,800	19,636.28	3,805,511,064	20,685.00	4,008,753,000	0.92

20	日本	株式	三井物産	卸売業	1,228,600	3,147.01	3,866,416,486	3,232.00	3,970,835,200	0.91
21	日本	株式	村田製作所	電気機器	470,300	8,250.02	3,879,984,406	8,300.00	3,903,490,000	0.89
22	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,047,800	3,691.47	3,867,922,266	3,695.00	3,871,621,000	0.89
23	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,498,300	1,511.06	3,775,083,787	1,480.00	3,697,484,000	0.85
24	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	485,000	6,920.22	3,356,306,700	7,466.00	3,621,010,000	0.83
25	日本	株式	日本電産	電気機器	394,200	8,314.90	3,277,733,580	8,679.00	3,421,261,800	0.78
26	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	177,200	17,209.67	3,049,553,524	19,200.00	3,402,240,000	0.78
27	日本	株式	S M C	機械	49,200	61,669.27	3,034,128,363	66,610.00	3,277,212,000	0.75
28	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	586,000	5,703.21	3,342,081,060	5,410.00	3,170,260,000	0.72
29	日本	株式	ファナック	電気機器	147,500	19,503.28	2,876,734,537	21,105.00	3,112,987,500	0.71
30	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,032,000	1,583.82	3,218,322,240	1,519.00	3,086,608,000	0.71

## 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	0.08
		鉱業	0.35
		建設業	2.06
		食料品	3.13
		繊維製品	0.42
		パルプ・紙	0.17
		化学	6.20
		医薬品	5.03
		石油・石炭製品	0.51
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.69
		鉄鋼	0.82
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.58
		機械	5.24
		電気機器	17.79
		輸送用機器	7.73
		精密機器	2.65
		その他製品	2.34
		電気・ガス業	1.20
		陸運業	2.86
		海運業	0.66
		空運業	0.41
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	8.70		
卸売業	5.54		
小売業	3.97		

	銀行業	5.01
	証券、商品先物取引業	0.71
	保険業	2.19
	その他金融業	1.12
	不動産業	1.92
	サービス業	5.24
合 計		97.11

## (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	3,184,400	22,684.82	72,237,559,176	19,185.34	61,093,810,707	4.76
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,384,400	40,069.58	55,472,338,478	35,032.10	48,498,439,794	3.78
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	88,590	422,344.80	37,415,526,423	295,258.65	26,156,964,273	2.03
4	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	58,390	361,747.26	21,122,423,047	288,001.96	16,816,434,987	1.31
5	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	165,690	139,080.71	23,044,284,179	97,392.16	16,136,907,371	1.25
6	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	55,500	363,530.30	20,175,932,011	289,239.19	16,052,775,367	1.25
7	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	182,810	66,652.03	12,184,658,758	65,016.57	11,885,679,728	0.92
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	511,000	23,017.86	11,762,129,489	23,217.54	11,864,167,488	0.92
9	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	485,240	35,136.63	17,049,699,231	24,117.58	11,702,816,023	0.91
10	アメリカ	株式	META PLATFORMS INC	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	459,300	29,105.02	13,367,939,760	25,017.61	11,490,591,626	0.89
11	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	253,000	45,683.45	11,557,915,354	40,913.09	10,351,012,554	0.80
12	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	821,700	10,776.77	8,855,276,143	12,512.01	10,281,121,822	0.80
13	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	573,600	17,958.84	10,301,192,715	16,830.12	9,653,760,675	0.75
14	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	469,700	19,785.09	9,293,058,381	19,067.39	8,955,953,647	0.69
15	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	324,100	28,640.98	9,282,543,275	27,293.34	8,845,773,050	0.68

16	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	374,200	21,243.98	7,949,498,666	22,857.27	8,553,193,727	0.66
17	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	546,400	16,092.34	8,792,859,984	15,608.31	8,528,381,677	0.66
18	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	202,700	39,520.96	8,010,900,432	39,547.65	8,016,309,993	0.62
19	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	170,300	46,383.43	7,899,098,288	45,870.97	7,811,826,838	0.60
20	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	1,089,400	6,717.27	7,317,802,707	6,911.80	7,529,716,118	0.58
21	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,430,000	5,488.26	7,848,216,275	4,746.33	6,787,257,906	0.52
22	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	796,500	7,985.64	6,360,563,824	8,292.62	6,605,074,060	0.51
23	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	343,100	20,944.52	7,186,065,451	19,231.50	6,598,327,650	0.51
24	アメリカ	株式	ELI LILLY & CO.	医薬品	157,800	37,208.20	5,871,455,048	41,473.37	6,544,497,912	0.51
25	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	80,230	85,308.74	6,844,320,230	76,608.33	6,146,286,797	0.47
26	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	136,400	49,339.65	6,729,928,272	44,131.91	6,019,593,206	0.46
27	アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	79,890	80,696.77	6,446,865,395	74,782.32	5,974,360,248	0.46
28	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	268,400	21,548.35	5,783,579,693	22,022.63	5,910,874,348	0.46
29	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	490,300	10,596.41	5,195,420,776	11,933.78	5,851,135,668	0.45
30	イギリス	株式	SHELL PLC-NEW	石油・ガス・消耗燃料	1,479,000	3,422.73	5,062,230,574	3,840.18	5,679,629,770	0.44

## 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	3.70
		メディア	0.89
		娯楽	1.07
		不動産管理・開発	0.37
		エネルギー設備・サービス	0.27
		石油・ガス・消耗燃料	5.17
		化学	2.20
		建設資材	0.24
		容器・包装	0.28
		金属・鉱業	1.70
		紙製品・林産品	0.11
		航空宇宙・防衛	1.50
		建設関連製品	0.52
		建設・土木	0.20
		電気設備	0.77
		コングロマリット	1.01
機械	1.62		
商社・流通業	0.34		
商業サービス・用品	0.46		

航空貨物・物流サービス	0.57
旅客航空輸送業	0.05
海運業	0.08
陸運・鉄道	1.03
運送インフラ	0.14
自動車部品	0.19
自動車	1.89
家庭用耐久財	0.29
レジャー用品	0.02
繊維・アパレル・贅沢品	1.26
ホテル・レストラン・レジャー	1.74
販売	0.09
インターネット販売・通信販売	2.35
複合小売り	0.47
専門小売り	1.58
食品・生活必需品小売り	1.45
飲料	1.78
食品	1.64
タバコ	0.77
家庭用品	1.16
パーソナル用品	0.52
ヘルスケア機器・用品	2.33
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.37
バイオテクノロジー	1.85
医薬品	5.46
銀行	6.04
各種金融サービス	1.05
保険	3.15
情報技術サービス	3.71
ソフトウェア	6.93
通信機器	0.63
コンピュータ・周辺機器	5.04
電子装置・機器・部品	0.54
半導体・半導体製造装置	4.67
各種電気通信サービス	1.31
無線通信サービス	0.29
電力	1.93
ガス	0.14
総合公益事業	0.95
水道	0.11
消費者金融	0.45
資本市場	3.14



		各種消費者サービス	0.00
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.09
		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	1.46
		専門サービス	0.67
	投資証券		2.44
	合計		98.72

## (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 (5年)第13 9回	420,000,000	100.28	421,209,600	100.31	421,323,000	0.1	2024/3/20	2.10
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 0回	370,000,000	100.30	371,132,200	100.34	371,291,300	0.1	2024/6/20	1.85
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	350,000,000	101.07	353,752,000	101.05	353,699,500	0.6	2023/12/20	1.76
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 1回	340,000,000	100.33	341,122,000	100.38	341,292,000	0.1	2024/9/20	1.70
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 50回	320,000,000	100.11	320,371,200	100.28	320,924,800	0.1	2028/3/20	1.60
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	300,000,000	100.43	301,308,000	100.51	301,548,000	0.1	2026/9/20	1.50
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 7回	300,000,000	100.23	300,693,000	100.24	300,723,000	0.1	2023/9/20	1.50
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 46回	270,000,000	100.41	271,112,400	100.48	271,296,000	0.1	2027/3/20	1.35
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 5回	270,000,000	100.43	271,179,900	100.47	271,293,300	0.1	2025/9/20	1.35
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 33回	250,000,000	101.21	253,042,500	101.21	253,040,000	0.6	2024/3/20	1.26
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 6回	250,000,000	100.45	251,127,500	100.49	251,245,000	0.1	2025/12/20	1.25
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 7回	250,000,000	100.07	250,192,500	100.13	250,332,500	0.005	2026/3/20	1.24
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 9回	250,000,000	100.02	250,052,500	100.10	250,267,500	0.005	2026/9/20	1.24
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	240,000,000	100.43	241,048,800	100.50	241,202,400	0.1	2026/12/20	1.20
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	230,000,000	100.44	231,018,900	100.49	231,136,200	0.1	2026/3/20	1.15
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	220,000,000	101.36	222,994,200	101.37	223,027,200	0.6	2024/6/20	1.11

17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 52回	220,000,000	99.92	219,830,200	100.12	220,275,000	0.1	2028/9/20	1.09
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	200,000,000	101.27	202,552,000	101.30	202,606,000	0.5	2024/9/20	1.01
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	200,000,000	101.17	202,348,000	101.20	202,418,000	0.3	2025/12/20	1.01
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	200,000,000	100.45	200,904,000	100.50	201,014,000	0.1	2026/6/20	1.00
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (30年)第3 2回	150,000,000	126.80	190,209,000	127.34	191,010,000	2.3	2040/3/20	0.95
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 13回	160,000,000	113.99	182,384,000	114.25	182,804,800	2.1	2029/9/20	0.91
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 51回	180,000,000	100.00	180,000,000	100.21	180,378,000	0.1	2028/6/20	0.90
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 45回	150,000,000	114.80	172,206,000	115.03	172,555,500	1.7	2033/6/20	0.86
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 47回	150,000,000	113.94	170,919,000	114.26	171,391,500	1.6	2033/12/20	0.85
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 48回	150,000,000	112.89	169,348,500	113.22	169,836,000	1.5	2034/3/20	0.84
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 59回	170,000,000	99.04	168,373,100	99.40	168,986,800	0.1	2030/6/20	0.84
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (30年)第3 0回	130,000,000	126.35	164,265,300	126.81	164,859,500	2.3	2039/3/20	0.82
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 46回	140,000,000	114.94	160,916,000	115.24	161,340,200	1.7	2033/9/20	0.80
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 47回	160,000,000	100.33	160,528,000	100.42	160,686,400	0.1	2027/6/20	0.80

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.34
合計	99.34

## (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 N/B	151,700,000	15,082.70	22,880,461,801	15,427.26	23,403,167,903	5.375	2031/2/15	3.59
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	129,400,000	14,468.69	18,722,495,869	14,695.06	19,015,420,489	5.25	2028/11/15	2.92
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	81,000,000	12,089.80	9,792,739,380	12,226.52	9,903,486,164	1.625	2026/11/30	1.52
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	66,600,000	14,231.31	9,478,052,460	14,308.43	9,529,418,381	6	2026/2/15	1.46

5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	72,000,000	12,787.44	9,206,960,313	12,837.27	9,242,838,907	2.5	2024/5/15	1.42
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	67,500,000	12,448.38	8,402,663,039	12,599.13	8,504,417,098	2.375	2027/5/15	1.30
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,100,000	15,722.75	7,562,643,986	16,041.27	7,715,853,241	6.25	2030/5/15	1.18
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	57,850,000	12,646.71	7,316,123,986	12,717.33	7,356,975,796	2.25	2024/11/15	1.13
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	56,700,000	12,717.81	7,211,003,153	12,781.43	7,247,074,029	2.375	2024/8/15	1.11
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	53,600,000	12,687.28	6,800,382,517	12,887.10	6,907,490,382	2.875	2028/5/15	1.06
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	60,050,000	10,733.58	6,445,515,352	11,248.42	6,754,679,128	2.375	2051/5/15	1.03
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,100,000	12,539.53	6,282,308,549	12,635.19	6,330,232,947	2.25	2025/11/15	0.97
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,900,000	12,756.89	5,855,414,805	12,810.73	5,880,126,421	2.25	2023/12/31	0.90
14	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	31,300,000	18,564.71	5,810,757,054	18,620.57	5,828,241,029	4.75	2035/4/25	0.89
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,000,000	12,825.13	5,771,311,770	12,902.63	5,806,185,242	2.875	2025/4/30	0.89
16	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	35,000,000	16,233.63	5,681,773,440	16,374.15	5,730,953,760	5.25	2029/11/1	0.88
17	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	33,800,000	16,785.64	5,673,546,413	16,883.86	5,706,746,573	6.5	2027/11/1	0.87
18	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,650,000	16,411.08	5,686,441,667	16,405.52	5,684,513,218	5.9	2026/7/30	0.87
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,700,000	10,834.74	5,384,868,921	11,298.50	5,615,357,606	2.5	2046/2/15	0.86
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,600,000	12,636.19	5,509,381,815	12,699.80	5,537,113,587	2.125	2024/9/30	0.85
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	12,869.07	5,482,227,547	12,915.15	5,501,855,970	2.75	2023/11/15	0.84
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,100,000	12,710.81	5,478,362,974	12,758.39	5,498,869,374	2.125	2024/3/31	0.84
23	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	30,700,000	17,721.64	5,440,545,694	17,716.56	5,438,986,897	5.5	2029/4/25	0.83
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,300,000	12,550.55	5,308,885,353	12,668.24	5,358,669,464	2.375	2026/4/30	0.82
25	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,400,000	15,178.11	5,221,272,619	15,179.08	5,221,605,447	3.5	2026/4/25	0.80
26	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	27,900,000	18,374.42	5,126,465,636	18,451.57	5,147,989,258	5.75	2032/7/30	0.79
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,900,000	12,063.75	5,054,715,309	12,192.47	5,108,645,344	1.5	2026/8/15	0.78
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,950,000	12,122.35	4,842,881,024	12,610.65	5,037,957,116	3.125	2044/8/15	0.77
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,700,000	10,843.76	4,738,723,453	11,296.50	4,936,572,077	2.5	2045/2/15	0.75
30	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	32,600,000	15,068.89	4,912,460,985	15,091.60	4,919,864,208	5	2025/3/1	0.75

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.07

合 計	99.07
-----	-------

## 【投資不動産物件】

バランスセレクト70

該当事項はありません。

(参考)国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

(参考)国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

バランスセレクト70

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(2022年06月限)	買建	586	日本円	10,969,701,510	11,186,740,000	2.57

(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(2022 年06月限)	買建	417	米ドル	82,512,800	10,578,966,084	86,647,387.5	11,109,061,529	0.86
	カナダ	モントリ オール取 引所	S&P TSX60株価指 数先物(2022年06 月限)	買建	25	カナダド ル	6,108,860	617,605,746	6,317,000	638,648,700	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(2022年06月限)	買建	291	ユーロ	10,644,850	1,466,434,539	11,174,400	1,539,385,344	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(2022年06月限)	買建	23	豪ドル	4,078,725	375,038,760	4,194,625	385,695,763	0.03
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2022年06月限)	買建	62	英ポンド	4,581,385	741,084,838	4,706,730	761,360,640	0.05
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(2022年06月限)	買建	31	スイスフラン	3,565,430	475,806,629	3,636,610	485,305,599	0.03

(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) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

バランスセレクト70

2022年5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12計算期間	(2013年 5月10日)	1,546	1,550	1.2087	1.2117
第13計算期間	(2014年 5月12日)	1,455	1,459	1.2487	1.2527
第14計算期間	(2015年 5月11日)	1,686	1,693	1.5575	1.5640
第15計算期間	(2016年 5月10日)	1,459	1,465	1.3927	1.3982
第16計算期間	(2017年 5月10日)	1,655	1,662	1.5849	1.5914
第17計算期間	(2018年 5月10日)	1,779	1,787	1.7108	1.7188
第18計算期間	(2019年 5月10日)	1,709	1,717	1.6316	1.6391
第19計算期間	(2020年 5月11日)	1,633	1,640	1.6081	1.6151
第20計算期間	(2021年 5月10日)	1,998	2,009	2.0300	2.0410
第21計算期間	(2022年 5月10日)	2,009	2,021	2.0259	2.0379
	2021年 5月末日	2,004		2.0232	
	6月末日	2,027		2.0452	
	7月末日	2,023		2.0349	
	8月末日	2,067		2.0746	

9月末日	2,073		2.0994
10月末日	2,101		2.1261
11月末日	2,064		2.0867
12月末日	2,096		2.1397
2022年 1月末日	2,009		2.0472
2月末日	2,002		2.0327
3月末日	2,103		2.1301
4月末日	2,062		2.0818
5月末日	2,066		2.0721

## 【分配の推移】

## バランスセレクト70

	計算期間	1口当たりの分配金
第12計算期間	2012年 5月11日～2013年 5月10日	0.0030円
第13計算期間	2013年 5月11日～2014年 5月12日	0.0040円
第14計算期間	2014年 5月13日～2015年 5月11日	0.0065円
第15計算期間	2015年 5月12日～2016年 5月10日	0.0055円
第16計算期間	2016年 5月11日～2017年 5月10日	0.0065円
第17計算期間	2017年 5月11日～2018年 5月10日	0.0080円
第18計算期間	2018年 5月11日～2019年 5月10日	0.0075円
第19計算期間	2019年 5月11日～2020年 5月11日	0.0070円
第20計算期間	2020年 5月12日～2021年 5月10日	0.0110円
第21計算期間	2021年 5月11日～2022年 5月10日	0.0120円

## 【収益率の推移】

## バランスセレクト70

	計算期間	収益率
第12計算期間	2012年 5月11日～2013年 5月10日	43.0%
第13計算期間	2013年 5月11日～2014年 5月12日	3.6%
第14計算期間	2014年 5月13日～2015年 5月11日	25.3%
第15計算期間	2015年 5月12日～2016年 5月10日	10.2%
第16計算期間	2016年 5月11日～2017年 5月10日	14.3%
第17計算期間	2017年 5月11日～2018年 5月10日	8.4%
第18計算期間	2018年 5月11日～2019年 5月10日	4.2%
第19計算期間	2019年 5月11日～2020年 5月11日	1.0%
第20計算期間	2020年 5月12日～2021年 5月10日	26.9%
第21計算期間	2021年 5月11日～2022年 5月10日	0.4%

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

#### （４）【設定及び解約の実績】

##### バランスセレクト70

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第12計算期間	2012年 5月11日～2013年 5月10日	134,487,166	113,922,703	1,279,860,640
第13計算期間	2013年 5月11日～2014年 5月12日	120,904,284	235,417,468	1,165,347,456
第14計算期間	2014年 5月13日～2015年 5月11日	90,258,775	172,878,904	1,082,727,327
第15計算期間	2015年 5月12日～2016年 5月10日	100,611,270	135,156,755	1,048,181,842
第16計算期間	2016年 5月11日～2017年 5月10日	117,702,378	121,463,090	1,044,421,130
第17計算期間	2017年 5月11日～2018年 5月10日	87,881,922	92,083,595	1,040,219,457
第18計算期間	2018年 5月11日～2019年 5月10日	81,733,037	73,983,465	1,047,969,029
第19計算期間	2019年 5月11日～2020年 5月11日	80,685,453	112,970,328	1,015,684,154
第20計算期間	2020年 5月12日～2021年 5月10日	60,076,420	91,395,710	984,364,864
第21計算期間	2021年 5月11日～2022年 5月10日	52,605,614	44,850,599	992,119,879

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（2022年5月31日現在）

### ■ 基準価額・純資産の推移（日次）



### ■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2022年5月	120 円
2021年5月	110 円
2020年5月	70 円
2019年5月	75 円
2018年5月	80 円
設定来累計	910 円

### ■ 主要な資産の状況

銘柄別投資比率

順位	銘柄	投資比率(%)
1	国内株式マザーファンド	45.1
2	外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	25.1
3	国内債券マザーファンド	19.8
4	外国債券マザーファンド	9.9

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	1.8
2	ソニーグループ	電気機器	1.3
3	キーエンス	電気機器	0.8
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.7
5	日本電信電話	情報・通信業	0.7

・「外国株式MSCI-KOKUSA I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	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	1.2
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.9
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.5
4	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.3
5	TESLA INC	自動車	0.3

・「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（5年）第139回	国債証券	0.4
2	国庫債券 利付（5年）第140回	国債証券	0.4
3	国庫債券 利付（10年）第332回	国債証券	0.3
4	国庫債券 利付（5年）第141回	国債証券	0.3
5	国庫債券 利付（10年）第350回	国債証券	0.3



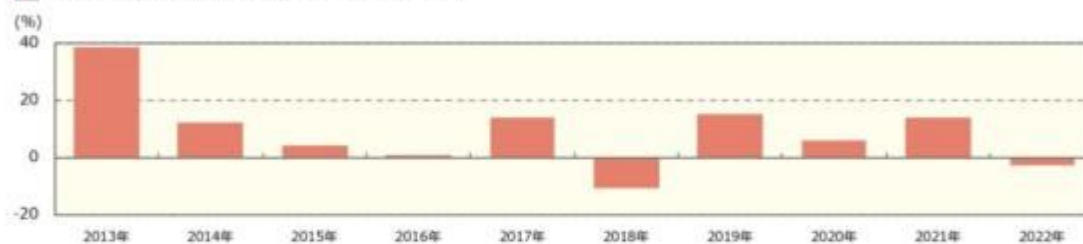


## 運用実績（2022年5月31日現在）

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.4
2	US TREASURY BOND	国債証券	0.3
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.2
4	US TREASURY BOND	国債証券	0.1
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.1

### 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。
- ・2022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、有価証券届出書の「第一部 証券情報」にしたがって受益権の募集が行なわれます。

取得申込の受付については、午後3時まで、取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日の申込み分とします。

分配金の受取方法により、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります。（原則として、お買付け後のコース変更はできません。）詳細は、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、「一般コース」の場合は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、「自動けいぞく投資コース」の場合は1万円以上1円単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。販売会社や申込形態によっては、買付単位が異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### 積立方式

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

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

受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

金融商品取引所等における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断でファンドの受益権の取得申込みの受付を中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消す場合があります。

取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

## 2【換金（解約）手続等】

受益者は、受益権を、「一般コース」の場合は1万口単位、1口単位または1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1円単位または1口単位で換金できます。

換金のお申込みの方法ならびに単位等については、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。

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け付けについては、午後3時までに、解約請求のお申込みが行なわれかつ、その解約請求の受け付けにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。

換金価額は、解約申込みの受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額を差し引いた価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうため、1日1件10億円を超える一部解約はできません。また、大口解約について、1日1件10億円以下の金額であっても、ファンドの残高、市場の流動性の状況等によっては、委託者の判断により一部解約の金額に制限を設ける場合や換金の受付時間に制限を設ける場合があります。

解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

金融商品取引所等における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

また、一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとします。

換金の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

受益証券をお手許で保有されている方は、換金のお申し込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### <基準価額の計算方法>

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> 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 <sup>1</sup> における以下のいずれかの価額で評価します。 <sup>2</sup> 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く） 価格情報会社の提供する価額
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行います。

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

## （２）【保管】

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

## （３）【信託期間】

無期限とします(2001年5月11日設定)。

## （４）【計算期間】

原則として毎年5月11日から翌年5月10日までとします。

ただし、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。

## （５）【その他】

### (a) ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託終了日前に、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、信託を終了させる場合があります。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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ( ) 上記( )の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ( ) 上記( )の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記(a)の信託契約の解約をしません。
- ( ) 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ( ) 上記( )から( )までの規定は、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( )の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
- ( ) 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- ( ) 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の委託者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( )」に該当する場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。
- ( ) 受託者が委託者の承諾を受けてその任務を辞任する場合、または、委託者または受益者が裁判所に受託者の解任を請求し裁判所が受託者を解任した場合、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。

## (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、知られたる受益者に対して交付します。

## (d) 信託約款の変更

- ( ) 委託者は、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更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。
- ( ) 委託者は、上記( )の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ( ) 上記( )の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ( ) 上記( )の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記( )の信託約款の変更をしません。
- ( ) 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

( )委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記( )から( )までの規定にしたがいます。

(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) 反対者の買取請求権

ファンドの信託契約の解約または信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、前述の「(b)信託期間の終了」( )または「(d)信託約款の変更」( )に規定する公告または書面に付記します。

(g) 関係法人との契約の更新に関する手續

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

##### <自動けいぞく投資契約を結んでいない場合>

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる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、)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。販売会社でお受取り下さい。

なお、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。

##### <自動けいぞく投資契約を結んでいる場合>

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

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

##### 収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

##### 償還金に対する請求権

##### 償還金の支払い開始日

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定さ

れた受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者( )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

##### 換金(解約)の単位

受益者は、受益権を「一般コース」の場合は1万口単位、1口単位または1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1円単位または1口単位で換金できます。

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。

##### 換金(解約)代金の支払い開始日

一部解約金は、受益者の解約申込みの受付日から起算して、原則として、5営業日目から受益者にお支払いします。

受益証券をお手許で保有されている方は、換金のお申し込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

### 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21期計算期間(2021年5月11日から2022年5月10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】



## 【バランスセレクト70】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 (2021年 5月10日現在)	第21期 (2022年 5月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	20,929,940	14,814,833
親投資信託受益証券	1,984,510,188	2,007,368,299
未収入金	11,247,268	9,417,013
流動資産合計	2,016,687,396	2,031,600,145
資産合計	2,016,687,396	2,031,600,145
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	10,828,013	11,905,438
未払解約金	96,890	1,657,902
未払受託者報酬	519,804	561,914
未払委託者報酬	6,965,311	7,529,635
未払利息	10	5
その他未払費用	31,128	33,655
流動負債合計	18,441,156	21,688,549
負債合計	18,441,156	21,688,549
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	984,364,864	992,119,879
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,013,881,376	1,017,791,717
（分配準備積立金）	752,207,646	729,924,366
元本等合計	1,998,246,240	2,009,911,596
純資産合計	1,998,246,240	2,009,911,596
負債純資産合計	2,016,687,396	2,031,600,145

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期		第21期	
	自	2020年 5月12日 至 2021年 5月10日	自	2021年 5月11日 至 2022年 5月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		445,039,032		24,454,977
営業収益合計		445,039,032		24,454,977
営業費用				
支払利息		1,355		1,182
受託者報酬		992,922		1,130,609
委託者報酬		13,305,005		15,150,108
その他費用		59,455		67,714
営業費用合計		14,358,737		16,349,613
営業利益又は営業損失（ ）		430,680,295		8,105,364
経常利益又は経常損失（ ）		430,680,295		8,105,364
当期純利益又は当期純損失（ ）		430,680,295		8,105,364
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（ ）		15,853,725		2,815,910
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		617,642,877		1,013,881,376
剰余金増加額又は欠損金減少額		47,732,566		56,504,083
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		47,732,566		56,504,083
剰余金減少額又は欠損金増加額		55,492,624		45,977,758
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		55,492,624		45,977,758
分配金		10,828,013		11,905,438
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,013,881,376		1,017,791,717

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年 5月11日から2022年 5月 10日までとなっております。

## （ 重要な会計上の見積りに関する注記 ）

該当事項はありません。

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

第20期 2021年 5月10日現在	第21期 2022年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 984,364,864口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 992,119,879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 2.0300円 (10,000口当たり純資産額) (20,300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 2.0259円 (10,000口当たり純資産額) (20,259円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第20期 自 2020年 5月12日 至 2021年 5月10日	第21期 自 2021年 5月11日 至 2022年 5月10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>31,103,292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>268,825,203円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>525,004,434円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>463,107,164円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,288,040,093円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>984,364,864口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象 額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>13,084円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>110円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>10,828,013円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	31,103,292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	268,825,203円	収益調整金額	C	525,004,434円	分配準備積立金額	D	463,107,164円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,288,040,093円	当ファンドの期末残存口数	F	984,364,864口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	13,084円	10,000口当たり分配金額	H	110円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	10,828,013円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>22,713,603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>568,584,189円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>719,116,201円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,310,413,993円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>992,119,879口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象 額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>13,208円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>120円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>11,905,438円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	22,713,603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	568,584,189円	分配準備積立金額	D	719,116,201円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,310,413,993円	当ファンドの期末残存口数	F	992,119,879口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	13,208円	10,000口当たり分配金額	H	120円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	11,905,438円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	31,103,292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	268,825,203円																																																											
収益調整金額	C	525,004,434円																																																											
分配準備積立金額	D	463,107,164円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,288,040,093円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	984,364,864口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	13,084円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	110円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	10,828,013円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	22,713,603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	568,584,189円																																																											
分配準備積立金額	D	719,116,201円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,310,413,993円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	992,119,879口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	13,208円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	120円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	11,905,438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20期 自 2020年 5月12日 至 2021年 5月10日	第21期 自 2021年 5月11日 至 2022年 5月10日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスク、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。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第20期 2021年 5月10日現在	第21期 2022年 5月10日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
---	----

（関連当事者との取引に関する注記）

第20期 自 2020年 5月12日 至 2021年 5月10日	第21期 自 2021年 5月11日 至 2022年 5月10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20期 自 2020年 5月12日 至 2021年 5月10日	第21期 自 2021年 5月11日 至 2022年 5月10日
期首元本額 1,015,684,154円	期首元本額 984,364,864円
期中追加設定元本額 60,076,420円	期中追加設定元本額 52,605,614円
期中一部解約元本額 91,395,710円	期中一部解約元本額 44,850,599円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第20期 自 2020年 5月12日 至 2021年 5月10日	第21期 自 2021年 5月11日 至 2022年 5月10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	405,263,311	15,756,425
合計	405,263,311	15,756,425

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2022年5月10日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2022年5月10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	452,803,529	902,437,433	
		国内債券マザーファンド	307,023,879	409,447,045	
		外国債券マザーファンド	79,848,643	203,494,266	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	112,857,172	491,989,555	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.9%	952,533,223	2,007,368,299	100.0%
合計			2,007,368,299		

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「国内債券マザーファンド」および「外国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内株式マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(2022年 5月10日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,419,754,580
株式	408,079,157,300
派生商品評価勘定	7,344,200
未収配当金	4,896,873,805
未収利息	183,213
その他未収収益	31,734,079
差入委託証拠金	544,898,000
流動資産合計	423,979,945,177
資産合計	423,979,945,177
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	199,666,980

未払解約金	2,362,945,778
未払利息	3,996
有価証券貸借取引受入金	5,008,955,613
流動負債合計	7,571,572,367
負債合計	7,571,572,367
純資産の部	
元本等	
元本	208,940,390,653
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	207,467,982,157
元本等合計	416,408,372,810
純資産合計	416,408,372,810
負債純資産合計	423,979,945,177

## 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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 5月10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	1.9930円
(10,000口当たり純資産額)	(19,930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	4,667,225,710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 2021年 5月11日 至 2022年 5月10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

2022年 5月10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> <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

2022年 5月10日現在	
期首	2021年 5月11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	189,017,112,223円



同期中における追加設定元本額	41,110,277,398円
同期中における一部解約元本額	21,186,998,968円
期末元本額	208,940,390,653円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	134,959,101円
バランスセレクト50	308,241,556円
バランスセレクト70	452,803,529円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,265,273,139円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,943,389,760円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	8,384,417,155円
野村資産設計ファンド2015	37,141,415円
野村資産設計ファンド2020	38,235,284円
野村資産設計ファンド2025	67,845,637円
野村資産設計ファンド2030	101,553,505円
野村資産設計ファンド2035	86,406,302円
野村資産設計ファンド2040	163,449,531円
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)	13,052,448,062円
のむらップ・ファンド(保守型)	2,502,792,368円
のむらップ・ファンド(普通型)	13,347,421,672円
のむらップ・ファンド(積極型)	4,718,663,304円
野村資産設計ファンド2045	32,496,253円
野村インデックスファンド・TOPIX	2,218,758,615円
マイ・ロード	3,348,794,091円
ネクストコア	7,518,455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	1,522,368,319円
野村TOPIXインデックス(野村SMA・EW向け)	2,702,352,545円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	719,501,005円
野村資産設計ファンド2050	40,703,877円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	12,009,412円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	6,721,245円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	5,300,690円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	4,574,384円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	436,682,300円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	714,475,593円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,179,405円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,383,145円
インデックス・ブレンド(タイプ)	22,147,332円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,653,112円
インデックス・ブレンド(タイプ)	29,998,908円
野村6資産均等バランス	2,990,153,290円
世界6資産分散ファンド	83,338,450円
野村資産設計ファンド2060	28,914,036円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	1,757,759,800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)	286,025,212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)	140,570,680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)	412,983,407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)	300,130,381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)	3,060,887円

ワールド・インデックス・ファンドV Aバランス型(適格機関投資家専用)	7,958,277円
ワールド・インデックス・ファンドV A積極型(適格機関投資家専用)	1,182,206円
野村インデックス・バランス60V A(適格機関投資家専用)	2,190,276,651円
野村ワールド・インデックス・バランス35V A(適格機関投資家専用)	5,251,826円
野村ワールド・インデックス・バランス50V A(適格機関投資家専用)	48,227,972円
野村・国内株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	60,194,423円
野村世界インデックス・バランス40V A(適格機関投資家専用)	13,239,498円
野村グローバル・インデックス・バランス25V A(適格機関投資家専用)	91,173,034円
野村グローバル・インデックス・バランス50V A(適格機関投資家専用)	191,919,845円
野村グローバル・インデックス・バランス75V A(適格機関投資家専用)	4,226,843,980円
野村世界バランス25V A(適格機関投資家専用)	44,798,217円
ノムラ日本株式インデックスファンドV A(適格機関投資家専用)	240,260,393円
ノムラF O F s用インデックスファンド・T O P I X(適格機関投資家専用)	1,819,019,926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)	15,575,120円
野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)	29,771,197円
野村F O F s用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	2,552,879円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	5,955,912円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	27,783,282円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	34,272,472円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	116,966,979円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	8,975,671,251円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	25,496,576,299円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	29,442,899,467円
野村国内株式インデックスファンド・T O P I X(確定拠出年金向け)	35,710,628,987円
マイバランスD C 30	3,440,264,387円
マイバランスD C 50	5,979,652,235円
マイバランスD C 70	6,446,099,587円
野村D C国内株式インデックスファンド・T O P I X	11,299,120,093円
野村D C運用戦略ファンド	233,339,640円
野村D C運用戦略ファンド(マイルド)	19,026,248円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	1,489,902,709円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,259,175,047円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,142,042,598円
野村世界6資産分散投信(D C)安定コース	12,719,596円
野村世界6資産分散投信(D C)インカムコース	5,811,791円
野村世界6資産分散投信(D C)成長コース	94,633,963円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2030	30,132,764円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2040	27,219,768円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2050	21,402,678円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	609,785,722円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	509,436,528円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	320,448,449円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	448,502,266円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2060	13,998,979円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	112,448,690円
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	163,817,987円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金D C向け)	15,812,686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(2022年5月10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	7,600	3,225.00	24,510,000	
		日本水産	217,000	572.00	124,124,000	
		マルハニチロ	33,000	2,428.00	80,124,000	貸付有価証券 100株
		雪国まいたけ	16,200	1,025.00	16,605,000	
		カネコ種苗	6,300	1,762.00	11,100,600	
		サカタのタネ	25,700	4,355.00	111,923,500	貸付有価証券 4,100株(100株)
		ホクト	18,100	2,010.00	36,381,000	貸付有価証券 2,000株
		ホクリヨウ	3,000	667.00	2,001,000	
		住石ホールディングス	38,900	173.00	6,729,700	貸付有価証券 3,300株
		日鉄鉱業	4,800	6,020.00	28,896,000	
		三井松島ホールディングス	9,300	1,947.00	18,107,100	貸付有価証券 2,300株(1,200株)
		I N P E X	822,000	1,471.00	1,209,162,000	
		石油資源開発	26,100	2,523.00	65,850,300	
		K & O エナジーグループ	9,600	1,674.00	16,070,400	
		ショーボンドホールディングス	29,800	5,410.00	161,218,000	貸付有価証券 6,500株
		ミライト・ホールディングス	71,500	1,840.00	131,560,000	
		タマホーム	13,500	2,645.00	35,707,500	貸付有価証券 6,300株(100株)
		サンヨーホームズ	2,600	730.00	1,898,000	
		日本アクア	8,800	596.00	5,244,800	
		ファーストコーポレーション	5,400	806.00	4,352,400	貸付有価証券 2,000株

ベステラ	4,500	1,192.00	5,364,000	貸付有価証券 100株(100株)
Robot Home	37,000	195.00	7,215,000	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
キャンディル	3,600	513.00	1,846,800	貸付有価証券 1,500株
ダイセキ環境ソリューション	4,300	999.00	4,295,700	貸付有価証券 1,600株(1,500株)
第一カッター興業	5,300	1,322.00	7,006,600	
安藤・間	107,300	893.00	95,818,900	
東急建設	63,300	595.00	37,663,500	貸付有価証券 100株
コムシスホールディングス	71,600	2,722.00	194,895,200	貸付有価証券 300株
ピーアールホールディングス	29,500	300.00	8,850,000	貸付有価証券 100株
高松コンストラクショングループ	13,000	2,205.00	28,665,000	
東建コーポレーション	6,200	8,630.00	53,506,000	貸付有価証券 100株(100株)
ソネック	2,300	1,004.00	2,309,200	貸付有価証券 900株
ヤマウラ	10,400	924.00	9,609,600	貸付有価証券 2,800株
オリエンタル白石	74,700	233.00	17,405,100	貸付有価証券 100株
大成建設	136,000	3,520.00	478,720,000	貸付有価証券 100株
大林組	501,000	901.00	451,401,000	
清水建設	467,400	693.00	323,908,200	貸付有価証券 13,700株
飛島建設	13,700	1,017.00	13,932,900	
長谷工コーポレーション	147,700	1,391.00	205,450,700	貸付有価証券 100株
松井建設	19,200	631.00	12,115,200	
銭高組	2,100	3,675.00	7,717,500	
鹿島建設	367,100	1,438.00	527,889,800	
不動テトラ	10,900	1,549.00	16,884,100	
大未建設	5,400	1,329.00	7,176,600	
鉄建建設	10,900	1,850.00	20,165,000	
西松建設	31,100	3,800.00	118,180,000	貸付有価証券

				500株
三井住友建設	115,700	420.00	48,594,000	
大豊建設	7,500	4,465.00	33,487,500	貸付有価証券 3,400株（3,400株）
佐田建設	11,000	445.00	4,895,000	
ナカノフード建設	12,300	307.00	3,776,100	
奥村組	28,900	3,105.00	89,734,500	
東鉄工業	22,600	2,222.00	50,217,200	
イチケン	3,700	1,777.00	6,574,900	
富士ピー・エス	6,600	475.00	3,135,000	貸付有価証券 2,800株
浅沼組	5,700	5,070.00	28,899,000	
戸田建設	207,700	743.00	154,321,100	
熊谷組	25,400	2,703.00	68,656,200	貸付有価証券 100株
北野建設	3,100	2,050.00	6,355,000	
植木組	4,400	1,396.00	6,142,400	貸付有価証券 1,400株
矢作建設工業	21,900	774.00	16,950,600	
ピーエス三菱	16,900	562.00	9,497,800	
日本ハウスホールディングス	34,900	411.00	14,343,900	貸付有価証券 700株
大東建託	52,500	11,760.00	617,400,000	
新日本建設	21,800	707.00	15,412,600	
東亜道路工業	2,700	5,040.00	13,608,000	貸付有価証券 100株
日本道路	4,500	7,150.00	32,175,000	貸付有価証券 300株
東亜建設工業	12,200	2,857.00	34,855,400	
日本国土開発	46,600	542.00	25,257,200	
若築建設	8,300	1,939.00	16,093,700	
東洋建設	57,500	894.00	51,405,000	貸付有価証券 27,000株（24,600株）
五洋建設	198,600	618.00	122,734,800	
世紀東急工業	24,600	739.00	18,179,400	
福田組	5,500	4,615.00	25,382,500	貸付有価証券 2,400株
住友林業	125,000	1,943.00	242,875,000	貸付有価証券 27,900株

日本基礎技術	13,600	731.00	9,941,600	
巴コーポレーション	21,400	465.00	9,951,000	
大和ハウス工業	451,300	3,066.00	1,383,685,800	
ライト工業	30,100	1,874.00	56,407,400	
積水ハウス	533,400	2,223.00	1,185,748,200	
日特建設	10,600	732.00	7,759,200	
北陸電気工事	10,200	738.00	7,527,600	
ユアテック	29,400	681.00	20,021,400	
日本リーテック	10,400	1,063.00	11,055,200	
四電工	5,400	1,723.00	9,304,200	
中電工	22,600	2,115.00	47,799,000	貸付有価証券 1,300株
関電工	83,400	834.00	69,555,600	
きんでん	111,200	1,528.00	169,913,600	貸付有価証券 10,100株
東京エネシス	16,400	927.00	15,202,800	
トーエネック	5,200	3,345.00	17,394,000	
住友電設	12,700	2,314.00	29,387,800	
日本電設工業	26,100	1,625.00	42,412,500	
エクシオグループ	75,200	2,187.00	164,462,400	
新日本空調	12,700	1,813.00	23,025,100	
九電工	37,200	2,874.00	106,912,800	
三機工業	33,300	1,496.00	49,816,800	
日揮ホールディングス	153,700	1,415.00	217,485,500	
中外炉工業	5,000	1,477.00	7,385,000	
ヤマト	14,100	731.00	10,307,100	
太平電業	10,700	2,728.00	29,189,600	
高砂熱学工業	44,000	1,683.00	74,052,000	
三晃金属工業	2,000	2,602.00	5,204,000	
朝日工業社	6,700	1,539.00	10,311,300	
明星工業	29,600	672.00	19,891,200	
大気社	23,800	3,165.00	75,327,000	
ダイダン	10,800	2,075.00	22,410,000	
日比谷総合設備	15,700	1,872.00	29,390,400	貸付有価証券 100株
フィル・カンパニー	2,800	1,103.00	3,088,400	貸付有価証券 1,300株（1,300株）

テスホールディングス	14,300	1,365.00	19,519,500	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
インフロニア・ホールディングス	209,000	965.00	201,685,000	貸付有価証券 2,300株
レイズネクスト	23,900	1,082.00	25,859,800	
ニッポン	45,400	1,699.00	77,134,600	
日清製粉グループ本社	175,300	1,730.00	303,269,000	
日東富士製粉	2,400	4,005.00	9,612,000	
昭和産業	14,700	2,609.00	38,352,300	
鳥越製粉	13,700	641.00	8,781,700	貸付有価証券 400株(400株)
中部飼料	18,000	991.00	17,838,000	
フィード・ワン	20,900	645.00	13,480,500	
東洋精糖	2,800	975.00	2,730,000	
日本甜菜製糖	8,600	1,652.00	14,207,200	
DM三井製糖ホールディングス	14,400	1,902.00	27,388,800	
塩水港精糖	19,600	207.00	4,057,200	貸付有価証券 700株
日新製糖	7,800	1,708.00	13,322,400	
森永製菓	36,700	4,035.00	148,084,500	
中村屋	3,700	3,120.00	11,544,000	
江崎グリコ	42,900	3,630.00	155,727,000	貸付有価証券 200株
名糖産業	6,800	1,622.00	11,029,600	
井村屋グループ	8,900	2,285.00	20,336,500	
不二家	9,200	2,380.00	21,896,000	貸付有価証券 3,900株
山崎製パン	115,700	1,697.00	196,342,900	貸付有価証券 1,100株
第一屋製パン	3,200	515.00	1,648,000	
モロゾフ	5,100	3,065.00	15,631,500	
亀田製菓	9,100	4,200.00	38,220,000	
寿スピリッツ	15,300	6,330.00	96,849,000	貸付有価証券 100株
カルビー	74,800	2,338.00	174,882,400	貸付有価証券 300株
森永乳業	29,500	4,985.00	147,057,500	
六甲バター	11,600	1,488.00	17,260,800	貸付有価証券

				200株
ヤクルト本社	115,900	6,730.00	780,007,000	
明治ホールディングス	100,500	6,550.00	658,275,000	
雪印メグミルク	38,300	1,911.00	73,191,300	貸付有価証券 900株
プリマハム	20,500	2,159.00	44,259,500	
日本ハム	61,000	4,050.00	247,050,000	
林兼産業	5,000	499.00	2,495,000	
丸大食品	15,700	1,497.00	23,502,900	貸付有価証券 100株(100株)
S Foods	14,800	2,946.00	43,600,800	
柿安本店	5,700	2,382.00	13,577,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	105,800	660.00	69,828,000	貸付有価証券 300株
サッポロホールディングス	53,400	2,710.00	144,714,000	貸付有価証券 1,900株
アサヒグループホールディングス	369,200	4,712.00	1,739,670,400	
キリンホールディングス	603,700	1,917.00	1,157,292,900	貸付有価証券 2,700株
宝ホールディングス	104,800	1,054.00	110,459,200	貸付有価証券 100株
オエノンホールディングス	45,500	301.00	13,695,500	
養命酒製造	4,800	1,720.00	8,256,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	111,800	1,474.00	164,793,200	
サントリー食品インターナショナル	109,900	5,010.00	550,599,000	
ダイドーグループホールディングス	8,400	5,020.00	42,168,000	貸付有価証券 700株
伊藤園	49,900	5,470.00	272,953,000	貸付有価証券 2,400株
キーコーヒー	15,800	2,026.00	32,010,800	
ユニカフェ	4,900	915.00	4,483,500	貸付有価証券 2,300株(100株)
ジャパンフーズ	2,300	1,140.00	2,622,000	
日清オイリオグループ	20,000	3,075.00	61,500,000	
不二製油グループ本社	35,600	1,860.00	66,216,000	
かどや製油	1,700	3,535.00	6,009,500	



J - オイルミルズ	15,300	1,603.00	24,525,900	
キッコーマン	111,600	7,200.00	803,520,000	
味の素	345,600	3,013.00	1,041,292,800	
ブルドックソース	6,600	1,850.00	12,210,000	貸付有価証券 3,100株(200株)
キューピー	81,500	2,238.00	182,397,000	貸付有価証券 100株
ハウス食品グループ本社	58,000	3,000.00	174,000,000	
カゴメ	62,300	3,210.00	199,983,000	貸付有価証券 200株
焼津水産化学工業	7,500	914.00	6,855,000	
アリアケジャパン	15,000	5,100.00	76,500,000	
ピエトロ	2,100	1,751.00	3,677,100	貸付有価証券 900株
エバラ食品工業	3,600	2,801.00	10,083,600	貸付有価証券 100株(100株)
やまみ	1,400	1,637.00	2,291,800	
ニチレイ	70,400	2,366.00	166,566,400	
東洋水産	77,000	4,160.00	320,320,000	
イトアンドホールディングス	6,200	2,182.00	13,528,400	
大冷	1,800	1,878.00	3,380,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,500	517.00	4,394,500	貸付有価証券 800株
日清食品ホールディングス	60,000	8,930.00	535,800,000	
永谷園ホールディングス	7,300	1,952.00	14,249,600	
一正蒲鉾	6,800	817.00	5,555,600	
フジッコ	15,300	2,012.00	30,783,600	
ロック・フィールド	17,200	1,398.00	24,045,600	貸付有価証券 6,200株
日本たばこ産業	880,600	2,258.50	1,988,835,100	
ケンコーマヨネーズ	8,900	1,398.00	12,442,200	
わらべや日洋ホールディングス	10,400	1,686.00	17,534,400	貸付有価証券 900株
なとり	9,200	1,995.00	18,354,000	
イフジ産業	2,900	1,000.00	2,900,000	
ピックルスコーポレーション	7,800	1,275.00	9,945,000	

ファーマフーズ	20,700	1,629.00	33,720,300	貸付有価証券 9,700株(4,900株)
ユーグレナ	84,000	805.00	67,620,000	貸付有価証券 35,400株(32,200株)
紀文食品	12,800	1,039.00	13,299,200	
ミヨシ油脂	6,100	1,122.00	6,844,200	貸付有価証券 2,800株
理研ビタミン	16,000	1,660.00	26,560,000	
片倉工業	16,700	2,461.00	41,098,700	
グンゼ	9,900	3,785.00	37,471,500	
東洋紡	63,300	1,103.00	69,819,900	
ユニチカ	44,000	274.00	12,056,000	
富士紡ホールディングス	6,900	3,195.00	22,045,500	
倉敷紡績	13,000	1,839.00	23,907,000	
シキボウ	8,400	883.00	7,417,200	
日本毛織	45,400	965.00	43,811,000	貸付有価証券 20,900株
ダイトウボウ	26,100	90.00	2,349,000	貸付有価証券 1,700株(1,000株)
トーア紡コーポレーション	5,900	385.00	2,271,500	
ダイドーリミテッド	21,700	137.00	2,972,900	貸付有価証券 9,100株
帝国繊維	17,600	1,580.00	27,808,000	
帝人	147,500	1,415.00	208,712,500	
東レ	1,105,200	640.80	708,212,160	
住江織物	3,000	1,945.00	5,835,000	貸付有価証券 1,400株
日本フェルト	9,100	421.00	3,831,100	
イチカワ	2,000	1,398.00	2,796,000	
日東製網	1,700	1,339.00	2,276,300	
アツギ	12,000	516.00	6,192,000	
ダイニック	5,800	707.00	4,100,600	
セーレン	31,700	2,073.00	65,714,100	貸付有価証券 1,000株
ソトー	5,800	830.00	4,814,000	
東海染工	1,800	1,128.00	2,030,400	
小松マテーレ	25,600	1,420.00	36,352,000	
ワコールホールディング	37,800	1,832.00	69,249,600	

ス				
ホギメディカル	21,000	3,190.00	66,990,000	
クラウディアホールディングス	3,800	230.00	874,000	
T S Iホールディングス	51,900	310.00	16,089,000	
マツオカコーポレーション	5,000	1,119.00	5,595,000	
ワールド	21,000	1,350.00	28,350,000	
三陽商会	7,500	821.00	6,157,500	
ナイガイ	5,400	305.00	1,647,000	貸付有価証券 100株
オンワードホールディングス	93,600	247.00	23,119,200	
ルックホールディングス	5,100	1,501.00	7,655,100	
ゴールドウイン	28,100	6,370.00	178,997,000	
デサント	30,000	2,235.00	67,050,000	貸付有価証券 100株
キング	7,600	509.00	3,868,400	
ヤマトインターナショナル	13,300	283.00	3,763,900	貸付有価証券 2,900株（100株）
特種東海製紙	9,300	3,510.00	32,643,000	
王子ホールディングス	652,900	605.00	395,004,500	
日本製紙	72,800	1,056.00	76,876,800	貸付有価証券 20,000株
三菱製紙	22,000	298.00	6,556,000	
北越コーポレーション	101,900	679.00	69,190,100	貸付有価証券 2,000株
中越パルプ工業	6,100	938.00	5,721,800	
巴川製紙所	4,800	759.00	3,643,200	
大王製紙	74,400	1,564.00	116,361,600	
阿波製紙	4,000	327.00	1,308,000	
レンゴー	142,300	793.00	112,843,900	
トーモク	9,200	1,554.00	14,296,800	
ザ・パック	11,500	2,405.00	27,657,500	
北の達人コーポレーション	57,300	179.00	10,256,700	貸付有価証券 25,700株（14,500株）
クラレ	228,400	1,064.00	243,017,600	
旭化成	1,038,800	1,062.00	1,103,205,600	
共和レザー	9,500	666.00	6,327,000	

昭和電工	139,600	2,464.00	343,974,400	
住友化学	1,149,600	574.00	659,870,400	貸付有価証券 3,500株
住友精化	6,900	3,075.00	21,217,500	
日産化学	82,300	7,000.00	576,100,000	
ラサ工業	5,700	1,648.00	9,393,600	
クレハ	12,300	10,000.00	123,000,000	貸付有価証券 200株
多木化学	5,900	4,955.00	29,234,500	貸付有価証券 1,200株
テイカ	10,900	1,190.00	12,971,000	
石原産業	27,400	1,028.00	28,167,200	
片倉コープアグリ	3,600	1,262.00	4,543,200	
日本曹達	19,500	3,455.00	67,372,500	
東ソー	220,200	1,833.00	403,626,600	
トクヤマ	50,100	1,813.00	90,831,300	
セントラル硝子	25,500	2,429.00	61,939,500	
東亜合成	84,800	1,044.00	88,531,200	
大阪ソーダ	14,000	3,235.00	45,290,000	貸付有価証券 1,200株
関東電化工業	33,100	958.00	31,709,800	
デンカ	57,000	3,515.00	200,355,000	
信越化学工業	268,200	17,855.00	4,788,711,000	貸付有価証券 100株
日本カーバイド工業	5,700	1,371.00	7,814,700	
堺化学工業	10,900	1,871.00	20,393,900	貸付有価証券 3,500株
第一稀元素化学工業	14,500	965.00	13,992,500	
エア・ウォーター	144,000	1,700.00	244,800,000	
日本酸素ホールディングス	146,700	2,312.00	339,170,400	
日本化学工業	4,800	2,325.00	11,160,000	
東邦アセチレン	3,400	1,112.00	3,780,800	
日本パーカライジング	76,400	927.00	70,822,800	貸付有価証券 100株
高圧ガス工業	24,500	649.00	15,900,500	
チタン工業	1,800	1,722.00	3,099,600	
四国化成工業	19,900	1,251.00	24,894,900	貸付有価証券 100株

戸田工業	3,400	2,440.00	8,296,000	
ステラ ケミファ	8,100	2,496.00	20,217,600	
保土谷化学工業	4,800	3,725.00	17,880,000	
日本触媒	25,600	5,310.00	135,936,000	貸付有価証券 2,900株
大日精化工業	12,600	1,935.00	24,381,000	
カネカ	39,200	3,480.00	136,416,000	
三菱瓦斯化学	141,500	2,015.00	285,122,500	貸付有価証券 800株
三井化学	138,600	3,030.00	419,958,000	貸付有価証券 100株
J S R	149,300	3,725.00	556,142,500	貸付有価証券 1,200株
東京応化工業	25,300	6,940.00	175,582,000	
大阪有機化学工業	12,900	2,630.00	33,927,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,046,000	810.80	848,096,800	貸付有価証券 500株
K Hネオケム	25,800	2,573.00	66,383,400	
ダイセル	225,800	793.00	179,059,400	
住友ベークライト	24,400	4,285.00	104,554,000	
積水化学工業	327,400	1,728.00	565,747,200	
日本ゼオン	136,500	1,385.00	189,052,500	
アイカ工業	42,400	3,035.00	128,684,000	貸付有価証券 7,200株（3,000株）
U B E	75,500	2,066.00	155,983,000	貸付有価証券 4,200株
積水樹脂	23,500	1,766.00	41,501,000	
タキロンシーアイ	34,700	547.00	18,980,900	
旭有機材	9,100	1,880.00	17,108,000	
ニチバン	9,100	1,710.00	15,561,000	貸付有価証券 500株
リケンテクノス	36,900	438.00	16,162,200	
大倉工業	7,800	1,804.00	14,071,200	
積水化成工業	20,700	424.00	8,776,800	
群栄化学工業	3,500	2,688.00	9,408,000	
タイガースポリマー	8,200	432.00	3,542,400	
ミライアル	5,100	1,649.00	8,409,900	
ダイキアクシス	6,200	720.00	4,464,000	貸付有価証券 2,700株

ダイキョーニシカワ	33,800	514.00	17,373,200	貸付有価証券 100株
竹本容器	5,700	788.00	4,491,600	
森六ホールディングス	8,300	1,798.00	14,923,400	
恵和	4,400	4,340.00	19,096,000	
日本化薬	118,400	1,116.00	132,134,400	
カーリットホールディングス	15,100	636.00	9,603,600	
日本精化	12,000	1,934.00	23,208,000	
扶桑化学工業	13,800	3,760.00	51,888,000	
トリケミカル研究所	16,500	2,303.00	37,999,500	
A D E K A	70,300	2,373.00	166,821,900	
日油	51,900	4,830.00	250,677,000	
新日本理化学	25,300	266.00	6,729,800	
ハリマ化成グループ	11,500	781.00	8,981,500	
花王	354,000	5,290.00	1,872,660,000	
第一工業製薬	5,800	2,556.00	14,824,800	
石原ケミカル	7,900	1,265.00	9,993,500	
日華化学	5,400	794.00	4,287,600	貸付有価証券 100株
ニイタカ	3,200	2,418.00	7,737,600	貸付有価証券 1,500株
三洋化成工業	9,600	5,060.00	48,576,000	
有機合成薬品工業	11,200	268.00	3,001,600	
大日本塗料	19,100	779.00	14,878,900	
日本ペイントホールディングス	602,200	1,004.00	604,608,800	貸付有価証券 2,500株
関西ペイント	157,000	1,790.00	281,030,000	貸付有価証券 200株
神東塗料	12,600	154.00	1,940,400	
中国塗料	36,800	956.00	35,180,800	貸付有価証券 17,100株
日本特殊塗料	11,200	808.00	9,049,600	
藤倉化成	19,900	463.00	9,213,700	
太陽ホールディングス	23,600	3,125.00	73,750,000	
D I C	64,500	2,513.00	162,088,500	貸付有価証券 700株
サカティンクス	31,800	994.00	31,609,200	

東洋インキ S C ホールディングス	32,900	1,980.00	65,142,000	貸付有価証券 600株
T & K T O K A	12,900	815.00	10,513,500	
富士フィルムホールディングス	287,600	7,098.00	2,041,384,800	
資生堂	304,800	5,357.00	1,632,813,600	
ライオン	183,300	1,396.00	255,886,800	貸付有価証券 27,000株
高砂香料工業	10,600	2,613.00	27,697,800	
マンダム	33,500	1,260.00	42,210,000	貸付有価証券 100株
ミルボン	20,200	5,150.00	104,030,000	
ファンケル	66,200	2,435.00	161,197,000	貸付有価証券 29,100株（28,400株）
コーセー	30,800	11,860.00	365,288,000	貸付有価証券 2,700株
コタ	11,400	1,415.00	16,131,000	
シーボン	2,100	1,700.00	3,570,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	69,800	1,539.00	107,422,200	貸付有価証券 3,600株
ノエビアホールディングス	13,300	5,130.00	68,229,000	
アジュバンホールディングス	3,700	980.00	3,626,000	
新日本製薬	5,600	1,360.00	7,616,000	
エステー	10,500	1,462.00	15,351,000	貸付有価証券 100株
アグロ カネショウ	5,400	1,149.00	6,204,600	貸付有価証券 2,400株
コニシ	26,200	1,522.00	39,876,400	
長谷川香料	28,200	2,597.00	73,235,400	
星光 P M C	9,200	565.00	5,198,000	
小林製薬	45,900	8,980.00	412,182,000	貸付有価証券 300株
荒川化学工業	12,900	1,023.00	13,196,700	
メック	11,900	2,304.00	27,417,600	
日本高純度化学	4,300	2,291.00	9,851,300	
タカラバイオ	42,800	2,109.00	90,265,200	貸付有価証券 1,400株
J C U	17,700	3,395.00	60,091,500	貸付有価証券

				100株
新田ゼラチン	10,000	620.00	6,200,000	
O A T アグリオ	6,800	1,121.00	7,622,800	
デクセリアルズ	42,600	2,818.00	120,046,800	
アース製薬	13,500	5,530.00	74,655,000	
北興化学工業	14,700	980.00	14,406,000	
大成ラミック	4,800	2,567.00	12,321,600	
クミアイ化学工業	60,900	901.00	54,870,900	
日本農薬	29,200	615.00	17,958,000	
アキレス	10,500	1,326.00	13,923,000	
有沢製作所	23,300	916.00	21,342,800	貸付有価証券 300株
日東電工	98,900	9,060.00	896,034,000	
レック	20,700	868.00	17,967,600	
三光合成	18,700	339.00	6,339,300	
きもと	25,000	211.00	5,275,000	
藤森工業	14,000	3,525.00	49,350,000	
前澤化成工業	10,100	1,295.00	13,079,500	貸付有価証券 3,200株
未来工業	5,900	1,449.00	8,549,100	
ウェーブロックホールディングス	6,200	683.00	4,234,600	
J S P	9,600	1,475.00	14,160,000	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	30,100	2,845.00	85,634,500	
天馬	12,900	2,242.00	28,921,800	貸付有価証券 5,800株
信越ポリマー	29,400	1,050.00	30,870,000	
東リ	39,600	211.00	8,355,600	
ニフコ	54,600	2,739.00	149,549,400	
バルカー	13,300	2,606.00	34,659,800	
ユニ・チャーム	315,400	4,275.00	1,348,335,000	貸付有価証券 1,100株
ショーエイコーポレーション	4,400	580.00	2,552,000	貸付有価証券 300株(200株)
協和キリン	182,900	2,629.00	480,844,100	
武田薬品工業	1,286,200	3,774.00	4,854,118,800	貸付有価証券 5,600株
アステラス製薬	1,399,100	1,952.00	2,731,043,200	



住友ファーマ	101,100	1,273.00	128,700,300	貸付有価証券 500株
塩野義製薬	200,500	7,089.00	1,421,344,500	
わかもと製薬	18,300	267.00	4,886,100	貸付有価証券 1,200株
日本新薬	40,500	8,690.00	351,945,000	
中外製薬	511,800	3,717.00	1,902,360,600	
科研製薬	24,900	3,935.00	97,981,500	
エーザイ	190,900	5,592.00	1,067,512,800	
ロート製薬	82,000	3,390.00	277,980,000	
小野薬品工業	357,900	3,398.00	1,216,144,200	
久光製薬	40,400	3,600.00	145,440,000	
持田製薬	19,700	3,685.00	72,594,500	
参天製薬	298,600	1,094.00	326,668,400	貸付有価証券 3,100株
扶桑薬品工業	5,600	2,107.00	11,799,200	
日本ケミファ	1,900	1,921.00	3,649,900	
ツムラ	49,400	3,255.00	160,797,000	貸付有価証券 1,800株
日医工	49,600	777.00	38,539,200	
キッセイ薬品工業	27,200	2,547.00	69,278,400	
生化学工業	28,900	842.00	24,333,800	貸付有価証券 200株
栄研化学	27,300	1,655.00	45,181,500	
日水製薬	6,000	977.00	5,862,000	
鳥居薬品	8,800	3,115.00	27,412,000	
J C R ファーマ	46,100	2,308.00	106,398,800	
東和薬品	23,600	2,756.00	65,041,600	
富士製薬工業	9,600	954.00	9,158,400	
ゼリア新薬工業	27,900	1,980.00	55,242,000	貸付有価証券 1,200株
第一三共	1,253,100	3,288.00	4,120,192,800	貸付有価証券 2,500株
キョーリン製薬ホールディングス	31,700	1,857.00	58,866,900	
大幸薬品	24,700	586.00	14,474,200	貸付有価証券 10,400株(1,800株)
ダイト	10,500	2,665.00	27,982,500	
大塚ホールディングス	330,700	4,441.00	1,468,638,700	貸付有価証券

				8,400株
大正製薬ホールディングス	36,000	5,180.00	186,480,000	貸付有価証券 300株
ペプチドリーム	85,900	1,898.00	163,038,200	貸付有価証券 300株
あすか製薬ホールディングス	17,600	1,153.00	20,292,800	
サワイグループホールディングス	34,400	4,140.00	142,416,000	貸付有価証券 3,300株
日本コークス工業	138,200	134.00	18,518,800	
ニチレキ	19,900	1,233.00	24,536,700	
ユシロ化学工業	8,200	1,023.00	8,388,600	
ビーピー・カストロール	5,800	1,225.00	7,105,000	
富士石油	41,000	265.00	10,865,000	
MORESCO	5,400	1,185.00	6,399,000	貸付有価証券 100株(100株)
出光興産	176,600	3,455.00	610,153,000	
ENEOSホールディングス	2,461,700	469.90	1,156,752,830	
コスモエネルギーホールディングス	53,100	3,125.00	165,937,500	
横浜ゴム	89,000	1,717.00	152,813,000	
TOYO TIRE	83,500	1,486.00	124,081,000	
ブリヂストン	459,300	4,738.00	2,176,163,400	貸付有価証券 82,100株
住友ゴム工業	142,600	1,163.00	165,843,800	貸付有価証券 33,700株
藤倉コンポジット	13,100	671.00	8,790,100	貸付有価証券 2,300株
オカモト	9,100	3,960.00	36,036,000	
フコク	7,200	936.00	6,739,200	
ニッタ	16,400	2,856.00	46,838,400	
住友理工	31,700	568.00	18,005,600	
三ツ星ベルト	19,900	2,018.00	40,158,200	
バンドー化学	26,400	860.00	22,704,000	
日東紡績	23,000	2,439.00	56,097,000	
A G C	146,400	4,905.00	718,092,000	
日本板硝子	77,100	389.00	29,991,900	貸付有価証券 200株
石塚硝子	2,700	1,739.00	4,695,300	

日本山村硝子	6,000	780.00	4,680,000	
日本電気硝子	64,100	2,716.00	174,095,600	貸付有価証券 3,700株
オハラ	6,500	1,098.00	7,137,000	貸付有価証券 300株
住友大阪セメント	29,000	3,480.00	100,920,000	貸付有価証券 300株
太平洋セメント	93,000	2,109.00	196,137,000	
日本ヒューム	15,400	668.00	10,287,200	
日本コンクリート工業	31,300	308.00	9,640,400	
三谷セキサン	7,300	4,680.00	34,164,000	貸付有価証券 3,200株
アジアパイルホールディングス	24,500	425.00	10,412,500	
東海カーボン	133,300	1,056.00	140,764,800	
日本カーボン	8,400	4,195.00	35,238,000	
東洋炭素	10,300	2,803.00	28,870,900	
ノリタケカンパニーリミテド	8,800	4,230.00	37,224,000	
TOTO	110,900	4,435.00	491,841,500	
日本碍子	171,900	1,788.00	307,357,200	
日本特殊陶業	121,000	2,301.00	278,421,000	貸付有価証券 600株
ダントーホールディングス	10,700	242.00	2,589,400	貸付有価証券 6,300株
MARUWA	5,700	15,680.00	89,376,000	
品川リフラクトリーズ	3,800	3,635.00	13,813,000	
黒崎播磨	2,800	4,070.00	11,396,000	
ヨータイ	10,400	1,336.00	13,894,400	
東京窯業	19,300	280.00	5,404,000	
ニッカトー	7,200	475.00	3,420,000	
フジインコーポレーテッド	13,100	5,620.00	73,622,000	
クニミネ工業	5,100	937.00	4,778,700	
エーアンドエーマテリアル	2,800	850.00	2,380,000	
ニチアス	36,800	2,257.00	83,057,600	
ニチハ	22,100	2,334.00	51,581,400	
日本製鉄	708,200	1,938.50	1,372,845,700	貸付有価証券

				7,100株
神戸製鋼所	295,400	559.00	165,128,600	貸付有価証券 4,400株
中山製鋼所	24,600	421.00	10,356,600	
合同製鐵	8,400	1,233.00	10,357,200	
ジェイ エフ イー ホールディングス	416,200	1,509.00	628,045,800	貸付有価証券 12,700株
東京製鐵	52,500	1,381.00	72,502,500	
共英製鋼	17,500	1,271.00	22,242,500	
大和工業	28,600	4,140.00	118,404,000	
東京鐵鋼	7,000	1,275.00	8,925,000	
大阪製鐵	8,600	1,310.00	11,266,000	貸付有価証券 2,200株
淀川製鋼所	20,100	2,359.00	47,415,900	
丸一鋼管	49,800	2,739.00	136,402,200	貸付有価証券 5,700株
モリ工業	4,500	2,484.00	11,178,000	
大同特殊鋼	25,000	3,550.00	88,750,000	
日本高周波鋼業	6,000	331.00	1,986,000	貸付有価証券 100株
日本冶金工業	11,500	2,128.00	24,472,000	
山陽特殊製鋼	15,700	1,957.00	30,724,900	
愛知製鋼	9,100	2,123.00	19,319,300	
日立金属	174,300	2,030.00	353,829,000	貸付有価証券 11,300株（9,000株）
日本金属	4,100	1,147.00	4,702,700	
大平洋金属	9,900	3,200.00	31,680,000	
新日本電工	99,500	306.00	30,447,000	貸付有価証券 1,800株
栗本鐵工所	7,100	1,592.00	11,303,200	
虹技	2,200	907.00	1,995,400	
日本鑄鉄管	1,700	1,005.00	1,708,500	
三菱製鋼	10,400	1,035.00	10,764,000	
日垂鋼業	20,200	258.00	5,211,600	
日本精線	2,600	4,045.00	10,517,000	
エンビプロ・ホールディ ングス	10,700	902.00	9,651,400	貸付有価証券 3,100株（200株）
シンニッタン	19,600	213.00	4,174,800	
新家工業	3,800	1,560.00	5,928,000	

大紀アルミニウム工業所	22,900	1,315.00	30,113,500	貸付有価証券 9,800株
日本軽金属ホールディングス	40,900	1,631.00	66,707,900	貸付有価証券 100株
三井金属鉱業	43,700	3,185.00	139,184,500	貸付有価証券 200株
東邦亜鉛	8,700	2,630.00	22,881,000	貸付有価証券 1,100株
三菱マテリアル	102,400	1,992.00	203,980,800	
住友金属鉱山	197,000	5,220.00	1,028,340,000	
DOWAホールディングス	42,000	5,200.00	218,400,000	
古河機械金属	26,000	1,265.00	32,890,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	18,700	1,180.00	22,066,000	
東邦チタニウム	29,000	1,353.00	39,237,000	貸付有価証券 500株
UACJ	23,700	2,108.00	49,959,600	貸付有価証券 8,900株
CKサンエツ	3,300	3,900.00	12,870,000	
古河電気工業	49,100	2,142.00	105,172,200	貸付有価証券 3,500株
住友電気工業	591,700	1,424.50	842,876,650	
フジクラ	180,400	613.00	110,585,200	貸付有価証券 3,800株
昭和電線ホールディングス	14,100	1,685.00	23,758,500	
東京特殊電線	2,300	2,672.00	6,145,600	
タツタ電線	28,500	459.00	13,081,500	
カナレ電気	2,400	1,681.00	4,034,400	貸付有価証券 1,100株（100株）
平河ヒューテック	9,000	1,140.00	10,260,000	
リョービ	18,800	1,064.00	20,003,200	
アーレスティ	17,200	348.00	5,985,600	
アサヒホールディングス	64,800	2,080.00	134,784,000	貸付有価証券 400株
稲葉製作所	8,800	1,292.00	11,369,600	
宮地エンジニアリンググループ	4,800	3,335.00	16,008,000	
トーカロ	41,700	1,267.00	52,833,900	

アルファＣｏ	6,000	939.00	5,634,000	
SUMCO	255,000	1,920.00	489,600,000	貸付有価証券 54,600株
川田テクノロジーズ	3,200	3,605.00	11,536,000	
RS Technologies	5,300	5,890.00	31,217,000	
ジェイテックコーポレーション	2,100	1,655.00	3,475,500	貸付有価証券 400株（400株）
信和	10,000	792.00	7,920,000	
東洋製罐グループホールディングス	96,200	1,419.00	136,507,800	
ホッカンホールディングス	8,400	1,250.00	10,500,000	
コロナ	8,600	825.00	7,095,000	
横河ブリッジホールディングス	26,200	1,893.00	49,596,600	
駒井ハルテック	2,900	1,882.00	5,457,800	
高田機工	1,400	2,713.00	3,798,200	貸付有価証券 600株
三和ホールディングス	152,600	1,174.00	179,152,400	
文化シャッター	50,100	958.00	47,995,800	貸付有価証券 200株（200株）
三協立山	20,300	597.00	12,119,100	
アルインコ	11,400	867.00	9,883,800	
東洋シャッター	3,600	565.00	2,034,000	
LIXIL	254,700	2,433.00	619,685,100	
日本フィルコン	10,900	504.00	5,493,600	
ノーリツ	29,300	1,500.00	43,950,000	
長府製作所	16,500	1,874.00	30,921,000	
リンナイ	29,700	8,740.00	259,578,000	貸付有価証券 400株
ダイニチ工業	7,700	620.00	4,774,000	
日東精工	19,600	496.00	9,721,600	
三洋工業	2,000	1,741.00	3,482,000	
岡部	28,400	651.00	18,488,400	
ジーテクト	19,300	1,277.00	24,646,100	
東プレ	28,400	1,097.00	31,154,800	
高周波熱錬	26,300	580.00	15,254,000	貸付有価証券 500株

東京製鋼	9,900	832.00	8,236,800	
サンコール	13,800	503.00	6,941,400	
モリテック スチール	12,600	291.00	3,666,600	
パイオラックス	22,600	1,452.00	32,815,200	
エイチワン	15,400	592.00	9,116,800	
日本発條	144,700	846.00	122,416,200	
中央発條	7,800	685.00	5,343,000	
アドバネクス	2,100	1,739.00	3,651,900	
立川ブラインド工業	6,900	1,042.00	7,189,800	
三益半導体工業	12,600	2,256.00	28,425,600	
日本ドライケミカル	3,900	1,520.00	5,928,000	
日本製鋼所	46,600	2,554.00	119,016,400	
三浦工業	67,900	2,768.00	187,947,200	貸付有価証券 6,000株
タクマ	52,000	1,454.00	75,608,000	
ツガミ	34,700	1,188.00	41,223,600	
オークマ	17,700	4,750.00	84,075,000	
芝浦機械	18,300	2,829.00	51,770,700	
アマダ	255,400	1,019.00	260,252,600	
アイダエンジニアリング	40,000	968.00	38,720,000	貸付有価証券 2,600株
滝澤鉄工所	4,700	1,270.00	5,969,000	
F U J I	71,200	2,131.00	151,727,200	
牧野フライス製作所	17,300	4,120.00	71,276,000	
オーエスジー	73,900	1,633.00	120,678,700	
ダイジェット工業	1,800	942.00	1,695,600	貸付有価証券 800株（800株）
旭ダイヤモンド工業	41,500	573.00	23,779,500	
D M G 森精機	93,900	1,631.00	153,150,900	貸付有価証券 100株
ソディック	35,200	736.00	25,907,200	貸付有価証券 200株
ディスコ	23,800	31,200.00	742,560,000	貸付有価証券 100株
日東工器	8,500	1,511.00	12,843,500	
日進工具	12,700	1,425.00	18,097,500	
パンチ工業	13,600	463.00	6,296,800	
富士ダイス	8,100	638.00	5,167,800	

豊和工業	8,300	792.00	6,573,600	
OKK	5,900	1,245.00	7,345,500	貸付有価証券 2,700株
東洋機械金属	10,500	575.00	6,037,500	
津田駒工業	3,000	571.00	1,713,000	
エンシュウ	3,600	660.00	2,376,000	
島精機製作所	23,600	1,793.00	42,314,800	貸付有価証券 200株
オプトラ	20,300	1,809.00	36,722,700	
NCホールディングス	3,700	1,685.00	6,234,500	
イワキポンプ	10,300	1,033.00	10,639,900	
フリー	14,400	1,022.00	14,716,800	
ヤマシンフィルタ	30,200	343.00	10,358,600	貸付有価証券 100株
日阪製作所	18,800	752.00	14,137,600	
やまびこ	29,900	1,379.00	41,232,100	貸付有価証券 100株
野村マイクロ・サイエンス	5,500	3,675.00	20,212,500	貸付有価証券 2,200株（500株）
平田機工	7,500	4,760.00	35,700,000	貸付有価証券 100株
ペガサスミシン製造	16,400	592.00	9,708,800	
マルマエ	6,600	2,083.00	13,747,800	貸付有価証券 3,100株
タツモ	7,500	1,287.00	9,652,500	
ナプテスコ	90,200	2,906.00	262,121,200	貸付有価証券 1,500株
三井海洋開発	17,200	1,193.00	20,519,600	
レオン自動機	17,300	1,103.00	19,081,900	
S M C	47,900	61,550.00	2,948,245,000	
ホソカワミクロン	11,100	2,440.00	27,084,000	
ユニオンツール	6,000	3,730.00	22,380,000	
オイレス工業	22,100	1,508.00	33,326,800	
日精エー・エス・ピー機械	5,700	2,966.00	16,906,200	
サトーホールディングス	21,300	1,830.00	38,979,000	
技研製作所	14,300	3,535.00	50,550,500	
日本エアテック	7,400	1,030.00	7,622,000	貸付有価証券 500株（500株）



カワタ	5,000	949.00	4,745,000	
日精樹脂工業	10,900	942.00	10,267,800	
オカダアイヨン	5,100	1,494.00	7,619,400	
ワイエイシイホールディングス	6,400	1,411.00	9,030,400	
小松製作所	741,600	3,098.00	2,297,476,800	
住友重機械工業	91,600	2,777.00	254,373,200	貸付有価証券 3,100株
日立建機	65,600	3,030.00	198,768,000	貸付有価証券 200株
日工	21,700	614.00	13,323,800	
巴工業	6,200	2,316.00	14,359,200	貸付有価証券 1,500株
井関農機	14,400	1,241.00	17,870,400	
TOWA	14,000	1,948.00	27,272,000	貸付有価証券 2,000株
丸山製作所	3,100	1,536.00	4,761,600	
北川鉄工所	7,000	1,268.00	8,876,000	
ローツエ	8,100	10,150.00	82,215,000	貸付有価証券 100株
タカキタ	5,500	582.00	3,201,000	貸付有価証券 2,500株（200株）
クボタ	792,700	2,287.50	1,813,301,250	貸付有価証券 1,500株
荏原実業	7,500	2,341.00	17,557,500	
三菱化工機	5,100	1,939.00	9,888,900	
月島機械	28,600	1,039.00	29,715,400	
帝国電機製作所	11,100	1,632.00	18,115,200	
東京機械製作所	6,700	812.00	5,440,400	貸付有価証券 100株
新東工業	34,200	676.00	23,119,200	
澁谷工業	13,800	2,324.00	32,071,200	
アイチ コーポレーション	23,300	891.00	20,760,300	
小森コーポレーション	40,500	748.00	30,294,000	貸付有価証券 200株
鶴見製作所	12,200	1,825.00	22,265,000	
住友精密工業	2,400	2,210.00	5,304,000	
日本ギア工業	5,800	257.00	1,490,600	

酒井重工業	2,800	3,075.00	8,610,000	
荏原製作所	65,500	5,830.00	381,865,000	
石井鐵工所	2,200	2,864.00	6,300,800	
西島製作所	14,300	1,264.00	18,075,200	
北越工業	14,800	873.00	12,920,400	
ダイキン工業	198,600	19,625.00	3,897,525,000	
オルガノ	4,700	8,720.00	40,984,000	
トーヨーカネツ	6,000	2,399.00	14,394,000	
栗田工業	86,600	4,500.00	389,700,000	
椿本チエイン	21,400	2,981.00	63,793,400	
大同工業	7,000	904.00	6,328,000	貸付有価証券 100株
木村化工機	13,300	772.00	10,267,600	貸付有価証券 3,300株(1,100株)
アネスト岩田	25,500	804.00	20,502,000	
ダイフク	85,800	7,520.00	645,216,000	貸付有価証券 300株
サムコ	4,200	2,380.00	9,996,000	貸付有価証券 1,100株
加藤製作所	7,800	772.00	6,021,600	
油研工業	2,700	1,689.00	4,560,300	
タダノ	83,300	919.00	76,552,700	
フジテック	55,800	2,595.00	144,801,000	
C K D	46,000	1,643.00	75,578,000	
キトー	13,500	1,650.00	22,275,000	
平和	45,600	1,903.00	86,776,800	
理想科学工業	12,700	2,376.00	30,175,200	
S A N K Y O	35,400	3,765.00	133,281,000	
日本金銭機械	16,600	706.00	11,719,600	
マースグループホールディングス	10,400	1,640.00	17,056,000	
フクシマガリレイ	10,800	3,705.00	40,014,000	
オーイズミ	5,700	457.00	2,604,900	
ダイコク電機	7,500	1,235.00	9,262,500	貸付有価証券 2,600株
竹内製作所	24,900	2,461.00	61,278,900	
アマノ	42,800	2,502.00	107,085,600	貸付有価証券 400株

JUKI	22,800	710.00	16,188,000	貸付有価証券 100株
ジャノメ	13,900	691.00	9,604,900	
マックス	20,900	1,607.00	33,586,300	
グローリー	41,000	2,150.00	88,150,000	
新晃工業	15,200	1,583.00	24,061,600	
大和冷機工業	23,600	1,099.00	25,936,400	
セガサミーホールディングス	162,300	2,220.00	360,306,000	
日本ピストンリング	6,000	1,309.00	7,854,000	
リケン	6,700	2,418.00	16,200,600	
T P R	20,800	1,261.00	26,228,800	
ツバキ・ナカシマ	35,900	886.00	31,807,400	貸付有価証券 1,800株
ホシザキ	47,800	8,040.00	384,312,000	
大豊工業	13,300	634.00	8,432,200	
日本精工	298,800	727.00	217,227,600	貸付有価証券 600株
N T N	333,700	213.00	71,078,100	貸付有価証券 1,300株
ジェイテクト	151,200	933.00	141,069,600	
不二越	13,100	3,690.00	48,339,000	貸付有価証券 200株
日本トムソン	42,300	494.00	20,896,200	
T H K	92,400	2,586.00	238,946,400	貸付有価証券 1,700株
ユーシン精機	12,700	628.00	7,975,600	
前澤給装工業	11,700	902.00	10,553,400	
イーグル工業	19,400	1,036.00	20,098,400	
前澤工業	10,500	628.00	6,594,000	
日本ピラー工業	15,700	2,442.00	38,339,400	
キッツ	52,100	665.00	34,646,500	
マキタ	194,400	3,791.00	736,970,400	貸付有価証券 200株
三井E & Sホールディングス	59,100	360.00	21,276,000	貸付有価証券 11,800株(5,700株)
日立造船	135,500	698.00	94,579,000	
三菱重工業	251,400	4,424.00	1,112,193,600	
I H I	102,200	2,854.00	291,678,800	貸付有価証券

				700株
サノヤスホールディングス	19,600	126.00	2,469,600	貸付有価証券 100株
スター精密	23,600	1,477.00	34,857,200	
日清紡ホールディングス	94,500	962.00	90,909,000	貸付有価証券 3,100株
イビデン	83,500	4,570.00	381,595,000	
コニカミノルタ	349,100	490.00	171,059,000	貸付有価証券 6,900株
ブラザー工業	195,400	2,307.00	450,787,800	
ミネベアミツミ	274,900	2,462.00	676,803,800	貸付有価証券 700株
日立製作所	787,100	6,448.00	5,075,220,800	
東芝	286,000	5,345.00	1,528,670,000	
三菱電機	1,600,100	1,351.00	2,161,735,100	貸付有価証券 2,500株
富士電機	96,100	5,690.00	546,809,000	
東洋電機製造	5,800	936.00	5,428,800	
安川電機	171,600	4,175.00	716,430,000	貸付有価証券 400株
シンフォニアテクノロジー	18,700	1,255.00	23,468,500	
明電舎	26,200	2,288.00	59,945,600	
オリジン	4,000	1,309.00	5,236,000	
山洋電気	6,800	5,450.00	37,060,000	
デンヨー	13,200	1,594.00	21,040,800	
PHCホールディングス	25,200	1,580.00	39,816,000	貸付有価証券 300株
東芝テック	17,600	4,390.00	77,264,000	
芝浦メカトロニクス	2,900	6,920.00	20,068,000	
マブチモーター	37,900	3,470.00	131,513,000	貸付有価証券 1,000株
日本電産	403,900	8,315.00	3,358,428,500	貸付有価証券 900株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,700	392.00	2,626,400	貸付有価証券 600株(600株)
トレックス・セミコンダクター	7,800	2,226.00	17,362,800	
東光高岳	9,100	1,645.00	14,969,500	貸付有価証券 900株

ダブル・スコープ	47,100	869.00	40,929,900	貸付有価証券 5,000株(4,800株)
ダイヘン	17,000	3,680.00	62,560,000	
ヤーマン	26,700	1,182.00	31,559,400	貸付有価証券 100株
JVCケンウッド	133,300	201.00	26,793,300	
ミマキエンジニアリング	14,700	691.00	10,157,700	
I-PEX	7,600	1,438.00	10,928,800	
日新電機	38,300	1,355.00	51,896,500	
大崎電気工業	29,200	499.00	14,570,800	
オムロン	136,200	7,085.00	964,977,000	貸付有価証券 200株
日東工業	20,600	1,542.00	31,765,200	
IDEC	20,300	2,240.00	45,472,000	
正興電機製作所	4,900	1,081.00	5,296,900	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
不二電機工業	3,000	1,134.00	3,402,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	51,900	2,258.00	117,190,200	貸付有価証券 1,800株
サクサホールディングス	3,800	1,492.00	5,669,600	
メルコホールディングス	3,900	3,870.00	15,093,000	貸付有価証券 1,600株
テクノメディカ	3,700	1,548.00	5,727,600	貸付有価証券 1,500株
ダイヤモンドエレクト リックホールディング	4,600	881.00	4,052,600	貸付有価証券 2,100株(1,700株)
日本電気	203,300	5,350.00	1,087,655,000	
富士通	147,200	19,470.00	2,865,984,000	
沖電気工業	65,000	864.00	56,160,000	
岩崎通信機	6,700	802.00	5,373,400	
電気興業	8,300	2,419.00	20,077,700	
サンケン電気	14,900	4,780.00	71,222,000	貸付有価証券 3,400株
ナカヨ	2,800	1,068.00	2,990,400	
アイホン	8,600	1,738.00	14,946,800	
ルネサスエレクトロニク ス	888,900	1,354.00	1,203,570,600	貸付有価証券 200株
セイコーエプソン	196,300	1,958.00	384,355,400	貸付有価証券 1,900株

ワコム	126,900	954.00	121,062,600	貸付有価証券 57,900株
アルバック	32,600	4,990.00	162,674,000	貸付有価証券 2,700株
アクセル	6,600	841.00	5,550,600	貸付有価証券 600株（600株）
E I Z O	12,300	3,445.00	42,373,500	
日本信号	39,400	911.00	35,893,400	
京三製作所	34,100	429.00	14,628,900	
能美防災	20,600	1,951.00	40,190,600	貸付有価証券 200株
ホーチキ	11,200	1,206.00	13,507,200	
星和電機	7,200	511.00	3,679,200	貸付有価証券 100株
エレコム	37,500	1,558.00	58,425,000	貸付有価証券 100株
パナソニック ホール ディングス	1,745,400	1,155.50	2,016,809,700	貸付有価証券 200株
シャープ	176,200	1,085.00	191,177,000	貸付有価証券 19,200株
アンリツ	105,400	1,487.00	156,729,800	貸付有価証券 8,400株（100株）
富士通ゼネラル	44,400	2,166.00	96,170,400	貸付有価証券 100株
ソニーグループ	1,025,100	10,500.00	10,763,550,000	
T D K	237,000	4,065.00	963,405,000	
帝国通信工業	7,200	1,390.00	10,008,000	
タムラ製作所	61,700	544.00	33,564,800	貸付有価証券 10,800株
アルプスアルパイン	141,100	1,326.00	187,098,600	貸付有価証券 200株
池上通信機	4,800	602.00	2,889,600	
日本電波工業	16,400	1,117.00	18,318,800	貸付有価証券 100株
鈴木	8,100	758.00	6,139,800	
メイコー	17,700	3,365.00	59,560,500	
日本トリム	3,100	2,351.00	7,288,100	
ローランド ディー ジー	9,600	3,210.00	30,816,000	
フォスター電機	16,100	729.00	11,736,900	

S M K	3,800	2,162.00	8,215,600	
ヨコオ	11,700	2,534.00	29,647,800	
ティアック	26,000	115.00	2,990,000	貸付有価証券 1,000株（700株）
ホシデン	38,400	1,300.00	49,920,000	
ヒロセ電機	24,600	17,730.00	436,158,000	
日本航空電子工業	36,000	1,884.00	67,824,000	
T O A	17,500	792.00	13,860,000	貸付有価証券 100株
マクセル	31,600	1,145.00	36,182,000	
古野電気	19,400	973.00	18,876,200	貸付有価証券 100株
ユニデンホールディングス	3,600	3,495.00	12,582,000	
スミダコーポレーション	15,300	807.00	12,347,100	
アイコム	5,800	2,463.00	14,285,400	
リオン	6,000	2,394.00	14,364,000	
本多通信工業	12,700	459.00	5,829,300	貸付有価証券 5,600株
横河電機	159,200	2,007.00	319,514,400	貸付有価証券 200株
新電元工業	6,100	2,849.00	17,378,900	
アズビル	95,900	3,820.00	366,338,000	
東亜ディーケーケー	8,100	912.00	7,387,200	貸付有価証券 200株（200株）
日本光電工業	66,100	3,130.00	206,893,000	
チノー	5,200	1,624.00	8,444,800	
共和電業	15,700	341.00	5,353,700	
日本電子材料	8,100	1,858.00	15,049,800	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
堀場製作所	29,500	6,240.00	184,080,000	
アドバンテスト	121,700	8,380.00	1,019,846,000	貸付有価証券 100株
小野測器	6,600	469.00	3,095,400	
エスベック	12,900	1,724.00	22,239,600	貸付有価証券 100株
キーエンス	148,300	50,400.00	7,474,320,000	
日置電機	7,800	7,140.00	55,692,000	
シスメックス	131,400	7,631.00	1,002,713,400	

日本マイクロニクス	27,100	1,461.00	39,593,100	
メガチップス	14,500	3,260.00	47,270,000	
O B A R A G R O U P	7,100	2,861.00	20,313,100	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
澤藤電機	2,000	1,452.00	2,904,000	
原田工業	7,700	921.00	7,091,700	貸付有価証券 3,400株
コーセル	18,100	767.00	13,882,700	
イリソ電子工業	13,700	3,110.00	42,607,000	
オブテックスグループ	26,800	1,633.00	43,764,400	貸付有価証券 100株
千代田インテグレ	6,600	2,079.00	13,721,400	
アイ・オー・データ機器	1,500	1,297.00	1,945,500	
レーザーテック	70,300	17,130.00	1,204,239,000	貸付有価証券 1,600株
スタンレー電気	111,300	2,283.00	254,097,900	貸付有価証券 5,600株
岩崎電気	5,700	2,309.00	13,161,300	
ウシオ電機	81,700	1,685.00	137,664,500	
岡谷電機産業	11,600	273.00	3,166,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	13,900	287.00	3,989,300	
エノモト	4,500	1,530.00	6,885,000	
日本セラミック	15,200	2,323.00	35,309,600	
遠藤照明	7,500	807.00	6,052,500	
古河電池	11,700	1,192.00	13,946,400	貸付有価証券 1,400株（1,300株）
双信電機	7,800	531.00	4,141,800	
山一電機	11,500	1,691.00	19,446,500	貸付有価証券 100株
図研	10,600	2,542.00	26,945,200	
日本電子	33,200	5,800.00	192,560,000	貸付有価証券 100株
カシオ計算機	109,700	1,341.00	147,107,700	貸付有価証券 3,000株
ファナック	143,600	19,460.00	2,794,456,000	
日本シイエムケイ	31,000	520.00	16,120,000	貸付有価証券 400株
エンプラス	4,000	3,475.00	13,900,000	



大真空	21,500	1,106.00	23,779,000	貸付有価証券 700株(200株)
ローム	71,500	9,290.00	664,235,000	
浜松ホトニクス	114,600	5,690.00	652,074,000	貸付有価証券 100株
三井ハイテック	15,400	10,980.00	169,092,000	貸付有価証券 5,100株(5,100株)
新光電気工業	48,100	4,995.00	240,259,500	
京セラ	230,200	6,921.00	1,593,214,200	
太陽誘電	77,200	5,230.00	403,756,000	貸付有価証券 500株
村田製作所	469,300	8,250.00	3,871,725,000	貸付有価証券 100株
双葉電子工業	28,000	665.00	18,620,000	
北陸電気工業	6,100	1,212.00	7,393,200	
ニチコン	48,900	1,245.00	60,880,500	貸付有価証券 1,300株
日本ケミコン	15,500	1,910.00	29,605,000	
K O A	24,000	1,598.00	38,352,000	貸付有価証券 100株
市光工業	19,600	372.00	7,291,200	貸付有価証券 600株
小糸製作所	87,100	4,625.00	402,837,500	
ミツバ	28,600	348.00	9,952,800	
S C R E E Nホールディングス	27,500	10,490.00	288,475,000	
キャノン電子	15,000	1,500.00	22,500,000	
キャノン	813,100	3,130.00	2,545,003,000	
リコー	432,600	990.00	428,274,000	貸付有価証券 2,800株
象印マホービン	43,000	1,341.00	57,663,000	貸付有価証券 300株
M U T O Hホールディングス	2,100	2,228.00	4,678,800	貸付有価証券 300株(100株)
東京エレクトロン	103,800	53,450.00	5,548,110,000	
トヨタ紡織	63,600	2,070.00	131,652,000	
芦森工業	3,100	959.00	2,972,900	
ユニプレス	25,200	762.00	19,202,400	
豊田自動織機	126,900	8,260.00	1,048,194,000	
モリタホールディングス	26,200	1,324.00	34,688,800	

三櫻工業	22,600	703.00	15,887,800	貸付有価証券 4,100株
デンソー	347,000	7,489.00	2,598,683,000	
東海理化電機製作所	43,100	1,362.00	58,702,200	貸付有価証券 200株
川崎重工業	116,600	2,253.00	262,699,800	貸付有価証券 1,300株
名村造船所	46,800	345.00	16,146,000	貸付有価証券 19,000株
日本車輛製造	5,700	2,062.00	11,753,400	
三菱ロジスネクスト	21,700	771.00	16,730,700	
近畿車輛	2,500	1,166.00	2,915,000	
日産自動車	1,929,900	507.10	978,652,290	貸付有価証券 6,100株
いすゞ自動車	500,400	1,517.00	759,106,800	
トヨタ自動車	8,013,700	2,178.50	17,457,845,450	
日野自動車	204,300	700.00	143,010,000	貸付有価証券 6,200株
三菱自動車工業	605,700	333.00	201,698,100	貸付有価証券 11,500株
エフテック	11,100	537.00	5,960,700	
レシップホールディングス	6,500	558.00	3,627,000	
G M B	2,900	709.00	2,056,100	
ファルテック	2,900	633.00	1,835,700	
武蔵精密工業	36,500	1,330.00	48,545,000	貸付有価証券 9,000株
日産車体	24,000	570.00	13,680,000	貸付有価証券 10,900株
新明和工業	45,100	968.00	43,656,800	
極東開発工業	29,000	1,315.00	38,135,000	
トピー工業	13,000	1,052.00	13,676,000	
ティラド	4,000	2,249.00	8,996,000	
タチエス	28,100	1,026.00	28,830,600	
N O K	73,300	1,152.00	84,441,600	
フタバ産業	39,400	374.00	14,735,600	
K Y B	16,100	2,856.00	45,981,600	
大同メタル工業	31,400	556.00	17,458,400	
プレス工業	77,100	391.00	30,146,100	

ミクニ	20,200	378.00	7,635,600	貸付有価証券 400株
太平洋工業	33,200	980.00	32,536,000	
河西工業	20,100	272.00	5,467,200	貸付有価証券 600株
アイシン	119,800	3,780.00	452,844,000	貸付有価証券 3,100株
マツダ	502,900	955.00	480,269,500	貸付有価証券 1,700株
今仙電機製作所	10,700	581.00	6,216,700	貸付有価証券 200株
本田技研工業	1,257,900	3,349.00	4,212,707,100	貸付有価証券 3,300株
スズキ	357,700	3,925.00	1,403,972,500	貸付有価証券 2,200株
S U B A R U	456,000	1,959.00	893,304,000	
安永	7,500	678.00	5,085,000	
ヤマハ発動機	213,500	2,780.00	593,530,000	
T B K	17,400	344.00	5,985,600	
エクセディ	24,700	1,683.00	41,570,100	
豊田合成	50,700	1,914.00	97,039,800	
愛三工業	25,600	744.00	19,046,400	
盟和産業	2,300	1,013.00	2,329,900	
日本プラスト	12,500	491.00	6,137,500	
ヨロズ	14,400	740.00	10,656,000	貸付有価証券 300株
エフ・シー・シー	26,700	1,360.00	36,312,000	
シマノ	63,900	22,345.00	1,427,845,500	貸付有価証券 100株
テイ・エス テック	69,100	1,404.00	97,016,400	貸付有価証券 100株
ジャムコ	9,600	781.00	7,497,600	
テルモ	463,100	3,727.00	1,725,973,700	貸付有価証券 100株
クリエートメディック	4,900	975.00	4,777,500	
日機装	46,600	835.00	38,911,000	
日本エム・ディ・エム	9,400	1,504.00	14,137,600	
島津製作所	205,600	4,320.00	888,192,000	
J M S	13,400	573.00	7,678,200	

クボテック	3,500	255.00	892,500	貸付有価証券 100株(100株)
長野計器	11,500	1,112.00	12,788,000	
ブイ・テクノロジー	7,200	3,060.00	22,032,000	
東京計器	10,400	1,137.00	11,824,800	
愛知時計電機	6,700	1,431.00	9,587,700	
インターアクション	8,200	1,885.00	15,457,000	貸付有価証券 900株(900株)
オーバル	14,600	307.00	4,482,200	
東京精密	26,900	4,385.00	117,956,500	
マニー	63,400	1,408.00	89,267,200	
ニコン	243,500	1,440.00	350,640,000	貸付有価証券 800株
トプコン	76,900	1,594.00	122,578,600	貸付有価証券 100株
オリンパス	836,200	2,214.50	1,851,764,900	貸付有価証券 100株
理研計器	12,400	3,835.00	47,554,000	
タムロン	12,300	2,327.00	28,622,100	
H O Y A	319,300	12,510.00	3,994,443,000	
シード	7,600	523.00	3,974,800	
ノーリツ鋼機	14,700	2,078.00	30,546,600	貸付有価証券 100株
A & D ホロンホールディングス	18,400	852.00	15,676,800	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
朝日インテック	179,400	2,374.00	425,895,600	貸付有価証券 1,200株
シチズン時計	181,000	480.00	86,880,000	貸付有価証券 2,400株
リズム	5,100	1,723.00	8,787,300	
大研医器	12,900	505.00	6,514,500	
メニコン	53,100	2,615.00	138,856,500	
シンシア	1,700	424.00	720,800	
松風	6,400	1,579.00	10,105,600	
セイコーホールディングス	23,100	2,076.00	47,955,600	貸付有価証券 400株
ニプロ	119,100	1,013.00	120,648,300	
中本パックス	4,600	1,569.00	7,217,400	
スノーピーク	21,300	2,155.00	45,901,500	貸付有価証券

				10,000株(200株)
パラマウントベッドホールディングス	31,400	2,115.00	66,411,000	貸付有価証券 2,000株
トランザクション	9,500	984.00	9,348,000	貸付有価証券 600株
粧美堂	4,500	422.00	1,899,000	貸付有価証券 2,000株
ニホンフラッシュ	13,600	948.00	12,892,800	貸付有価証券 200株
前田工織	16,900	2,642.00	44,649,800	貸付有価証券 3,100株
永大産業	20,200	272.00	5,494,400	
アートネイチャー	14,000	739.00	10,346,000	
バンダイナムコホールディングス	142,900	8,239.00	1,177,353,100	貸付有価証券 100株
アイフィスジャパン	4,200	626.00	2,629,200	貸付有価証券 1,700株
共立印刷	25,700	132.00	3,392,400	
S H O E I	15,000	4,695.00	70,425,000	
フランスベッドホールディングス	21,000	874.00	18,354,000	
パイロットコーポレーション	26,200	5,120.00	134,144,000	
萩原工業	10,300	1,065.00	10,969,500	貸付有価証券 2,200株
フジシールインターナショナル	37,700	1,750.00	65,975,000	
タカラトミー	67,600	1,146.00	77,469,600	
広済堂ホールディングス	10,100	780.00	7,878,000	
エステールホールディングス	3,800	637.00	2,420,600	貸付有価証券 1,800株
タカノ	5,600	795.00	4,452,000	貸付有価証券 2,300株
プロネクサス	12,700	1,046.00	13,284,200	
ホクシン	11,500	179.00	2,058,500	貸付有価証券 500株
ウッドワン	5,000	1,284.00	6,420,000	
大建工業	9,200	2,104.00	19,356,800	
凸版印刷	236,900	2,182.00	516,915,800	
大日本印刷	188,100	2,766.00	520,284,600	

共同印刷	4,500	2,739.00	12,325,500	
N I S S H A	31,900	1,491.00	47,562,900	
光村印刷	1,400	1,301.00	1,821,400	
T A K A R A & C O M P A N Y	9,800	1,927.00	18,884,600	貸付有価証券 4,600株
アシックス	138,300	1,877.00	259,589,100	
ツツミ	4,100	1,898.00	7,781,800	
ローランド	11,400	4,235.00	48,279,000	
小松ウオール工業	5,000	1,835.00	9,175,000	
ヤマハ	95,200	4,995.00	475,524,000	
河合楽器製作所	4,400	2,881.00	12,676,400	
クリナップ	15,200	525.00	7,980,000	
ビジョン	98,900	2,124.00	210,063,600	貸付有価証券 5,900株
兼松サステック	1,100	1,739.00	1,912,900	
キングジム	13,600	925.00	12,580,000	貸付有価証券 200株
リンテック	33,800	2,416.00	81,660,800	
イトーキ	30,200	358.00	10,811,600	
任天堂	92,400	56,360.00	5,207,664,000	貸付有価証券 100株
三菱鉛筆	25,300	1,334.00	33,750,200	
タカラスタンダード	31,300	1,309.00	40,971,700	
コクヨ	76,300	1,744.00	133,067,200	
ナカバヤシ	14,100	488.00	6,880,800	
グローブライド	13,800	2,424.00	33,451,200	
オカムラ	52,800	1,196.00	63,148,800	
美津濃	15,300	2,087.00	31,931,100	
東京電力ホールディング ス	1,224,700	519.00	635,619,300	
中部電力	487,900	1,345.00	656,225,500	
関西電力	604,200	1,269.00	766,729,800	
中国電力	249,200	915.00	228,018,000	
北陸電力	146,100	555.00	81,085,500	貸付有価証券 1,100株
東北電力	374,800	775.00	290,470,000	
四国電力	143,600	801.00	115,023,600	
九州電力	329,300	881.00	290,113,300	

北海道電力	142,200	515.00	73,233,000	貸付有価証券 300株
沖縄電力	34,700	1,245.00	43,201,500	
電源開発	133,300	1,830.00	243,939,000	
エフオン	9,900	535.00	5,296,500	貸付有価証券 4,300株
イーレックス	23,100	1,830.00	42,273,000	
レノバ	32,100	1,516.00	48,663,600	貸付有価証券 14,500株（400株）
東京瓦斯	306,200	2,547.00	779,891,400	
大阪瓦斯	289,300	2,413.00	698,080,900	貸付有価証券 600株
東邦瓦斯	71,300	3,160.00	225,308,000	
北海道瓦斯	8,100	1,547.00	12,530,700	
広島ガス	30,300	321.00	9,726,300	
西部ガスホールディングス	17,500	2,056.00	35,980,000	
静岡ガス	41,300	908.00	37,500,400	貸付有価証券 400株
メタウォーター	17,000	2,043.00	34,731,000	
S B S ホールディングス	12,100	2,938.00	35,549,800	
東武鉄道	156,400	2,973.00	464,977,200	
相鉄ホールディングス	51,100	2,243.00	114,617,300	
東急	402,200	1,579.00	635,073,800	貸付有価証券 400株
京浜急行電鉄	200,800	1,296.00	260,236,800	貸付有価証券 800株
小田急電鉄	230,900	1,882.00	434,553,800	貸付有価証券 1,000株
京王電鉄	80,600	4,670.00	376,402,000	貸付有価証券 200株
京成電鉄	108,000	3,250.00	351,000,000	貸付有価証券 1,300株
富士急行	18,600	3,835.00	71,331,000	
新京成電鉄	3,800	2,658.00	10,100,400	貸付有価証券 700株（700株）
東日本旅客鉄道	275,200	6,610.00	1,819,072,000	
西日本旅客鉄道	190,100	4,770.00	906,777,000	
東海旅客鉄道	129,100	16,160.00	2,086,256,000	
西武ホールディングス	208,200	1,287.00	267,953,400	

鴻池運輸	25,100	1,146.00	28,764,600	
西日本鉄道	43,300	2,576.00	111,540,800	
ハマキョウレックス	11,300	2,946.00	33,289,800	
サカイ引越センター	7,500	4,590.00	34,425,000	
近鉄グループホールディングス	151,800	3,740.00	567,732,000	貸付有価証券 500株
阪急阪神ホールディングス	189,500	3,430.00	649,985,000	
南海電気鉄道	67,700	2,463.00	166,745,100	
京阪ホールディングス	66,100	2,923.00	193,210,300	
神戸電鉄	3,700	3,230.00	11,951,000	貸付有価証券 1,500株
名古屋鉄道	163,200	2,149.00	350,716,800	
山陽電気鉄道	11,600	2,063.00	23,930,800	貸付有価証券 100株
アルプス物流	10,800	1,062.00	11,469,600	貸付有価証券 300株（300株）
ヤマトホールディングス	217,200	2,429.00	527,578,800	貸付有価証券 200株
山九	39,700	3,725.00	147,882,500	
丸運	8,300	239.00	1,983,700	
丸全昭和運輸	11,900	3,180.00	37,842,000	
センコーグループホールディングス	77,200	889.00	68,630,800	
トナミホールディングス	3,500	3,575.00	12,512,500	
ニッコンホールディングス	50,900	1,994.00	101,494,600	貸付有価証券 100株
日本石油輸送	1,700	2,554.00	4,341,800	
福山通運	23,600	3,815.00	90,034,000	
セイノーホールディングス	98,500	1,095.00	107,857,500	貸付有価証券 100株
エスライン	4,500	872.00	3,924,000	
神奈川中央交通	3,800	3,300.00	12,540,000	貸付有価証券 1,500株
日立物流	29,900	8,510.00	254,449,000	貸付有価証券 7,100株
丸和運輸機関	30,600	1,499.00	45,869,400	貸付有価証券 6,300株
C & F ロジホールディングス	14,800	1,114.00	16,487,200	



九州旅客鉄道	114,600	2,525.00	289,365,000	
S Gホールディングス	282,000	2,329.00	656,778,000	
N I P P O N E X P R E S Sホールディング	51,100	7,610.00	388,871,000	
日本郵船	129,600	9,270.00	1,201,392,000	貸付有価証券 200株
商船三井	251,300	3,150.00	791,595,000	貸付有価証券 2,100株
川崎汽船	47,700	8,200.00	391,140,000	貸付有価証券 1,400株
N Sユナイテッド海運	8,100	3,830.00	31,023,000	貸付有価証券 500株
明治海運	17,100	727.00	12,431,700	貸付有価証券 8,300株
飯野海運	68,200	690.00	47,058,000	貸付有価証券 200株
共栄タンカー	2,700	1,128.00	3,045,600	貸付有価証券 100株
乾汽船	10,200	1,627.00	16,595,400	貸付有価証券 2,500株（300株）
日本航空	348,000	2,134.00	742,632,000	貸付有価証券 1,500株
A N Aホールディングス	385,500	2,402.50	926,163,750	貸付有価証券 300株
パスコ	2,900	1,299.00	3,767,100	
トランコム	4,300	7,100.00	30,530,000	貸付有価証券 1,900株
日新	12,000	1,620.00	19,440,000	
三菱倉庫	46,200	3,085.00	142,527,000	貸付有価証券 1,700株
三井倉庫ホールディング ス	16,000	2,368.00	37,888,000	
住友倉庫	51,000	2,027.00	103,377,000	
澁澤倉庫	8,800	2,237.00	19,685,600	
東陽倉庫	24,600	308.00	7,576,800	
日本トランスシティ	31,800	583.00	18,539,400	貸付有価証券 200株
ケイヒン	2,700	1,333.00	3,599,100	
中央倉庫	9,000	948.00	8,532,000	
川西倉庫	2,800	1,127.00	3,155,600	貸付有価証券 1,200株

安田倉庫	12,000	961.00	11,532,000	貸付有価証券 100株
ファイズホールディングス	3,300	679.00	2,240,700	貸付有価証券 200株
東洋埠頭	4,600	1,417.00	6,518,200	
上組	82,100	2,226.00	182,754,600	
サンリツ	4,200	778.00	3,267,600	
キムラユニティー	4,000	1,440.00	5,760,000	
キューソー流通システム	7,700	1,075.00	8,277,500	貸付有価証券 3,600株
近鉄エクスプレス	29,300	3,070.00	89,951,000	貸付有価証券 300株
東海運	8,800	297.00	2,613,600	
エーアイティー	9,700	1,518.00	14,724,600	貸付有価証券 300株（300株）
内外トランスライン	6,000	1,899.00	11,394,000	貸付有価証券 2,500株
日本コンセプト	4,900	1,332.00	6,526,800	貸付有価証券 100株（100株）
NEC ネットエスアイ	53,100	1,801.00	95,633,100	
クロスキャット	8,700	852.00	7,412,400	貸付有価証券 1,400株
システナ	229,100	414.00	94,847,400	
デジタルアーツ	8,600	6,770.00	58,222,000	
日鉄ソリューションズ	24,800	3,715.00	92,132,000	
キューブシステム	8,100	894.00	7,241,400	貸付有価証券 3,400株
WOW WORLD	2,200	1,098.00	2,415,600	貸付有価証券 1,000株
コア	6,800	1,380.00	9,384,000	
手間いらず	2,300	4,750.00	10,925,000	貸付有価証券 400株（400株）
ラクーンホールディングス	13,600	1,396.00	18,985,600	貸付有価証券 900株
ソリトンシステムズ	8,000	1,292.00	10,336,000	貸付有価証券 200株（200株）
ソフトクリエイイトホールディングス	7,000	3,755.00	26,285,000	
T I S	148,900	2,939.00	437,617,100	貸付有価証券 200株
J N S ホールディングス	7,400	393.00	2,908,200	貸付有価証券

				300株
グリー	73,100	914.00	66,813,400	貸付有価証券 23,100株(5,400株)
GMOベパボ	1,700	1,894.00	3,219,800	貸付有価証券 100株(100株)
コーエーテクモホール ディングス	51,200	4,105.00	210,176,000	貸付有価証券 500株
三菱総合研究所	8,300	4,305.00	35,731,500	
ボルテージ	4,300	352.00	1,513,600	貸付有価証券 400株(100株)
電算	1,800	2,207.00	3,972,600	
A G S	7,600	754.00	5,730,400	
ファインデックス	13,500	595.00	8,032,500	
ブレインパッド	13,600	1,136.00	15,449,600	貸付有価証券 600株(600株)
K L a b	28,800	427.00	12,297,600	
ポルトゥウィンホール ディングス	23,300	1,005.00	23,416,500	
ネクソン	363,600	2,944.00	1,070,438,400	
アイスタイル	41,400	155.00	6,417,000	貸付有価証券 7,300株(7,200株)
エムアップホールディ ングス	18,500	945.00	17,482,500	
エイチーム	10,700	698.00	7,468,600	貸付有価証券 100株(100株)
エニグモ	17,300	551.00	9,532,300	貸付有価証券 500株
テクノスジャパン	12,400	445.00	5,518,000	
e n i s h	10,800	313.00	3,380,400	貸付有価証券 900株
コロプラ	52,800	616.00	32,524,800	貸付有価証券 3,000株
オルトプラス	12,100	310.00	3,751,000	貸付有価証券 1,500株
ブロードリーフ	79,600	360.00	28,656,000	貸付有価証券 43,600株
クロス・マーケティング グループ	6,100	858.00	5,233,800	貸付有価証券 2,100株(1,500株)
デジタルハーツホール ディングス	7,300	1,651.00	12,052,300	
システム情報	12,000	909.00	10,908,000	

メディアドゥ	5,600	1,686.00	9,441,600	
じげん	45,400	289.00	13,120,600	貸付有価証券 200株
ブイキューブ	16,300	1,055.00	17,196,500	貸付有価証券 7,600株（5,400株）
エンカレッジ・テクノロジー	3,500	519.00	1,816,500	
サイバーリンクス	5,400	1,025.00	5,535,000	
ディー・エル・イー	10,800	286.00	3,088,800	貸付有価証券 4,700株（2,800株）
フィックスターズ	16,500	742.00	12,243,000	貸付有価証券 700株
CARTA HOLDINGS	6,500	2,292.00	14,898,000	貸付有価証券 200株（200株）
オブティム	11,200	802.00	8,982,400	貸付有価証券 3,400株（3,400株）
セレス	6,000	1,327.00	7,962,000	貸付有価証券 400株（400株）
SHIFT	8,700	21,350.00	185,745,000	貸付有価証券 3,100株（3,100株）
ティーガイア	14,200	1,711.00	24,296,200	
セック	2,300	2,182.00	5,018,600	
テクマトリックス	27,100	1,594.00	43,197,400	
プロシップ	5,300	1,375.00	7,287,500	貸付有価証券 100株（100株）
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,700	2,576.00	107,419,200	貸付有価証券 500株
GMOペイメントゲートウェイ	31,100	9,750.00	303,225,000	貸付有価証券 100株
ザッパラス	6,000	417.00	2,502,000	
システムリサーチ	4,700	1,922.00	9,033,400	
インターネットイニシアティブ	42,800	3,925.00	167,990,000	
さくらインターネット	17,200	567.00	9,752,400	
ヴィンクス	4,500	1,097.00	4,936,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,600	5,030.00	18,108,000	貸付有価証券 1,200株（1,100株）
SRAホールディングス	7,700	2,798.00	21,544,600	
システムインテグレータ	5,100	479.00	2,442,900	
朝日ネット	14,600	572.00	8,351,200	

e B A S E	19,200	415.00	7,968,000	貸付有価証券 400株
アバント	17,200	1,191.00	20,485,200	貸付有価証券 100株
アドソル日進	5,700	1,542.00	8,789,400	貸付有価証券 100株（100株）
ODKソリューションズ	3,300	602.00	1,986,600	
フリービット	8,300	921.00	7,644,300	
コムチュア	18,000	2,852.00	51,336,000	
サイバーコム	2,400	1,121.00	2,690,400	
アステリア	11,600	880.00	10,208,000	
アイル	8,500	1,307.00	11,109,500	
マークライnz	8,100	2,499.00	20,241,900	
メディカル・データ・ピ ジョン	20,300	933.00	18,939,900	貸付有価証券 2,800株
g u m i	22,200	518.00	11,499,600	貸付有価証券 7,500株（7,500株）
ショーケース	3,500	429.00	1,501,500	
モバイルファクトリー	3,600	986.00	3,549,600	貸付有価証券 1,000株（900株）
テラスカイ	5,800	1,263.00	7,325,400	貸付有価証券 2,800株（1,000株）
デジタル・インフォメー ション・テクノロジ	7,100	1,158.00	8,221,800	
P C Iホールディングス	6,900	977.00	6,741,300	
パイプドHD	2,900	2,650.00	7,685,000	
アイピーシー	2,500	482.00	1,205,000	貸付有価証券 300株（300株）
ネオジャパン	4,500	1,158.00	5,211,000	貸付有価証券 700株（700株）
P R T I M E S	3,400	2,009.00	6,830,600	貸付有価証券 1,500株（1,200株）
ラクス	73,700	1,333.00	98,242,100	貸付有価証券 3,800株
ランドコンピュータ	3,700	900.00	3,330,000	貸付有価証券 100株（100株）
ダブルスタンダード	4,800	1,762.00	8,457,600	
オープンドア	9,500	1,644.00	15,618,000	貸付有価証券 4,400株（2,300株）
マイネット	5,700	513.00	2,924,100	

アカツキ	7,200	2,885.00	20,772,000	
ベネフィットジャパン	1,200	2,005.00	2,406,000	
Ubicomホールディングス	4,200	2,599.00	10,915,800	貸付有価証券 1,300株
カナミックネットワーク	17,900	489.00	8,753,100	
ノムラシステムコーポレーション	8,300	227.00	1,884,100	貸付有価証券 600株（600株）
チェンジ	30,900	1,724.00	53,271,600	貸付有価証券 13,500株（3,500株）
シンクロ・フード	8,200	287.00	2,353,400	
オークネット	8,500	1,467.00	12,469,500	貸付有価証券 3,500株
キャピタル・アセット・プランニング	3,100	723.00	2,241,300	
セグエグループ	4,200	550.00	2,310,000	
エイトレッド	2,300	2,003.00	4,606,900	貸付有価証券 1,300株
マクロミル	33,600	1,097.00	36,859,200	
ビーグリー	3,800	1,341.00	5,095,800	貸付有価証券 900株
オロ	5,100	1,832.00	9,343,200	貸付有価証券 300株（300株）
ユーザーローカル	4,900	1,602.00	7,849,800	
テモナ	3,300	368.00	1,214,400	
ニーズウェル	4,000	678.00	2,712,000	
マネーフォワード	32,600	3,465.00	112,959,000	貸付有価証券 1,500株
サインポスト	5,200	843.00	4,383,600	貸付有価証券 700株（400株）
電算システムホールディングス	6,600	2,562.00	16,909,200	
ソルクシーズ	13,600	380.00	5,168,000	
フェイス	4,200	723.00	3,036,600	
プロトコーポレーション	17,000	1,032.00	17,544,000	
ハイマックス	4,300	1,269.00	5,456,700	
野村総合研究所	300,000	3,330.00	999,000,000	
サイバネットシステム	11,400	797.00	9,085,800	貸付有価証券 200株
CEホールディングス	8,200	455.00	3,731,000	貸付有価証券 100株

日本システム技術	3,000	2,400.00	7,200,000	
イメージホールディングス	18,500	1,540.00	28,490,000	
東邦システムサイエンス	4,200	895.00	3,759,000	貸付有価証券 1,700株
ソースネクスト	69,200	173.00	11,971,600	貸付有価証券 19,700株（13,700株）
インフォコム	17,600	2,089.00	36,766,400	
シンプレクス・ホールディングス	25,400	1,787.00	45,389,800	貸付有価証券 1,200株
HEROZ	4,600	881.00	4,052,600	貸付有価証券 100株
ラクスル	18,100	2,320.00	41,992,000	貸付有価証券 8,400株（300株）
I P S	4,400	2,185.00	9,614,000	
F I G	17,400	284.00	4,941,600	貸付有価証券 7,400株
システムサポート	5,800	1,022.00	5,927,600	
イーソル	9,800	604.00	5,919,200	貸付有価証券 2,200株（500株）
アルテリア・ネットワークス	18,600	1,365.00	25,389,000	
東海ソフト	2,500	932.00	2,330,000	
ウイングアーク1st	12,200	1,290.00	15,738,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	3,600	1,495.00	5,382,000	
サーバーワークス	2,700	1,975.00	5,332,500	貸付有価証券 1,200株（200株）
東名	1,400	747.00	1,045,800	
ヴィッツ	1,500	1,172.00	1,758,000	
トビラシステムズ	3,200	752.00	2,406,400	
Sansan	55,000	1,120.00	61,600,000	貸付有価証券 17,700株
Link-U	2,900	636.00	1,844,400	貸付有価証券 500株（500株）
ギフトィ	14,200	911.00	12,936,200	貸付有価証券 6,600株（6,500株）
ベース	2,700	5,950.00	16,065,000	
JMDC	20,100	5,310.00	106,731,000	貸付有価証券 200株
フォーカスシステムズ	10,500	891.00	9,355,500	

クレスコ	11,700	1,862.00	21,785,400	
フジ・メディア・ホールディングス	150,700	1,137.00	171,345,900	
オービック	50,600	18,240.00	922,944,000	貸付有価証券 100株
ジャストシステム	22,800	5,350.00	121,980,000	
TDCソフト	13,600	1,135.00	15,436,000	
Zホールディングス	2,315,600	436.40	1,010,527,840	
トレンドマイクロ	83,400	7,200.00	600,480,000	貸付有価証券 800株
IDホールディングス	10,100	830.00	8,383,000	
日本オラクル	26,100	8,460.00	220,806,000	
アルファシステムズ	4,300	3,720.00	15,996,000	
フューチャー	33,900	1,719.00	58,274,100	貸付有価証券 900株
CAC Holdings	9,000	1,357.00	12,213,000	
SBテクノロジー	6,900	2,057.00	14,193,300	
トーセ	4,200	715.00	3,003,000	
オービックビジネスコンサルタント	15,300	4,360.00	66,708,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	73,200	3,005.00	219,966,000	
アイティフォー	19,400	798.00	15,481,200	
東計電算	1,900	5,710.00	10,849,000	
エクスネット	2,500	998.00	2,495,000	
大塚商会	86,900	4,135.00	359,331,500	
サイボウズ	21,400	1,214.00	25,979,600	
電通国際情報サービス	22,100	3,865.00	85,416,500	
ACCESS	18,100	562.00	10,172,200	
デジタルガレージ	26,500	4,105.00	108,782,500	
EMシステムズ	26,500	945.00	25,042,500	
ウェザーニューズ	5,200	6,360.00	33,072,000	貸付有価証券 2,100株
CIJ	12,400	748.00	9,275,200	
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,915.00	7,047,000	
日本エンタープライズ	16,300	164.00	2,673,200	
WOWOW	7,300	1,551.00	11,322,300	貸付有価証券



				3,200株
スカラ	13,500	749.00	10,111,500	
インテリジェント ウェイブ	8,000	582.00	4,656,000	
I M A G I C A G R O U P	12,900	648.00	8,359,200	貸付有価証券 100株
ネットワンシステムズ	59,200	2,958.00	175,113,600	貸付有価証券 200株
システムソフト	38,800	101.00	3,918,800	貸付有価証券 9,200株
アルゴグラフィックス	12,500	2,984.00	37,300,000	
マーベラス	25,300	753.00	19,050,900	
エイベックス	27,700	1,354.00	37,505,800	
B I P R O G Y	50,100	2,860.00	143,286,000	
兼松エレクトロニクス	8,700	3,785.00	32,929,500	
都築電気	7,900	1,466.00	11,581,400	
T B S ホールディングス	90,100	1,761.00	158,666,100	貸付有価証券 900株
日本テレビホールディングス	134,000	1,269.00	170,046,000	
朝日放送グループホールディングス	14,900	709.00	10,564,100	貸付有価証券 400株(400株)
テレビ朝日ホールディングス	38,600	1,509.00	58,247,400	貸付有価証券 500株
スカパー J S A T ホールディングス	136,000	468.00	63,648,000	
テレビ東京ホールディングス	10,800	2,005.00	21,654,000	
日本 B S 放送	5,400	1,018.00	5,497,200	貸付有価証券 2,400株
ビジョン	26,700	1,229.00	32,814,300	貸付有価証券 2,300株
スマートバリュー	3,700	555.00	2,053,500	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	14,200	2,046.00	29,053,200	貸付有価証券 5,100株(400株)
ワイヤレスゲート	6,600	295.00	1,947,000	
コネクシオ	11,400	1,448.00	16,507,200	
日本通信	133,500	173.00	23,095,500	貸付有価証券 46,800株(8,200株)
クロップス	2,900	989.00	2,868,100	

日本電信電話	1,719,700	3,851.00	6,622,564,700	
K D D I	1,170,600	4,343.00	5,083,915,800	貸付有価証券 5,700株
ソフトバンク	2,432,100	1,512.00	3,677,335,200	
光通信	18,500	14,970.00	276,945,000	
エムティーアイ	14,500	446.00	6,467,000	貸付有価証券 200株
G M Oインターネット	56,200	2,409.00	135,385,800	
ファイバーゲート	7,300	1,182.00	8,628,600	貸付有価証券 500株（500株）
アйдママーケティング コミュニケーション	3,400	284.00	965,600	
K A D O K A W A	87,200	3,080.00	268,576,000	
学研ホールディングス	22,700	868.00	19,703,600	貸付有価証券 900株
ゼンリン	26,200	916.00	23,999,200	
昭文社ホールディングス	6,500	404.00	2,626,000	貸付有価証券 300株（300株）
インプレスホールディン グス	13,300	225.00	2,992,500	
アイネット	8,000	1,233.00	9,864,000	
松竹	10,200	12,760.00	130,152,000	
東宝	94,700	4,800.00	454,560,000	
東映	5,000	17,120.00	85,600,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	427,500	2,265.00	968,287,500	貸付有価証券 300株
ピー・シー・エー	9,400	1,280.00	12,032,000	
ビジネスブレイン太田昭 和	4,700	1,505.00	7,073,500	
D T S	29,900	2,966.00	88,683,400	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	74,700	5,280.00	394,416,000	
シーイーシー	17,200	1,210.00	20,812,000	貸付有価証券 300株
カブコン	151,400	3,325.00	503,405,000	貸付有価証券 1,500株
アイ・エス・ビー	7,500	1,010.00	7,575,000	貸付有価証券 700株
ジャステック	9,300	1,130.00	10,509,000	
S C S K	111,200	2,157.00	239,858,400	

日本システムウエア	6,100	2,292.00	13,981,200	
アイネス	15,000	1,470.00	22,050,000	
T K C	26,300	3,560.00	93,628,000	貸付有価証券 400株
富士ソフト	16,600	6,850.00	113,710,000	貸付有価証券 300株（300株）
N S D	50,300	2,311.00	116,243,300	
コナミホールディングス	58,300	7,570.00	441,331,000	
福井コンピュータホールディングス	7,400	3,230.00	23,902,000	
J B C Cホールディングス	10,800	1,491.00	16,102,800	
ミロク情報サービス	14,100	1,284.00	18,104,400	
ソフトバンクグループ	962,900	4,900.00	4,718,210,000	
高千穂交易	6,000	1,512.00	9,072,000	貸付有価証券 2,200株
オルパヘルスケアホールディングス	2,600	1,703.00	4,427,800	
伊藤忠食品	3,700	4,815.00	17,815,500	
エレマテック	12,900	1,180.00	15,222,000	
J A L U X	1,300	2,554.00	3,320,200	
あらた	12,500	3,705.00	46,312,500	
トーメンデバイス	2,400	5,670.00	13,608,000	
東京エレクトロン デバイス	4,800	5,580.00	26,784,000	
フィールズ	14,100	856.00	12,069,600	貸付有価証券 500株（500株）
双日	173,800	1,975.00	343,255,000	貸付有価証券 6,100株
アルフレッサ ホールディングス	175,100	1,820.00	318,682,000	貸付有価証券 2,200株
横浜冷凍	43,200	860.00	37,152,000	
神栄	2,300	855.00	1,966,500	
ラサ商事	7,700	977.00	7,522,900	
アルコニックス	20,200	1,361.00	27,492,200	
神戸物産	120,500	2,910.00	350,655,000	貸付有価証券 4,900株
ハイパー	4,000	469.00	1,876,000	
あい ホールディングス	23,000	1,662.00	38,226,000	

ディービーエックス	5,500	1,012.00	5,566,000	
ダイワボウホールディングス	75,100	1,661.00	124,741,100	
マクニカ・富士エレホールディングス	38,400	2,753.00	105,715,200	貸付有価証券 700株
ラクト・ジャパン	5,500	2,008.00	11,044,000	貸付有価証券 2,500株（100株）
グリムス	7,200	1,597.00	11,498,400	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,200	739.00	20,100,800	
八洲電機	11,600	939.00	10,892,400	貸付有価証券 5,100株
メディアスホールディングス	9,200	963.00	8,859,600	貸付有価証券 100株
レスターホールディングス	15,300	2,028.00	31,028,400	貸付有価証券 4,000株
ジュテックホールディングス	3,500	1,047.00	3,664,500	貸付有価証券 1,600株
大光	6,800	713.00	4,848,400	貸付有価証券 3,100株
OCHIホールディングス	4,300	1,227.00	5,276,100	
TOKAIホールディングス	78,100	885.00	69,118,500	
黒谷	4,400	576.00	2,534,400	貸付有価証券 1,900株（800株）
Cominix	2,800	728.00	2,038,400	
三洋貿易	15,700	964.00	15,134,800	
ビューティガレージ	2,600	2,624.00	6,822,400	貸付有価証券 1,200株（1,000株）
ウイン・パートナーズ	11,600	990.00	11,484,000	
ミタチ産業	4,000	874.00	3,496,000	
シップヘルスケアホールディングス	49,900	2,117.00	105,638,300	貸付有価証券 400株
明治電機工業	5,100	1,029.00	5,247,900	
デリカフーズホールディングス	6,200	526.00	3,261,200	貸付有価証券 2,600株
スターティアホールディングス	3,600	530.00	1,908,000	貸付有価証券 100株
コメダホールディングス	35,200	2,242.00	78,918,400	貸付有価証券

				100株
ピーバンドットコム	2,300	550.00	1,265,000	
アセンテック	5,500	693.00	3,811,500	貸付有価証券 2,400株
富士興産	4,000	896.00	3,584,000	
協栄産業	1,600	1,293.00	2,068,800	
フルサト・マルカホールディングス	15,100	3,470.00	52,397,000	貸付有価証券 100株
ヤマエグループホールディングス	10,200	1,046.00	10,669,200	
小野建	15,200	1,494.00	22,708,800	
南陽	3,200	1,800.00	5,760,000	貸付有価証券 100株
佐鳥電機	10,000	1,272.00	12,720,000	貸付有価証券 100株
エコートレーディング	3,400	570.00	1,938,000	
伯東	9,800	2,888.00	28,302,400	貸付有価証券 100株
コンドーテック	12,000	1,090.00	13,080,000	
中山福	8,500	346.00	2,941,000	貸付有価証券 100株(100株)
ナガイレーベン	20,700	1,921.00	39,764,700	
三菱食品	15,500	3,060.00	47,430,000	
松田産業	11,700	2,210.00	25,857,000	
第一興商	30,600	3,575.00	109,395,000	貸付有価証券 1,600株
メディカルホールディングス	165,700	2,224.00	368,516,800	貸付有価証券 300株
S P K	6,400	1,304.00	8,345,600	
萩原電気ホールディングス	5,800	1,895.00	10,991,000	
アズワン	23,100	6,400.00	147,840,000	貸付有価証券 900株
スズデン	5,400	1,965.00	10,611,000	
尾家産業	4,100	889.00	3,644,900	
シモジマ	9,900	913.00	9,038,700	
ドウシシャ	15,200	1,550.00	23,560,000	貸付有価証券 6,800株
小津産業	3,500	2,001.00	7,003,500	貸付有価証券 1,600株

高速	9,200	1,540.00	14,168,000	
たけびし	5,800	1,445.00	8,381,000	
リックス	3,500	1,584.00	5,544,000	貸付有価証券 100株
丸文	13,800	677.00	9,342,600	
ハピネット	13,000	1,512.00	19,656,000	
橋本総業ホールディングス	3,100	1,979.00	6,134,900	
日本ライフライン	47,700	1,051.00	50,132,700	貸付有価証券 200株
タカショー	12,300	701.00	8,622,300	貸付有価証券 4,300株
I D O M	48,900	664.00	32,469,600	
進和	9,500	2,003.00	19,028,500	
エスケイジャパン	3,900	432.00	1,684,800	貸付有価証券 1,200株
ダイトロン	6,600	2,006.00	13,239,600	
シークス	22,200	996.00	22,111,200	
田中商事	4,900	601.00	2,944,900	
オーハシテクニカ	8,400	1,268.00	10,651,200	
白銅	5,200	2,426.00	12,615,200	
ダイコー通産	1,900	1,283.00	2,437,700	
伊藤忠商事	1,073,700	3,693.00	3,965,174,100	貸付有価証券 500株
丸紅	1,531,000	1,285.00	1,967,335,000	
高島	2,300	2,286.00	5,257,800	
長瀬産業	81,900	1,881.00	154,053,900	
蝶理	9,000	1,907.00	17,163,000	
豊田通商	155,900	4,395.00	685,180,500	
三共生興	20,600	537.00	11,062,200	
兼松	58,700	1,352.00	79,362,400	
ツカモトコーポレーション	2,700	1,213.00	3,275,100	
三井物産	1,223,900	3,148.00	3,852,837,200	
日本紙パルプ商事	8,100	3,810.00	30,861,000	
カメイ	18,500	1,044.00	19,314,000	
東都水産	800	4,465.00	3,572,000	貸付有価証券 400株
O U Gホールディングス	2,300	2,651.00	6,097,300	

スターゼン	11,600	1,950.00	22,620,000	
山善	64,600	956.00	61,757,600	
椿本興業	3,100	3,675.00	11,392,500	
住友商事	996,100	1,868.00	1,860,714,800	貸付有価証券 5,200株
内田洋行	6,700	4,805.00	32,193,500	
三菱商事	1,157,500	4,127.00	4,777,002,500	貸付有価証券 2,000株
第一実業	6,900	3,645.00	25,150,500	
キャノンマーケティング ジャパン	40,000	3,045.00	121,800,000	
西華産業	7,700	1,570.00	12,089,000	
佐藤商事	12,600	1,146.00	14,439,600	
菱洋エレクトロ	9,500	2,098.00	19,931,000	貸付有価証券 3,100株
東京産業	14,100	697.00	9,827,700	
ユアサ商事	14,500	2,840.00	41,180,000	
神鋼商事	3,600	3,615.00	13,014,000	
トルク	8,500	200.00	1,700,000	
阪和興業	30,800	3,105.00	95,634,000	貸付有価証券 100株
正栄食品工業	10,400	3,950.00	41,080,000	貸付有価証券 4,600株
カナデン	13,100	924.00	12,104,400	
菱電商事	12,800	1,680.00	21,504,000	
岩谷産業	37,700	5,120.00	193,024,000	
ナイス	5,300	1,886.00	9,995,800	
ニチモウ	2,200	2,574.00	5,662,800	
極東貿易	4,600	2,190.00	10,074,000	
アステナホールディング ス	22,000	437.00	9,614,000	
三愛オブリ	38,500	947.00	36,459,500	
稲畑産業	34,000	2,087.00	70,958,000	貸付有価証券 100株
G S Iクレオス	7,700	1,214.00	9,347,800	貸付有価証券 3,300株
明和産業	14,900	720.00	10,728,000	貸付有価証券 7,000株（300株）
クワザワホールディング	6,200	492.00	3,050,400	

ス				
ワキタ	32,600	1,076.00	35,077,600	
東邦ホールディングス	49,000	2,152.00	105,448,000	貸付有価証券 9,300株
サンゲツ	41,100	1,567.00	64,403,700	
ミツウロコグループホールディングス	21,600	983.00	21,232,800	
シナネンホールディングス	5,700	3,205.00	18,268,500	
伊藤忠エネクス	35,600	1,079.00	38,412,400	
サンリオ	48,300	2,544.00	122,875,200	
サンワテクノス	9,200	1,340.00	12,328,000	
リョーサン	17,400	2,369.00	41,220,600	
新光商事	23,200	938.00	21,761,600	
トーヨー	6,900	1,111.00	7,665,900	
三信電気	7,100	1,510.00	10,721,000	
東陽テクニカ	15,900	1,044.00	16,599,600	
モスフードサービス	21,100	3,015.00	63,616,500	貸付有価証券 100株（100株）
加賀電子	14,100	3,115.00	43,921,500	
ソーダニッカ	15,000	638.00	9,570,000	
立花エレテック	11,800	1,624.00	19,163,200	
フォーバル	6,600	805.00	5,313,000	
PALTA C	22,600	4,695.00	106,107,000	
三谷産業	25,100	314.00	7,881,400	
太平洋興発	5,900	624.00	3,681,600	
西本Wismettac ホールディングス	3,600	2,562.00	9,223,200	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,400	2,041.00	2,857,400	貸付有価証券 600株
コア商事ホールディングス	10,100	848.00	8,564,800	貸付有価証券 500株（400株）
国際紙パルプ商事	32,300	295.00	9,528,500	
ヤマタネ	7,300	1,659.00	12,110,700	
丸紅建材リース	1,400	1,750.00	2,450,000	
日鉄物産	10,900	5,150.00	56,135,000	
泉州電業	4,300	4,820.00	20,726,000	貸付有価証券 1,200株
トラスコ中山	33,500	1,950.00	65,325,000	



オートバックスセブン	52,800	1,400.00	73,920,000	
モリト	11,700	754.00	8,821,800	貸付有価証券 100株
加藤産業	21,300	3,330.00	70,929,000	
北恵	4,100	886.00	3,632,600	貸付有価証券 1,700株
イノテック	9,700	1,358.00	13,172,600	
イエローハット	27,100	1,667.00	45,175,700	
J Kホールディングス	12,400	1,022.00	12,672,800	
日伝	12,600	2,137.00	26,926,200	
北沢産業	10,100	221.00	2,232,100	貸付有価証券 100株
杉本商事	7,500	2,131.00	15,982,500	
因幡電機産業	42,000	2,580.00	108,360,000	
東テク	5,200	2,605.00	13,546,000	
ミスミグループ本社	202,300	2,847.00	575,948,100	
アルテック	10,500	248.00	2,604,000	
タキヒヨー	4,700	1,043.00	4,902,100	貸付有価証券 1,000株
蔵王産業	3,100	1,939.00	6,010,900	
スズケン	61,300	3,920.00	240,296,000	貸付有価証券 500株
ジェコス	11,100	791.00	8,780,100	
グローセル	18,400	408.00	7,507,200	貸付有価証券 1,100株
ローソン	35,700	4,965.00	177,250,500	貸付有価証券 4,000株
サンエー	11,800	4,095.00	48,321,000	
カワチ薬品	12,500	2,067.00	25,837,500	
エービーシー・マート	25,200	5,480.00	138,096,000	
ハードオフコーポレーション	7,100	816.00	5,793,600	
アスクル	36,500	1,518.00	55,407,000	貸付有価証券 2,700株
ゲオホールディングス	20,800	1,283.00	26,686,400	
アダストリア	17,400	2,217.00	38,575,800	貸付有価証券 100株
ジーフット	9,700	314.00	3,045,800	貸付有価証券 4,400株

シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,300	392.00	901,600	
くら寿司	16,800	3,090.00	51,912,000	貸付有価証券 1,700株（1,400株）
キャンドウ	6,000	2,355.00	14,130,000	貸付有価証券 3,300株（1,000株）
アイケイ	5,100	552.00	2,815,200	貸付有価証券 1,800株（300株）
パルグループホールディ ングス	14,100	1,504.00	21,206,400	
エディオン	74,000	1,222.00	90,428,000	貸付有価証券 28,700株（9,700株）
サーラコーポレーション	32,700	621.00	20,306,700	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
ワッツ	7,800	720.00	5,616,000	貸付有価証券 3,200株
ハローズ	7,300	3,140.00	22,922,000	
フジオフードグループ本 社	13,000	1,316.00	17,108,000	貸付有価証券 5,800株
あみやき亭	3,800	2,905.00	11,039,000	
ひらまつ	34,200	187.00	6,395,400	
大黒天物産	5,100	4,865.00	24,811,500	貸付有価証券 2,100株（900株）
ハニーズホールディン グス	13,700	1,087.00	14,891,900	貸付有価証券 6,300株
ファーマライズホール ディングス	3,800	724.00	2,751,200	貸付有価証券 1,700株
アルペン	12,000	1,932.00	23,184,000	貸付有価証券 5,200株
ハブ	5,200	482.00	2,506,400	貸付有価証券 2,100株（1,100株）
クオールホールディン グス	19,800	1,080.00	21,384,000	
ジンズホールディングス	10,200	4,210.00	42,942,000	
ビックカメラ	95,600	1,128.00	107,836,800	貸付有価証券 34,300株
D C Mホールディングス	99,400	1,097.00	109,041,800	
M o n o t a R O	203,800	2,019.00	411,472,200	貸付有価証券 26,200株
東京一番フーズ	3,900	595.00	2,320,500	
D Dホールディングス	8,400	520.00	4,368,000	貸付有価証券

				100株(100株)
きちりホールディングス	4,300	369.00	1,586,700	貸付有価証券 1,900株
アークランドサービス ホールディングス	11,800	2,054.00	24,237,200	貸付有価証券 4,900株
J・フロント リテイリ ング	187,900	990.00	186,021,000	
ドトール・日レスホール ディングス	27,000	1,506.00	40,662,000	
マツキヨココカラ&カン パニー	97,600	4,260.00	415,776,000	
ブロンコビリー	8,900	2,282.00	20,309,800	貸付有価証券 3,900株
Z O Z O	110,800	2,684.00	297,387,200	
トレジャー・ファクト リー	4,700	958.00	4,502,600	
物語コーポレーション	8,000	5,160.00	41,280,000	貸付有価証券 3,600株
三越伊勢丹ホールディ ングス	268,800	978.00	262,886,400	
H a m e e	5,800	1,050.00	6,090,000	貸付有価証券 2,700株
マーケットエンタープラ イズ	1,600	737.00	1,179,200	貸付有価証券 500株(400株)
ウエルシアホールディ ングス	85,200	2,594.00	221,008,800	貸付有価証券 300株
クリエイトSDホール ディングス	23,800	2,940.00	69,972,000	貸付有価証券 11,100株
丸善CHIホールディ ングス	18,800	378.00	7,106,400	貸付有価証券 8,100株
ミサワ	3,300	608.00	2,006,400	貸付有価証券 1,500株
ティーライフ	2,200	1,413.00	3,108,600	
エー・ピーホールディ ングス	3,100	448.00	1,388,800	
チムニー	4,900	1,135.00	5,561,500	貸付有価証券 2,100株
シュッピン	13,400	1,093.00	14,646,200	貸付有価証券 1,000株(800株)
オイシックス・ラ・大地	23,200	2,467.00	57,234,400	貸付有価証券 7,300株
ネクステージ	32,700	1,915.00	62,620,500	

ジョイフル本田	48,400	1,588.00	76,859,200	貸付有価証券 19,300株
鳥貴族ホールディングス	5,700	1,726.00	9,838,200	
ホットランド	12,000	1,360.00	16,320,000	貸付有価証券 5,200株（900株）
すかいらーくホールディングス	204,200	1,524.00	311,200,800	貸付有価証券 95,400株（2,600株）
S F Pホールディングス	7,900	1,379.00	10,894,100	貸付有価証券 3,500株（200株）
綿半ホールディングス	11,800	1,321.00	15,587,800	
ヨシックスホールディングス	3,100	2,002.00	6,206,200	貸付有価証券 1,400株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	46,800	1,092.00	51,105,600	貸付有価証券 400株
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,400	945.00	7,938,000	貸付有価証券 3,800株（100株）
B E E N O S	8,100	1,375.00	11,137,500	貸付有価証券 3,800株
あさひ	13,300	1,330.00	17,689,000	貸付有価証券 6,000株
日本調剤	9,800	1,191.00	11,671,800	
コスモス薬品	16,300	11,870.00	193,481,000	貸付有価証券 7,600株
トーエル	7,600	825.00	6,270,000	貸付有価証券 3,300株
セブン & アイ・ホールディングス	600,500	5,705.00	3,425,852,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	93,200	805.00	75,026,000	貸付有価証券 13,700株
ツルハホールディングス	35,200	6,730.00	236,896,000	貸付有価証券 700株
サンマルクホールディングス	12,700	1,492.00	18,948,400	
フェリシモ	3,600	1,184.00	4,262,400	貸付有価証券 200株（200株）
トリドールホールディングス	40,100	2,239.00	89,783,900	貸付有価証券 1,700株
T O K Y O B A S E	14,800	310.00	4,588,000	貸付有価証券 3,000株（900株）
ウイルプラスホールディングス	3,000	921.00	2,763,000	
J Mホールディングス	11,300	1,628.00	18,396,400	

サツドラホールディングス	7,200	659.00	4,744,800	貸付有価証券 3,300株
アレザホールディングス	11,800	989.00	11,670,200	
串カツ田中ホールディングス	4,300	1,657.00	7,125,100	貸付有価証券 100株
パロックジャパンリミテッド	11,200	783.00	8,769,600	貸付有価証券 3,900株
クスリのアオキホールディングス	15,500	5,420.00	84,010,000	
力の源ホールディングス	8,200	579.00	4,747,800	貸付有価証券 3,600株(100株)
FOOD & LIFE COMPANIE	90,400	3,180.00	287,472,000	貸付有価証券 300株
メディカルシステムネットワーク	15,100	432.00	6,523,200	
一家ホールディングス	3,400	532.00	1,808,800	
藤久ホールディングス	5,000	687.00	3,435,000	貸付有価証券 300株
はるやまホールディングス	7,500	453.00	3,397,500	
ノジマ	26,100	2,936.00	76,629,600	
カッパ・クリエイト	22,600	1,327.00	29,990,200	貸付有価証券 1,000株(200株)
ライトオン	12,000	701.00	8,412,000	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
良品計画	185,400	1,264.00	234,345,600	
パリミキホールディングス	19,900	262.00	5,213,800	
アドヴァングループ	15,500	779.00	12,074,500	
アルビス	5,000	2,229.00	11,145,000	
コナカ	18,500	332.00	6,142,000	
ハウス オブ ローゼ	2,000	1,662.00	3,324,000	
G-7ホールディングス	17,900	1,556.00	27,852,400	
イオン北海道	26,000	1,023.00	26,598,000	貸付有価証券 200株
コジマ	27,700	609.00	16,869,300	貸付有価証券 12,200株
ヒマラヤ	5,400	915.00	4,941,000	貸付有価証券 400株
コーナン商事	22,900	3,700.00	84,730,000	

エコス	5,700	2,000.00	11,400,000	
ワタミ	19,500	895.00	17,452,500	
マルシェ	5,200	462.00	2,402,400	貸付有価証券 1,700株
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	322,300	2,002.00	645,244,600	貸付有価証券 2,500株
西松屋チェーン	34,200	1,553.00	53,112,600	貸付有価証券 16,100株
ゼンショーホールディン グス	78,700	2,938.00	231,220,600	貸付有価証券 3,000株
幸楽苑ホールディングス	9,900	1,246.00	12,335,400	貸付有価証券 1,900株
ハークスレイ	6,700	458.00	3,068,600	
サイゼリヤ	23,900	2,310.00	55,209,000	
V Tホールディングス	60,700	457.00	27,739,900	貸付有価証券 400株
魚力	4,500	2,189.00	9,850,500	貸付有価証券 2,100株
ポブラ	4,000	137.00	548,000	
フジ・コーポレーション	8,500	1,130.00	9,605,000	貸付有価証券 2,600株
ユナイテッドアローズ	16,900	1,843.00	31,146,700	
ハイデイ日高	23,300	1,904.00	44,363,200	貸付有価証券 11,100株
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i	9,400	204.00	1,917,600	貸付有価証券 100株（100株）
コロワイド	66,200	1,615.00	106,913,000	貸付有価証券 31,100株（9,100株）
ピーシーデポコーポレー ション	18,700	313.00	5,853,100	貸付有価証券 600株
壱番屋	11,400	4,870.00	55,518,000	貸付有価証券 700株
トップカルチャー	5,800	279.00	1,618,200	
P L A N T	4,000	671.00	2,684,000	
スギホールディングス	32,200	5,280.00	170,016,000	
薬王堂ホールディングス	8,000	1,875.00	15,000,000	貸付有価証券 600株（600株）
スクロール	24,800	844.00	20,931,200	貸付有価証券 2,200株
ヨンドシーホールディン グス	14,400	1,716.00	24,710,400	

木曽路	21,800	2,079.00	45,322,200	貸付有価証券 8,800株
S R S ホールディングス	22,800	813.00	18,536,400	貸付有価証券 2,600株(900株)
千趣会	29,100	393.00	11,436,300	貸付有価証券 13,000株
タカキュー	12,000	104.00	1,248,000	貸付有価証券 5,400株
リテールパートナーズ	24,500	1,145.00	28,052,500	
ケーヨー	29,800	958.00	28,548,400	
上新電機	17,500	1,902.00	33,285,000	
日本瓦斯	78,300	1,881.00	147,282,300	
ロイヤルホールディングス	28,200	2,029.00	57,217,800	貸付有価証券 11,700株
東天紅	1,200	921.00	1,105,200	
いなげや	18,600	1,324.00	24,626,400	
チヨダ	15,000	706.00	10,590,000	貸付有価証券 6,700株(100株)
ライフコーポレーション	14,200	2,866.00	40,697,200	
リンガーハット	19,400	2,191.00	42,505,400	貸付有価証券 7,700株
Mr Max HD	20,100	607.00	12,200,700	貸付有価証券 100株
テンアライド	15,600	309.00	4,820,400	貸付有価証券 6,300株
A O K I ホールディングス	31,200	626.00	19,531,200	貸付有価証券 100株
オークワ	24,500	883.00	21,633,500	貸付有価証券 100株
コメリ	24,900	2,826.00	70,367,400	
青山商事	32,400	705.00	22,842,000	貸付有価証券 3,700株
しまむら	18,800	11,660.00	219,208,000	
はせがわ	8,500	265.00	2,252,500	
高島屋	114,400	1,218.00	139,339,200	
松屋	30,700	776.00	23,823,200	
エイチ・ツー・オー テイリング	74,200	873.00	64,776,600	
近鉄百貨店	5,700	2,521.00	14,369,700	
丸井グループ	123,700	2,234.00	276,345,800	

アクシアル リテイリング	11,900	3,065.00	36,473,500	
井筒屋	7,600	300.00	2,280,000	貸付有価証券 3,400株（900株）
イオン	590,700	2,387.00	1,410,000,900	
イズミ	27,900	2,816.00	78,566,400	
平和堂	28,800	1,957.00	56,361,600	貸付有価証券 12,700株
フジ	41,200	2,369.00	97,602,800	貸付有価証券 1,400株（600株）
ヤオコー	18,300	6,860.00	125,538,000	
ゼビオホールディングス	21,900	924.00	20,235,600	貸付有価証券 100株
ケーズホールディングス	144,800	1,384.00	200,403,200	
Olympicグループ	7,900	644.00	5,087,600	
日産東京販売ホールディングス	23,700	220.00	5,214,000	
シルバーライフ	3,300	1,351.00	4,458,300	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
Genky Drug Stores	7,100	3,145.00	22,329,500	貸付有価証券 600株
ナルミヤ・インターナショナル	3,600	846.00	3,045,600	貸付有価証券 700株
ブックオフグループホールディングス	9,400	1,019.00	9,578,600	貸付有価証券 4,400株（500株）
ギフトホールディングス	2,500	2,061.00	5,152,500	
アインホールディングス	21,000	5,610.00	117,810,000	貸付有価証券 4,300株
元気寿司	4,500	2,452.00	11,034,000	
ヤマダホールディングス	603,040	480.00	289,459,200	貸付有価証券 200株
アークランドサカモト	25,200	1,563.00	39,387,600	
ニトリホールディングス	64,000	12,705.00	813,120,000	
グルメ杵屋	12,800	1,000.00	12,800,000	貸付有価証券 4,800株
愛眼	11,800	197.00	2,324,600	
ケーユーホールディングス	8,400	1,064.00	8,937,600	
吉野家ホールディングス	56,300	2,375.00	133,712,500	貸付有価証券 3,400株（2,400株）
松屋フーズホールディング	7,700	3,745.00	28,836,500	貸付有価証券



グス				100株
サガミホールディングス	24,100	1,111.00	26,775,100	貸付有価証券 10,400株
関西フードマーケット	15,100	1,319.00	19,916,900	貸付有価証券 100株
王将フードサービス	10,600	6,110.00	64,766,000	
プレナス	18,000	1,940.00	34,920,000	貸付有価証券 600株(600株)
ミニストップ	11,900	1,383.00	16,457,700	貸付有価証券 200株(200株)
アークス	30,000	2,078.00	62,340,000	
パローホールディングス	34,700	1,995.00	69,226,500	
ベルク	7,200	5,440.00	39,168,000	
大庄	8,600	1,025.00	8,815,000	貸付有価証券 2,300株
ファーストリテイリング	21,600	58,020.00	1,253,232,000	貸付有価証券 400株
サンドラッグ	60,600	2,955.00	179,073,000	貸付有価証券 2,100株
サックスパーホールディングス	15,200	516.00	7,843,200	貸付有価証券 1,400株(700株)
ヤマザワ	3,600	1,500.00	5,400,000	
やまや	3,300	2,480.00	8,184,000	貸付有価証券 700株
ベルーナ	34,600	711.00	24,600,600	貸付有価証券 200株
島根銀行	5,100	521.00	2,657,100	
じもとホールディングス	11,200	620.00	6,944,000	
めぶきフィナンシャルグループ	737,800	267.00	196,992,600	貸付有価証券 2,100株
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,700	1,741.00	34,297,700	
九州フィナンシャルグループ	313,900	402.00	126,187,800	貸付有価証券 200株
ゆうちょ銀行	381,000	981.00	373,761,000	貸付有価証券 179,000株
富山第一銀行	37,600	327.00	12,295,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	880,900	478.00	421,070,200	貸付有価証券 100株
西日本フィナンシャルホールディングス	95,000	783.00	74,385,000	貸付有価証券 2,400株

三十三フィナンシャルグループ	14,300	1,427.00	20,406,100	
第四北越フィナンシャルグループ	25,100	2,507.00	62,925,700	
ひろぎんホールディングス	227,500	633.00	144,007,500	貸付有価証券 100株
おきなわフィナンシャルグループ	14,300	2,215.00	31,674,500	貸付有価証券 4,000株
十六フィナンシャルグループ	20,700	2,229.00	46,140,300	
北國フィナンシャルホールディングス	14,600	4,345.00	63,437,000	
プロクレアホールディングス	17,000	1,828.00	31,076,000	
新生銀行	105,300	2,217.00	233,450,100	貸付有価証券 900株
あおぞら銀行	90,100	2,636.00	237,503,600	貸付有価証券 100株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,897,900	750.20	7,425,404,580	
りそなホールディングス	1,789,200	545.90	976,724,280	
三井住友トラスト・ホールディングス	292,400	4,097.00	1,197,962,800	
三井住友フィナンシャルグループ	1,094,000	3,922.00	4,290,668,000	
千葉銀行	511,000	748.00	382,228,000	
群馬銀行	288,500	373.00	107,610,500	
武蔵野銀行	22,900	1,780.00	40,762,000	
千葉興業銀行	36,900	269.00	9,926,100	貸付有価証券 100株
筑波銀行	62,900	199.00	12,517,100	
七十七銀行	48,000	1,668.00	80,064,000	
秋田銀行	10,100	1,664.00	16,806,400	
山形銀行	16,500	882.00	14,553,000	貸付有価証券 200株
岩手銀行	10,300	1,908.00	19,652,400	
東邦銀行	128,300	205.00	26,301,500	貸付有価証券 600株
東北銀行	7,600	990.00	7,524,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	129,500	2,349.00	304,195,500	

静岡銀行	372,900	854.00	318,456,600	
スルガ銀行	141,500	415.00	58,722,500	貸付有価証券 100株
八十二銀行	346,200	455.00	157,521,000	
山梨中央銀行	17,100	993.00	16,980,300	
大垣共立銀行	30,500	1,912.00	58,316,000	
福井銀行	13,500	1,354.00	18,279,000	
清水銀行	6,400	1,506.00	9,638,400	
富山銀行	2,800	1,893.00	5,300,400	
滋賀銀行	29,000	2,494.00	72,326,000	
南都銀行	24,100	2,037.00	49,091,700	
百五銀行	148,500	340.00	50,490,000	貸付有価証券 900株
京都銀行	55,200	5,640.00	311,328,000	
紀陽銀行	52,400	1,422.00	74,512,800	
ほくほくフィナンシャル グループ	96,000	888.00	85,248,000	
山陰合同銀行	93,700	660.00	61,842,000	
中国銀行	125,700	964.00	121,174,800	貸付有価証券 200株
鳥取銀行	5,100	1,187.00	6,053,700	
伊予銀行	202,900	632.00	128,232,800	貸付有価証券 100株
百十四銀行	16,400	1,714.00	28,109,600	
四国銀行	23,400	802.00	18,766,800	貸付有価証券 100株
阿波銀行	23,600	2,152.00	50,787,200	
大分銀行	9,100	1,873.00	17,044,300	
宮崎銀行	9,600	2,070.00	19,872,000	
佐賀銀行	8,900	1,462.00	13,011,800	
琉球銀行	35,000	817.00	28,595,000	
セブン銀行	479,300	249.00	119,345,700	貸付有価証券 64,500株
みずほフィナンシャルグ ループ	2,021,300	1,585.00	3,203,760,500	
高知銀行	5,600	745.00	4,172,000	
山口フィナンシャルグ ループ	179,100	730.00	130,743,000	
長野銀行	5,200	1,311.00	6,817,200	

名古屋銀行	11,100	3,065.00	34,021,500	
北洋銀行	229,800	241.00	55,381,800	貸付有価証券 600株
愛知銀行	5,600	4,740.00	26,544,000	
中京銀行	5,500	1,684.00	9,262,000	
大光銀行	5,300	1,269.00	6,725,700	
愛媛銀行	22,000	935.00	20,570,000	貸付有価証券 100株
トマト銀行	5,500	1,021.00	5,615,500	
京葉銀行	67,300	493.00	33,178,900	
栃木銀行	76,100	249.00	18,948,900	
北日本銀行	4,900	1,562.00	7,653,800	
東和銀行	27,700	536.00	14,847,200	
福島銀行	18,000	216.00	3,888,000	貸付有価証券 300株
大東銀行	7,500	653.00	4,897,500	
トモニホールディングス	122,000	326.00	39,772,000	
フィデアホールディングス	14,700	1,288.00	18,933,600	貸付有価証券 100株
池田泉州ホールディングス	180,900	187.00	33,828,300	貸付有価証券 1,300株
F P G	54,300	801.00	43,494,300	貸付有価証券 900株
ジャパンインベストメントアドバイザー	12,500	1,137.00	14,212,500	貸付有価証券 4,000株
マーキュリアホールディングス	7,200	583.00	4,197,600	
S B I ホールディングス	199,300	2,859.00	569,798,700	貸付有価証券 5,200株
日本アジア投資	12,700	233.00	2,959,100	
ジャフコ グループ	61,700	1,537.00	94,832,900	貸付有価証券 100株
大和証券グループ本社	1,180,100	624.60	737,090,460	貸付有価証券 6,000株
野村ホールディングス	2,464,200	484.00	1,192,672,800	
岡三証券グループ	123,400	358.00	44,177,200	貸付有価証券 200株
丸三証券	47,900	511.00	24,476,900	貸付有価証券 3,000株
東洋証券	51,800	179.00	9,272,200	貸付有価証券

				1,400株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	176,500	386.00	68,129,000	貸付有価証券 400株
光世証券	3,400	465.00	1,581,000	
水戸証券	41,900	259.00	10,852,100	
いちよし証券	29,500	568.00	16,756,000	貸付有価証券 200株
松井証券	79,000	824.00	65,096,000	
マネックスグループ	133,000	533.00	70,889,000	貸付有価証券 45,900株(14,000株)
極東証券	20,500	699.00	14,329,500	
岩井コスモホールディングス	15,200	1,261.00	19,167,200	
アイザワ証券グループ	25,000	649.00	16,225,000	
マネーパートナーズグループ	17,200	238.00	4,093,600	
スパークス・グループ	74,500	248.00	18,476,000	
小林洋行	5,700	225.00	1,282,500	
かんぽ生命保険	162,500	2,147.00	348,887,500	
SOMPOホールディングス	253,200	5,229.00	1,323,982,800	
アニコムホールディングス	49,600	628.00	31,148,800	貸付有価証券 100株
MS&ADインシュアランスグループホール	351,900	3,928.00	1,382,263,200	
第一生命ホールディングス	751,000	2,597.00	1,950,347,000	貸付有価証券 800株
東京海上ホールディングス	495,200	6,921.00	3,427,279,200	
T&Dホールディングス	399,000	1,676.00	668,724,000	
アドバンスクリエイト	7,700	930.00	7,161,000	貸付有価証券 3,500株
全国保証	38,500	4,545.00	174,982,500	貸付有価証券 14,300株
あんしん保証	6,400	292.00	1,868,800	貸付有価証券 400株
ジェイリース	5,400	1,474.00	7,959,600	貸付有価証券 2,500株(1,900株)
イントラスト	6,800	519.00	3,529,200	
日本モーゲージサービス	9,000	964.00	8,676,000	貸付有価証券 100株

C a s a	5,700	803.00	4,577,100	貸付有価証券 2,100株（200株）
アルヒ	23,800	996.00	23,704,800	貸付有価証券 11,000株（9,300株）
プレミアグループ	8,200	3,710.00	30,422,000	貸付有価証券 400株（400株）
ネットプロテクションズ ホールディングス	49,000	602.00	29,498,000	貸付有価証券 20,600株（13,700株）
クレディセゾン	100,500	1,551.00	155,875,500	貸付有価証券 1,800株
芙蓉総合リース	15,900	7,260.00	115,434,000	
みずほリース	23,200	3,015.00	69,948,000	
東京センチュリー	29,200	4,215.00	123,078,000	貸付有価証券 500株
日本証券金融	63,400	950.00	60,230,000	
アイフル	270,800	379.00	102,633,200	
リコーリース	14,300	3,440.00	49,192,000	貸付有価証券 100株
イオンフィナンシャル サービス	87,800	1,204.00	105,711,200	貸付有価証券 200株
アコム	318,400	345.00	109,848,000	
ジャックス	17,200	3,280.00	56,416,000	
オリエントコーポレー ション	436,600	128.00	55,884,800	貸付有価証券 5,300株
オリックス	958,900	2,304.00	2,209,305,600	
三菱H C キャピタル	571,500	585.00	334,327,500	貸付有価証券 11,900株
九州リースサービス	7,600	579.00	4,400,400	貸付有価証券 1,900株
日本取引所グループ	393,900	1,906.50	750,970,350	貸付有価証券 2,600株
イー・ギャランティ	23,800	2,034.00	48,409,200	
アサックス	8,400	582.00	4,888,800	貸付有価証券 4,500株
NEC キャピタルソ リューション	6,600	1,966.00	12,975,600	貸付有価証券 800株
いちご	179,700	277.00	49,776,900	貸付有価証券 44,400株
日本駐車場開発	171,100	157.00	26,862,700	
スター・マイカ・ホール ディングス	8,700	1,443.00	12,554,100	

S R E ホールディングス	4,000	2,318.00	9,272,000	貸付有価証券 400株(400株)
A D ワークスグループ	31,900	149.00	4,753,100	貸付有価証券 14,000株
ヒューリック	374,100	1,040.00	389,064,000	貸付有価証券 56,200株
三栄建築設計	6,500	1,646.00	10,699,000	
野村不動産ホールディングス	83,500	3,120.00	260,520,000	
三重交通グループホールディングス	32,700	466.00	15,238,200	貸付有価証券 13,700株
サムティ	25,200	2,053.00	51,735,600	貸付有価証券 9,600株
ディア・ライフ	20,500	518.00	10,619,000	
コーセーアールイー	4,700	640.00	3,008,000	貸付有価証券 1,000株(400株)
地主	10,200	1,937.00	19,757,400	貸付有価証券 4,300株
プレサンスコーポレーション	19,900	1,487.00	29,591,300	
ハウスコム	2,800	1,130.00	3,164,000	
日本管理センター	7,700	988.00	7,607,600	
サンセイランディック	4,700	811.00	3,811,700	貸付有価証券 700株(700株)
エストラスト	1,900	551.00	1,046,900	
フージャースホールディングス	20,600	646.00	13,307,600	
オープンハウスグループ	51,300	4,745.00	243,418,500	貸付有価証券 100株
東急不動産ホールディングス	463,300	649.00	300,681,700	
飯田グループホールディングス	134,600	2,111.00	284,140,600	
イーランド	2,500	1,341.00	3,352,500	
ムゲンエステート	9,900	502.00	4,969,800	貸付有価証券 600株(600株)
ビーロット	11,000	492.00	5,412,000	
ファーストブラザーズ	3,700	820.00	3,034,000	貸付有価証券 1,700株(100株)
A n d D o ホールディングス	7,900	909.00	7,181,100	貸付有価証券 600株(600株)

シーアールイー	5,000	1,489.00	7,445,000	貸付有価証券 1,400株
プロパティエージェント	1,900	1,530.00	2,907,000	貸付有価証券 1,100株
ケイアイスター不動産	7,300	5,320.00	38,836,000	
アグレ都市デザイン	2,600	1,573.00	4,089,800	
グッドコムアセット	7,000	1,093.00	7,651,000	
ジェイ・エス・ビー	3,300	3,450.00	11,385,000	
ロードスターキャピタル	4,100	1,416.00	5,805,600	
テンポイノベーション	4,500	808.00	3,636,000	貸付有価証券 100株
グローバル・リンク・マ ネジメント	2,800	928.00	2,598,400	
フェイスネットワーク	2,000	1,328.00	2,656,000	
パーク24	95,600	1,816.00	173,609,600	貸付有価証券 21,400株（4,100株）
パラカ	4,400	1,735.00	7,634,000	貸付有価証券 1,700株
三井不動産	698,700	2,683.50	1,874,961,450	
三菱地所	1,013,300	1,823.50	1,847,752,550	貸付有価証券 200株
平和不動産	27,000	3,850.00	103,950,000	
東京建物	152,300	1,780.00	271,094,000	
京阪神ビルディング	23,600	1,328.00	31,340,800	
住友不動産	322,500	3,335.00	1,075,537,500	
テーオーシー	27,400	673.00	18,440,200	貸付有価証券 900株
東京楽天地	2,500	3,955.00	9,887,500	
レオパレス21	167,300	190.00	31,787,000	
スターツコーポレーショ ン	21,900	2,316.00	50,720,400	
フジ住宅	18,700	620.00	11,594,000	
空港施設	16,100	548.00	8,822,800	
明和地所	7,600	594.00	4,514,400	
ゴールドクレスト	12,700	1,661.00	21,094,700	
エスリード	6,300	1,665.00	10,489,500	
日神グループホールディ ングス	26,200	446.00	11,685,200	
日本エスコン	30,100	738.00	22,213,800	



タカラレーベン	67,600	292.00	19,739,200	
A V A N T I A	8,100	840.00	6,804,000	貸付有価証券 300株
イオンモール	80,900	1,561.00	126,284,900	
毎日コムネット	5,500	700.00	3,850,000	貸付有価証券 2,500株
ファースト住建	6,000	1,104.00	6,624,000	貸付有価証券 300株
カチタス	40,000	2,889.00	115,560,000	貸付有価証券 400株
トーセイ	22,300	1,114.00	24,842,200	
穴吹興産	3,500	2,222.00	7,777,000	
サンフロンティア不動産	22,300	1,061.00	23,660,300	
F J ネクストホールディングス	15,800	1,016.00	16,052,800	
インテリックス	3,600	637.00	2,293,200	貸付有価証券 700株
ランドビジネス	6,400	236.00	1,510,400	
サンネクスタグループ	5,100	1,119.00	5,706,900	
グランディハウス	11,000	521.00	5,731,000	
日本空港ビルデング	58,400	5,180.00	302,512,000	
明豊ファシリティワークス	7,100	680.00	4,828,000	
日本工営	9,900	2,908.00	28,789,200	
L I F U L L	47,700	215.00	10,255,500	貸付有価証券 4,000株
ミクシィ	35,800	2,253.00	80,657,400	
ジェイエイシーリクルートメント	12,600	1,744.00	21,974,400	
日本M&Aセンターホールディングス	256,500	1,400.00	359,100,000	貸付有価証券 200株
メンバーズ	4,500	2,873.00	12,928,500	
中広	2,500	379.00	947,500	
U T グループ	22,600	2,585.00	58,421,000	
アイティメディア	7,400	1,660.00	12,284,000	
E・Jホールディングス	9,000	1,139.00	10,251,000	貸付有価証券 3,700株
夢真ビーネックスグループ	51,000	1,347.00	68,697,000	貸付有価証券 200株
コシダカホールディング	41,800	716.00	29,928,800	貸付有価証券

ス				9,400株
アルトナー	3,800	833.00	3,165,400	
パソナグループ	16,900	1,930.00	32,617,000	
C D S	3,900	1,790.00	6,981,000	
リンクアンドモチベーション	34,500	435.00	15,007,500	貸付有価証券 15,900株(5,500株)
エス・エム・エス	53,100	2,936.00	155,901,600	
サニーサイドアップグループ	5,400	780.00	4,212,000	貸付有価証券 300株(300株)
パーソルホールディングス	156,300	2,315.00	361,834,500	
リニカル	8,800	791.00	6,960,800	
クックパッド	49,100	249.00	12,225,900	貸付有価証券 100株
エスクリ	7,000	411.00	2,877,000	貸付有価証券 3,200株
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,600	566.00	4,301,600	貸付有価証券 100株
学情	6,300	921.00	5,802,300	貸付有価証券 2,700株
スタジオアリス	7,000	2,207.00	15,449,000	貸付有価証券 4,100株
シミックホールディングス	8,300	1,457.00	12,093,100	
エプロ	3,300	687.00	2,267,100	
N J S	3,400	2,023.00	6,878,200	
総合警備保障	60,500	3,705.00	224,152,500	貸付有価証券 500株
カカクコム	114,700	2,625.00	301,087,500	
セントケア・ホールディング	10,200	781.00	7,966,200	
サイネックス	2,600	591.00	1,536,600	
ルネサンス	10,900	855.00	9,319,500	貸付有価証券 1,200株(600株)
ディップ	27,500	3,940.00	108,350,000	
デジタルホールディングス	10,900	1,401.00	15,270,900	
新日本科学	19,000	1,335.00	25,365,000	
キャリアデザインセンター	3,700	1,032.00	3,818,400	
ベネフィット・ワン	56,900	1,878.00	106,858,200	

				貸付有価証券 17,500株(1,100株)
エムスリー	275,900	3,836.00	1,058,352,400	貸付有価証券 100株
ツカダ・グローバルホールディング	9,900	305.00	3,019,500	
プラス	2,000	703.00	1,406,000	
アウトソーシング	89,600	1,169.00	104,742,400	貸付有価証券 19,900株(19,900株)
ウェルネット	15,100	445.00	6,719,500	貸付有価証券 900株
ワールドホールディングス	6,300	2,313.00	14,571,900	
ディー・エヌ・エー	59,500	1,886.00	112,217,000	貸付有価証券 2,300株
博報堂DYホールディングス	211,100	1,511.00	318,972,100	
ぐるなび	24,700	387.00	9,558,900	貸付有価証券 400株
タカミヤ	18,900	333.00	6,293,700	
ジャパンベストレスキューシステム	10,000	743.00	7,430,000	
ファンコミュニケーションズ	37,800	419.00	15,838,200	貸付有価証券 100株
ライク	5,200	2,094.00	10,888,800	貸付有価証券 1,900株
ビジネス・ブレークスルー	5,800	408.00	2,366,400	貸付有価証券 1,400株
エスプール	44,200	1,194.00	52,774,800	
WDBホールディングス	7,100	2,584.00	18,346,400	
ティア	9,100	431.00	3,922,100	
CDG	1,700	1,300.00	2,210,000	
アドウェイズ	23,400	779.00	18,228,600	貸付有価証券 3,500株(3,100株)
バリューコマース	12,300	3,070.00	37,761,000	
インフォマート	171,300	494.00	84,622,200	貸付有価証券 4,000株
J Pホールディングス	40,200	208.00	8,361,600	貸付有価証券 300株
CLホールディングス	3,300	1,068.00	3,524,400	
プレステージ・インター	58,600	604.00	35,394,400	

ナショナル				
アミューズ	8,500	1,939.00	16,481,500	
ドリームインキュベータ	4,400	1,950.00	8,580,000	貸付有価証券 1,000株
クイック	10,400	1,462.00	15,204,800	
T A C	8,500	224.00	1,904,000	
電通グループ	156,300	4,665.00	729,139,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,300	1,225.00	8,942,500	
ぴあ	5,200	2,991.00	15,553,200	
イオンファンタジー	6,000	2,057.00	12,342,000	貸付有価証券 2,600株（200株）
シーティーエス	17,600	848.00	14,924,800	
ネクシィーズグループ	5,200	512.00	2,662,400	貸付有価証券 200株（200株）
H . U . グループホールディングス	40,900	2,958.00	120,982,200	
アルプス技研	12,500	1,925.00	24,062,500	貸付有価証券 100株
ダイオーズ	3,100	1,032.00	3,199,200	貸付有価証券 1,300株
日本空調サービス	16,400	803.00	13,169,200	
オリエンタルランド	178,600	17,200.00	3,071,920,000	貸付有価証券 1,200株
ダスキン	35,400	2,796.00	98,978,400	
明光ネットワークジャパン	18,400	573.00	10,543,200	
ファルコホールディングス	7,300	2,103.00	15,351,900	
秀英予備校	3,400	419.00	1,424,600	貸付有価証券 1,400株
ラウンドワン	43,600	1,270.00	55,372,000	
リゾートトラスト	69,800	2,078.00	145,044,400	
ピー・エム・エル	19,900	3,345.00	66,565,500	
りらいあコミュニケーションズ	23,100	1,032.00	23,839,200	
リソー教育	71,400	367.00	26,203,800	貸付有価証券 3,300株（3,000株）
早稲田アカデミー	8,700	1,027.00	8,934,900	貸付有価証券 2,300株
ユー・エス・エス	175,100	2,188.00	383,118,800	

東京個別指導学院	13,800	581.00	8,017,800	貸付有価証券 1,300株(700株)
サイバーエージェント	368,300	1,372.00	505,307,600	
楽天グループ	777,900	854.00	664,326,600	貸付有価証券 8,200株
クリーク・アンド・リバー社	8,200	1,965.00	16,113,000	
モーニングスター	27,300	536.00	14,632,800	
テー・オー・ダブリュー	29,900	319.00	9,538,100	貸付有価証券 100株
山田コンサルティンググループ	8,100	1,162.00	9,412,200	
セントラルスポーツ	5,800	2,308.00	13,386,400	貸付有価証券 2,500株
フルキャストホールディングス	13,300	2,198.00	29,233,400	
エン・ジャパン	26,100	3,090.00	80,649,000	
リソルホールディングス	1,700	4,410.00	7,497,000	貸付有価証券 600株
テクノプロ・ホールディングス	93,600	2,894.00	270,878,400	
アトラグループ	3,500	253.00	885,500	
インターワークス	4,500	376.00	1,692,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,300	3,865.00	28,214,500	
Keeper 技研	10,100	2,320.00	23,432,000	貸付有価証券 900株
ファーストロジック	2,800	769.00	2,153,200	
三機サービス	2,700	1,182.00	3,191,400	貸付有価証券 1,200株
Gunosy	8,600	937.00	8,058,200	貸付有価証券 4,000株(3,900株)
デザインワン・ジャパン	4,100	182.00	746,200	
イー・ガーディアン	6,000	2,808.00	16,848,000	
リブセンス	8,600	162.00	1,393,200	貸付有価証券 400株
ジャパンマテリアル	48,100	1,859.00	89,417,900	
ベクトル	21,900	1,182.00	25,885,800	貸付有価証券 8,200株
ウチヤマホールディングス	7,700	306.00	2,356,200	貸付有価証券 100株

チャーム・ケア・コーポレーション	11,600	1,072.00	12,435,200	
キャリアリンク	5,800	1,428.00	8,282,400	貸付有価証券 700株
I B J	12,800	665.00	8,512,000	
アサンテ	6,900	1,464.00	10,101,600	
バリューHR	12,800	1,291.00	16,524,800	貸付有価証券 5,200株
M & Aキャピタルパートナーズ	12,900	3,240.00	41,796,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,100	1,146.00	6,990,600	貸付有価証券 1,400株（1,300株）
E R Iホールディングス	4,400	1,277.00	5,618,800	貸付有価証券 400株（400株）
アビスト	2,400	2,753.00	6,607,200	
シグマクシス・ホールディングス	18,800	1,039.00	19,533,200	
ウィルグループ	11,600	1,071.00	12,423,600	
エスクロー・エージェント・ジャパン	19,400	164.00	3,181,600	
メドピア	11,700	2,599.00	30,408,300	貸付有価証券 600株
レアジョブ	2,900	767.00	2,224,300	貸付有価証券 700株（200株）
リクルートホールディングス	1,177,700	4,368.00	5,144,193,600	
エラン	21,600	946.00	20,433,600	
土木管理総合試験所	7,200	327.00	2,354,400	
ネットマーケティング	7,600	672.00	5,107,200	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
日本郵政	1,956,900	911.90	1,784,497,110	
ベルシステム24ホールディングス	22,500	1,444.00	32,490,000	
鎌倉新書	17,800	550.00	9,790,000	貸付有価証券 4,200株（3,900株）
S M N	3,400	590.00	2,006,000	
一蔵	2,000	388.00	776,000	
グローバルキッズCOMPANY	2,700	698.00	1,884,600	
エアトリ	9,800	2,861.00	28,037,800	貸付有価証券 800株（300株）

アトラエ	10,900	1,580.00	17,222,000	
ストライク	6,200	3,775.00	23,405,000	
ソラスト	38,400	825.00	31,680,000	
セラク	5,000	1,186.00	5,930,000	貸付有価証券 1,400株（100株）
インソース	15,900	1,894.00	30,114,600	貸付有価証券 5,900株
ベイカレント・コンサル ティング	11,100	41,650.00	462,315,000	
Orchestra H oldings	3,000	2,372.00	7,116,000	貸付有価証券 200株（200株）
アイモバイル	5,600	1,309.00	7,330,400	貸付有価証券 1,200株（1,100株）
キャリアインデックス	5,300	522.00	2,766,600	
MS - Japan	6,300	813.00	5,121,900	貸付有価証券 300株
船場	3,100	695.00	2,154,500	
ジャパンエレベーター サービスホールディン	49,600	1,630.00	80,848,000	
フルテック	2,200	1,335.00	2,937,000	
グリーンズ	5,900	620.00	3,658,000	
ツナググループ・ホール ディングス	3,800	265.00	1,007,000	
GameWith	4,700	468.00	2,199,600	貸付有価証券 2,200株
MS&Consulting	2,300	704.00	1,619,200	
ウェルビー	10,200	898.00	9,159,600	貸付有価証券 100株（100株）
エル・ティー・エス	2,000	2,706.00	5,412,000	貸付有価証券 800株（800株）
ミダックホールディング ス	7,100	1,967.00	13,965,700	貸付有価証券 2,800株
日総工産	12,200	624.00	7,612,800	貸付有価証券 1,200株
キュービーネットホール ディングス	7,200	1,339.00	9,640,800	
RPAホールディングス	22,000	402.00	8,844,000	貸付有価証券 9,700株（9,500株）
スプリックス	4,700	1,175.00	5,522,500	貸付有価証券 700株（700株）

マネジメントソリューションズ	7,700	4,495.00	34,611,500	
プロレド・パートナーズ	3,400	556.00	1,890,400	貸付有価証券 100株（100株）
and factory	3,800	409.00	1,554,200	
テノ・ホールディングス	1,900	610.00	1,159,000	
フロンティア・マネジメント	4,100	932.00	3,821,200	
ピアラ	2,500	826.00	2,065,000	貸付有価証券 1,100株（800株）
コプロ・ホールディングス	3,000	1,003.00	3,009,000	
ギークス	2,700	1,131.00	3,053,700	貸付有価証券 200株（100株）
カーブスホールディングス	42,900	672.00	28,828,800	
フォーラムエンジニアリング	10,400	833.00	8,663,200	
Fast Fitness Japan	2,900	1,813.00	5,257,700	
ダイレクトマーケティングミックス	17,400	1,555.00	27,057,000	貸付有価証券 400株
ポピンズ	3,600	1,938.00	6,976,800	
LITALICO	12,700	2,340.00	29,718,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	7,900	490.00	3,871,000	
リログループ	85,500	1,830.00	156,465,000	貸付有価証券 3,900株
東祥	11,700	1,512.00	17,690,400	貸付有価証券 600株（400株）
ビーウィズ	4,200	1,458.00	6,123,600	貸付有価証券 1,800株
TREホールディングス	24,100	2,066.00	49,790,600	
人・夢・技術グループ	6,200	2,218.00	13,751,600	
エイチ・アイ・エス	34,000	2,012.00	68,408,000	貸付有価証券 11,100株
ラックランド	4,700	2,942.00	13,827,400	貸付有価証券 1,000株
共立メンテナンス	27,900	4,540.00	126,666,000	貸付有価証券 6,100株（2,500株）
イチネンホールディング	16,000	1,222.00	19,552,000	



ス				
建設技術研究所	8,900	2,286.00	20,345,400	
スペース	10,800	897.00	9,687,600	
燦ホールディングス	6,800	1,570.00	10,676,000	貸付有価証券 100株（100株）
スバル興業	900	8,370.00	7,533,000	貸付有価証券 400株
東京テアトル	6,000	1,211.00	7,266,000	
タナベ経営	6,000	640.00	3,840,000	
ナガワ	4,800	8,950.00	42,960,000	貸付有価証券 400株
東京都競馬	11,700	3,845.00	44,986,500	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
常磐興産	6,000	1,225.00	7,350,000	
カナモト	26,900	1,951.00	52,481,900	貸付有価証券 11,700株
西尾レントオール	13,900	2,750.00	38,225,000	
トランス・コスモス	19,800	3,150.00	62,370,000	貸付有価証券 1,000株
乃村工藝社	67,000	866.00	58,022,000	貸付有価証券 100株
藤田観光	6,800	2,225.00	15,130,000	貸付有価証券 2,900株
KNT-CTホールディングス	9,700	1,417.00	13,744,900	
日本管財	16,700	2,756.00	46,025,200	
トーカイ	13,300	1,706.00	22,689,800	
白洋舎	1,700	1,223.00	2,079,100	貸付有価証券 700株
セコム	154,100	9,308.00	1,434,362,800	貸付有価証券 200株
セントラル警備保障	7,500	2,146.00	16,095,000	貸付有価証券 300株（300株）
丹青社	31,200	778.00	24,273,600	
メイテック	18,600	6,330.00	117,738,000	
応用地質	16,700	1,882.00	31,429,400	貸付有価証券 100株
船井総研ホールディングス	31,100	2,054.00	63,879,400	
進学会ホールディングス	5,100	321.00	1,637,100	貸付有価証券 1,700株（200株）

	オオバ	10,400	771.00	8,018,400	貸付有価証券 4,800株
	いであ	4,100	1,786.00	7,322,600	貸付有価証券 200株（100株）
	学究社	5,000	1,586.00	7,930,000	貸付有価証券 400株（400株）
	ベネッセホールディングス	52,100	2,284.00	118,996,400	
	イオンディライト	19,300	2,884.00	55,661,200	貸付有価証券 1,700株（1,700株）
	ナック	7,400	949.00	7,022,600	
	ダイセキ	28,500	4,475.00	127,537,500	
	ステップ	5,700	1,758.00	10,020,600	
	小計 銘柄数：2,155 組入時価比率：98.0%			408,079,157,300 100.0%	
	合計			408,079,157,300	

(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(2022年5月10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	2022年 5月10日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	8,481,583,000	-	8,289,480,000	192,322,780
合計	8,481,583,000	-	8,289,480,000	192,322,780

(注) 時価の算定方法

### 1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(2022年 5月10日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	23,508,849,046
コール・ローン	3,333,865,975
株式	1,167,483,181,562
投資証券	29,420,028,941
派生商品評価勘定	2,187,085
未収入金	65,667,064
未収配当金	1,289,265,698
差入委託証拠金	5,590,521,915
流動資産合計	1,230,693,567,286
資産合計	1,230,693,567,286
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	857,660,774
未払金	14,843,538,473
未払解約金	3,500,983,006
未払利息	1,278
その他未払費用	5,866,000
流動負債合計	19,208,049,531
負債合計	19,208,049,531
純資産の部	
元本等	
元本	277,899,529,064
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	933,585,988,691
元本等合計	1,211,485,517,755
純資産合計	1,211,485,517,755
負債純資産合計	1,230,693,567,286

### 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>
-------------------	---

2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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> <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	<p>金融商品の時価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>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年 5月10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	4,3594円
(10,000口当たり純資産額)	(43,594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>自 2021年 5月11日 至 2022年 5月10日</p>
<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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

2022年 5月10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

2022年 5月10日現在	
期首	2021年 5月11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	244,666,051,153円
同期中における追加設定元本額	59,093,334,543円
同期中における一部解約元本額	25,859,856,632円
期末元本額	277,899,529,064円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	30,317,185円
バランスセレクト50	92,352,724円
バランスセレクト70	112,857,172円
野村外国株式インデックスファンド	485,716,793円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,037,546,672円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	3,947,128,974円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	3,747,606,987円
野村資産設計ファンド2015	9,460,464円
野村資産設計ファンド2020	9,740,966円
野村資産設計ファンド2025	17,328,508円

野村資産設計ファンド2030	26,027,030円
野村資産設計ファンド2035	22,118,698円
野村資産設計ファンド2040	42,043,135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)	45,402,276,073円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	779,463,722円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	9,520,403,424円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	9,295,192,749円
野村資産設計ファンド2045	8,363,908円
野村インデックスファンド・外国株式	7,371,227,979円
マイ・ロード	918,338,294円
ネクストコア	3,576,433円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	160,761,117円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	2,340,514,545円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	385,406,352円
野村資産設計ファンド2050	10,461,282円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	3,076,361円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,733,673円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,362,544円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,173,255円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	215,285,581円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	783,761,487円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,789,424円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,709,987円
インデックス・ブレンド(タイプ )	27,715,789円
インデックス・ブレンド(タイプ )	7,471,404円
インデックス・ブレンド(タイプ )	34,801,340円
野村6資産均等バランス	1,336,517,312円
野村つみたて外国株投信	10,970,727,050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)	4,716,473,479円
世界6資産分散ファンド	37,248,872円
野村資産設計ファンド2060	7,421,864円
野村スリーゼロ先進国株式投信	792,588,956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	6,292,535,403円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	4,952,003,475円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	127,830,823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)	62,824,062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)	548,163,726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)	663,844,163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)	1,367,976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)	4,347,108円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	1,162,377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)	938,971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)	14,371,070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)	373,603,105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)	4,437,762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)	27,164,792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)	85,773,107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)	2,158,865,982円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	20,023,555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)	664,317,536円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	11,414,006,091円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	1,140,724円
先進8カ国国債入替型プラス外国株式戦略20オープン(部分為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	7,975,904円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	1,332,019円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	8,283,974円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	8,509,741円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)	86,839,455,744円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,012,159,261円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	7,650,148,951円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	7,391,796,824円
マイバランスDC30	766,709,442円
マイバランスDC50	1,785,062,969円
マイバランスDC70	1,583,430,281円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	33,822,415,022円
野村DC運用戦略ファンド	111,820,477円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	8,076,318円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	386,529,492円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	329,440,744円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	325,382,226円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	17,055,943円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	7,800,510円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	42,298,302円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	7,726,614円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	7,001,436円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	5,500,594円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	178,417,655円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	138,075,998円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	80,183,913円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	111,371,284円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	3,593,401円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	27,923,066円
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	91,527,692円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	4,711,895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(2022年5月10日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES CO	158,000	30.05	4,747,900.00	
		HALLIBURTON CO	173,000	33.36	5,771,280.00	
		SCHLUMBERGER LTD	269,000	38.04	10,232,760.00	
		CHENIERE ENERGY INC	45,900	134.34	6,166,206.00	
		CHEVRON CORP	367,100	159.25	58,460,675.00	
		CONOCOPHILLIPS	251,200	97.20	24,416,640.00	
		COTERRA ENERGY INC	145,000	29.32	4,251,400.00	
		DEVON ENERGY CORP	123,600	62.02	7,665,672.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	32,100	129.49	4,156,629.00	
		EOG RESOURCES INC	112,100	117.94	13,221,074.00	
		EXXON MOBIL CORP	806,300	84.46	68,100,098.00	
		HESS CORP	52,400	106.73	5,592,652.00	
		KINDER MORGAN INC	385,000	18.60	7,161,000.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	118,100	90.86	10,730,566.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	177,200	57.84	10,249,248.00	
		ONEOK INC	85,100	61.71	5,251,521.00	
		PHILLIPS 66	90,700	89.48	8,115,836.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	44,500	244.39	10,875,355.00	
		VALERO ENERGY CORP	78,500	118.45	9,298,325.00	
		WILLIAMS COS	231,000	34.74	8,024,940.00	
		AIR PRODUCTS	42,000	233.22	9,795,240.00	
		ALBEMARLE CORP	22,600	221.64	5,009,064.00	
		CELANESE CORP-SERIES A	20,900	142.92	2,987,028.00	
		CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	41,200	90.88	3,744,256.00	
		CORTEVA INC	138,700	53.08	7,362,196.00	
		DOW INC	140,500	66.63	9,361,515.00	
		DUPONT DE NEMOURS INC	99,800	64.33	6,420,134.00	
		EASTMAN CHEMICAL CO.	25,000	103.42	2,585,500.00	
		ECOLAB INC	48,600	163.81	7,961,166.00	
		FMC CORP	24,800	113.91	2,824,968.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	48,100	119.49	5,747,469.00			
LINDE PLC	97,600	300.27	29,306,352.00			



LYONDELLBASELL INDU-CL A	51,400	106.60	5,479,240.00
MOSAIC CO/THE	69,000	55.86	3,854,340.00
PPG INDUSTRIES	45,800	127.14	5,823,012.00
RPM INTERNATIONAL INC	23,500	84.94	1,996,090.00
SHERWIN-WILLIAMS	47,200	276.97	13,072,984.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	11,600	332.79	3,860,364.00
VULCAN MATERIALS CO	24,700	162.95	4,024,865.00
AMCOR PLC	286,000	12.61	3,606,460.00
AVERY DENNISON CORP	15,600	176.41	2,751,996.00
BALL CORP	61,800	69.49	4,294,482.00
CROWN HOLDINGS INC	24,700	101.73	2,512,731.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	71,700	47.81	3,427,977.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	17,700	160.78	2,845,806.00
SEALED AIR CORP	29,400	64.21	1,887,774.00
WESTROCK CO	52,000	51.31	2,668,120.00
FREEMONT-MCMORAN INC	282,000	35.52	10,016,640.00
NEWMONT CORP	151,100	68.92	10,413,812.00
NUCOR CORP	53,900	130.03	7,008,617.00
STEEL DYNAMICS	37,100	77.22	2,864,862.00
BOEING CO	106,800	133.31	14,237,508.00
GENERAL DYNAMICS	45,500	229.37	10,436,335.00
HEICO CORP	7,900	133.00	1,050,700.00
HEICO CORP-CLASS A	13,900	108.65	1,510,235.00
HOWMET AEROSPACE INC	72,000	33.27	2,395,440.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	7,500	209.98	1,574,850.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	37,700	239.25	9,019,725.00
LOCKHEED MARTIN	47,300	438.84	20,757,132.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	28,800	453.98	13,074,624.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	285,100	91.75	26,157,925.00
TEXTRON INC	40,700	64.28	2,616,196.00
TRANSDIGM GROUP INC	10,000	545.69	5,456,900.00
ALLEGION PLC	16,300	113.85	1,855,755.00
CARRIER GLOBAL CORP	159,000	38.13	6,062,670.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	25,600	71.22	1,823,232.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	135,600	51.77	7,020,012.00

PLC				
LENNOX INTERNATIONAL INC	6,400	215.83	1,381,312.00	
MASCO CORP	45,800	53.76	2,462,208.00	
OWENS CORNING INC	18,900	91.65	1,732,185.00	
SMITH (A.O.) CORP	24,700	59.79	1,476,813.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	45,200	134.53	6,080,756.00	
AMETEK INC	43,800	121.84	5,336,592.00	
EATON CORP PLC	76,400	147.96	11,304,144.00	
EMERSON ELEC	114,200	84.41	9,639,622.00	
GENERAC HOLDINGS INC	12,300	227.44	2,797,512.00	
PLUG POWER INC	94,000	16.63	1,563,220.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	21,900	203.22	4,450,518.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	28,300	44.52	1,259,916.00	
SUNRUN INC	36,000	21.09	759,240.00	
3M CORP	110,300	152.38	16,807,514.00	
GENERAL ELECTRIC CO	210,100	72.97	15,330,997.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	131,100	193.96	25,428,156.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	41,400	54.12	2,240,568.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	20,000	432.92	8,658,400.00	
CATERPILLAR INC DEL	103,000	206.29	21,247,870.00	
CUMMINS INC	27,600	202.71	5,594,796.00	
DEERE & COMPANY	56,100	364.53	20,450,133.00	
DOVER CORP	26,800	132.10	3,540,280.00	
FORTIVE CORP	64,800	59.23	3,838,104.00	
IDEX CORP	14,200	189.00	2,683,800.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	59,400	209.44	12,440,736.00	
INGERSOLL-RAND INC	76,400	43.25	3,304,300.00	
KORNIT DIGITAL LTD	8,200	56.79	465,678.00	
NORDSON CORP	9,600	208.73	2,003,808.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	77,900	73.31	5,710,849.00	
PACCAR	65,700	85.35	5,607,495.00	
PARKER HANNIFIN CORP	24,800	271.19	6,725,512.00	
PENTAIR PLC	30,000	51.19	1,535,700.00	
SNAP-ON INC	10,600	217.96	2,310,376.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	30,900	125.66	3,882,894.00	
WABTEC CORP	34,100	86.87	2,962,267.00	

XYLEM INC	33,800	84.98	2,872,324.00
AERCAP HOLDINGS NV	25,100	41.79	1,048,929.00
FASTENAL CO	108,900	53.10	5,782,590.00
GRAINGER(W.W.) INC	8,300	476.82	3,957,606.00
UNITED RENTALS INC	13,500	286.82	3,872,070.00
CINTAS CORP	17,700	374.23	6,623,871.00
COPART INC	40,800	108.69	4,434,552.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	41,800	130.95	5,473,710.00
ROLLINS INC	41,000	33.61	1,378,010.00
WASTE CONNECTIONS INC	49,600	122.92	6,096,832.00
WASTE MANAGEMENT INC	79,200	159.24	12,611,808.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	24,300	107.95	2,623,185.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	32,700	109.76	3,589,152.00
FEDEX CORPORATION	47,900	208.27	9,976,133.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	138,900	181.43	25,200,627.00
DELTA AIR LINES INC	30,000	38.25	1,147,500.00
SOUTHWEST AIRLINES	29,000	43.83	1,271,070.00
AMERCO	1,720	529.02	909,914.40
CSX CORP	425,000	33.62	14,288,500.00
GRAB HOLDINGS LTD-CL A	203,000	2.80	568,400.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	15,700	172.50	2,708,250.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	30,100	49.88	1,501,388.00
LYFT INC-A	52,000	18.61	967,720.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	46,600	249.50	11,626,700.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	18,900	271.20	5,125,680.00
UBER TECHNOLOGIES INC	274,000	23.05	6,315,700.00
UNION PAC CORP	122,400	225.25	27,570,600.00
APTIV PLC	52,300	95.21	4,979,483.00
BORGWARNER INC	45,000	36.82	1,656,900.00
LEAR CORP	10,900	128.00	1,395,200.00
FORD MOTOR COMPANY	743,000	13.37	9,933,910.00
GENERAL MOTORS CO	251,000	38.26	9,603,260.00
LUCID GROUP INC	80,000	16.35	1,308,000.00
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	34,600	22.78	788,188.00

TESLA INC	162,580	787.11	127,968,343.80
DR HORTON INC	63,300	69.93	4,426,569.00
GARMIN LTD	28,800	102.70	2,957,760.00
LENNAR CORP-A	50,600	77.28	3,910,368.00
MOHAWK INDUSTRIES	11,500	148.19	1,704,185.00
NEWELL BRANDS INC	75,000	24.26	1,819,500.00
NVR INC	607	4,370.16	2,652,687.12
PULTEGROUP INC	47,000	42.67	2,005,490.00
WHIRLPOOL CORP	11,300	193.34	2,184,742.00
HASBRO INC	25,500	88.50	2,256,750.00
PELOTON INTERACTIVE INC-A	52,000	14.13	734,760.00
LULULEMON ATHLETICA INC	22,800	292.68	6,673,104.00
NIKE INC-B	243,400	111.21	27,068,514.00
V F CORP	61,700	47.51	2,931,367.00
AIRBNB INC-CLASS A	55,500	119.37	6,625,035.00
ARAMARK	44,000	34.27	1,507,880.00
BOOKING HOLDINGS INC	7,860	2,023.57	15,905,260.20
CAESARS ENTERTAINMENT INC	39,700	52.95	2,102,115.00
CARNIVAL CORP	159,000	14.14	2,248,260.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	5,350	1,276.57	6,829,649.50
DARDEN RESTAURANTS INC	25,000	125.11	3,127,750.00
DOMINOS PIZZA INC	6,900	333.60	2,301,840.00
DRAFTKINGS INC	76,000	10.99	835,240.00
EXPEDIA GROUP INC	27,900	127.79	3,565,341.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	53,000	133.31	7,065,430.00
LAS VEGAS SANDS CORP	64,000	31.86	2,039,040.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	52,600	163.85	8,618,510.00
MCDONALD'S CORP	142,300	247.49	35,217,827.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	4.55	154,700.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	71,000	35.14	2,494,940.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	43,700	61.41	2,683,617.00
STARBUCKS CORP	224,400	73.49	16,491,156.00
VAIL RESORTS INC	7,400	235.73	1,744,402.00
WYNN RESORTS LTD	19,300	61.33	1,183,669.00
YUM BRANDS INC	55,800	110.10	6,143,580.00

GENUINE PARTS CO	26,600	131.94	3,509,604.00
LKQ CORP	52,600	50.06	2,633,156.00
POOL CORP	7,800	399.84	3,118,752.00
AMAZON.COM INC	86,930	2,175.78	189,140,555.40
CHEWY INC - CLASS A	15,100	26.33	397,583.00
DOORDASH INC-A	19,600	64.18	1,257,928.00
EBAY INC	121,000	49.26	5,960,460.00
ETSY INC	24,400	86.40	2,108,160.00
FIVERR INTERNATIONAL LTD	5,200	42.87	222,924.00
MERCADOLIBRE INC	8,550	770.99	6,591,964.50
WAYFAIR INC - CLASS A	14,600	62.35	910,310.00
DOLLAR GENERAL CORP	44,300	231.37	10,249,691.00
DOLLAR TREE INC	43,300	161.53	6,994,249.00
TARGET CORP	91,300	224.20	20,469,460.00
ADVANCE AUTO PARTS	12,000	202.64	2,431,680.00
AUTOZONE	3,950	1,951.66	7,709,057.00
BATH & BODY WORKS INC	50,400	50.34	2,537,136.00
BEST BUY COMPANY INC	42,400	91.08	3,861,792.00
BURLINGTON STORES INC	13,100	188.62	2,470,922.00
CARMAX INC	31,300	92.81	2,904,953.00
CARVANA CO	19,700	38.77	763,769.00
HOME DEPOT	198,900	297.03	59,079,267.00
LOWES COS INC	128,300	196.07	25,155,781.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	12,760	610.07	7,784,493.20
ROSS STORES INC	68,500	93.41	6,398,585.00
TJX COS INC	227,600	59.14	13,460,264.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	21,500	198.24	4,262,160.00
ULTA BEAUTY INC	9,900	381.09	3,772,791.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	84,150	498.83	41,976,544.50
KROGER CO	133,000	54.84	7,293,720.00
SYSCO CORP	98,600	81.08	7,994,488.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	139,000	43.85	6,095,150.00
WALMART INC	292,100	151.31	44,197,651.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	58,500	64.84	3,793,140.00
COCA COLA CO	781,500	64.61	50,492,715.00

COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	39,300	48.85	1,919,805.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	31,200	246.24	7,682,688.00	
KEURIG DR PEPPER INC	137,000	37.14	5,088,180.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	35,000	53.67	1,878,450.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	75,000	83.57	6,267,750.00	
PEPSICO INC	263,300	171.70	45,208,610.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	107,400	84.36	9,060,264.00	
BUNGE LIMITED	26,800	107.83	2,889,844.00	
CAMPBELL SOUP CO	36,000	51.39	1,850,040.00	
CONAGRA BRANDS INC	93,000	36.29	3,374,970.00	
GENERAL MILLS	116,400	73.50	8,555,400.00	
HERSHEY CO/THE	27,500	223.20	6,138,000.00	
HORMEL FOODS CORP	55,000	52.55	2,890,250.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	20,100	145.01	2,914,701.00	
KELLOGG CO	49,400	74.53	3,681,782.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	130,000	44.19	5,744,700.00	
MCCORMICK & CO INC.	47,700	98.52	4,699,404.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	266,900	66.28	17,690,132.00	
TYSON FOODS INC-CL A	57,000	92.84	5,291,880.00	
ALTRIA GROUP INC	349,900	55.26	19,335,474.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	296,500	99.87	29,611,455.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	47,300	98.36	4,652,428.00	
CLOROX CO	23,900	157.43	3,762,577.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	153,500	77.67	11,922,345.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	64,000	140.34	8,981,760.00	
PROCTER & GAMBLE CO	460,900	155.61	71,720,649.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	44,400	233.58	10,370,952.00	
ABBOTT LABORATORIES	336,800	107.39	36,168,952.00	
ABIOMED INC	8,700	234.10	2,036,670.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	14,300	268.96	3,846,128.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	96,400	73.62	7,096,968.00	
BECTON,DICKINSON	54,400	252.20	13,719,680.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	273,000	38.29	10,453,170.00	
DENTSPLY SIRONA INC	42,200	39.25	1,656,350.00	
DEXCOM INC	18,700	330.02	6,171,374.00	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	119,700	94.69	11,334,393.00	
HOLOGIC INC	48,900	72.76	3,557,964.00	
IDEXX LABORATORIES INC	15,880	345.02	5,478,917.60	
INMODE LTD	8,800	21.90	192,720.00	
INSULET CORP	13,300	191.46	2,546,418.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	68,300	208.71	14,254,893.00	
MASIMO CORP	9,300	120.51	1,120,743.00	
MEDTRONIC PLC	256,100	99.58	25,502,438.00	
NOVOCURE LTD	18,800	62.84	1,181,392.00	
RESMED INC	27,500	192.74	5,300,350.00	
STERIS PLC	19,100	213.16	4,071,356.00	
STRYKER CORP	65,000	229.01	14,885,650.00	
TELEFLEX INC	8,700	259.70	2,259,390.00	
THE COOPER COMPANIES, INC.	9,300	311.61	2,897,973.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	40,000	115.00	4,600,000.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	30,200	157.32	4,751,064.00	
ANTHEM INC	46,230	490.88	22,693,382.40	
CARDINAL HEALTH INC	55,300	56.97	3,150,441.00	
CENTENE CORP	110,700	79.19	8,766,333.00	
CIGNA CORP	63,400	261.41	16,573,394.00	
CVS HEALTH CORP	251,400	98.86	24,853,404.00	
DAVITA INC	12,500	104.37	1,304,625.00	
HCA HEALTHCARE INC	47,700	224.10	10,689,570.00	
HENRY SCHEIN INC	25,700	85.00	2,184,500.00	
HUMANA INC	24,400	424.51	10,358,044.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	18,300	241.26	4,415,058.00	
MCKESSON CORP	29,300	326.47	9,565,571.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	11,100	296.50	3,291,150.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	23,700	136.21	3,228,177.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	179,380	486.42	87,254,019.60	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	14,400	125.33	1,804,752.00	
ABBVIE INC	336,700	150.96	50,828,232.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	23,000	122.52	2,817,960.00	
AMGEN INC	107,300	239.24	25,670,452.00	
BIOGEN INC	27,700	187.54	5,194,858.00	

BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	35,900	74.62	2,678,858.00	
EXACT SCIENCES CORP	32,300	50.27	1,623,721.00	
GILEAD SCIENCES INC	240,200	61.68	14,815,536.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	41,100	83.26	3,421,986.00	
INCYTE CORP	36,500	72.65	2,651,725.00	
MODERNA INC	66,200	135.80	8,989,960.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	17,000	75.79	1,288,430.00	
NOVAVAX INC	13,000	53.26	692,380.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	20,020	599.77	12,007,395.40	
SEAGEN INC	25,800	108.81	2,807,298.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	48,200	235.02	11,327,964.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	422,700	76.27	32,239,329.00	
CATALENT INC	32,300	93.70	3,026,510.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	81,000	21.84	1,769,040.00	
ELI LILLY & CO.	154,900	289.23	44,801,727.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	12,000	141.87	1,702,440.00	
JOHNSON & JOHNSON	501,400	177.33	88,913,262.00	
MERCK & CO INC	481,100	87.64	42,163,604.00	
PFIZER INC	1,069,000	48.64	51,996,160.00	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	63,000	37.53	2,364,390.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	215,000	7.42	1,595,300.00	
VIATRIS INC	229,000	10.48	2,399,920.00	
ZOETIS INC	90,600	161.81	14,659,986.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,403,000	36.37	51,027,110.00	
CITIGROUP	379,400	49.89	18,928,266.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	93,800	39.42	3,697,596.00	
FIFTH THIRD BANCORP	132,000	36.80	4,857,600.00	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	2,250	640.14	1,440,315.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	33,700	144.23	4,860,551.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	271,000	13.16	3,566,360.00	
JPMORGAN CHASE & CO	562,800	121.86	68,582,808.00	
KEYCORP	178,000	19.18	3,414,040.00	
M & T BANK CORP	33,700	168.03	5,662,611.00	
PNC FINANCIAL	80,000	163.67	13,093,600.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	180,000	20.57	3,702,600.00	



SIGNATURE BANK	11,500	220.03	2,530,345.00	
SVB FINANCIAL GROUP	11,330	469.81	5,322,947.30	
TRUIST FINANCIAL CORP	255,800	48.57	12,424,206.00	
US BANCORP	269,800	49.44	13,338,912.00	
WEBSTER FINANCIAL CORP	33,000	47.18	1,556,940.00	
WELLS FARGO CO	759,300	43.96	33,378,828.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	70,000	49.55	3,468,500.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	248,300	312.96	77,707,968.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	69,000	28.32	1,954,080.00	
AFLAC INC	121,000	57.56	6,964,760.00	
ALLEGHANY CORP	2,590	830.57	2,151,176.30	
ALLSTATE CORP	55,200	128.96	7,118,592.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	13,900	144.20	2,004,380.00	
AMERICAN INTL GROUP	159,400	59.61	9,501,834.00	
AON PLC	42,200	275.09	11,608,798.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	75,000	45.22	3,391,500.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	39,500	160.19	6,327,505.00	
ASSURANT INC	11,300	180.97	2,044,961.00	
BROWN & BROWN INC	46,000	56.58	2,602,680.00	
CHUBB LTD	82,400	205.11	16,901,064.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	28,500	125.02	3,563,070.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	4,400	165.81	729,564.00	
EVEREST RE GROUP LTD	7,800	280.56	2,188,368.00	
FNF GROUP	50,000	40.37	2,018,500.00	
GLOBE LIFE INC	17,700	98.54	1,744,158.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	65,300	70.80	4,623,240.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	33,200	55.77	1,851,564.00	
LOEWS CORP	41,800	63.08	2,636,744.00	
MARKEL CORP	2,660	1,287.07	3,423,606.20	
MARSH & MCLENNAN COS	96,600	157.05	15,171,030.00	
METLIFE INC	137,300	65.64	9,012,372.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	50,700	68.99	3,497,793.00	
PROGRESSIVE CO	112,100	108.75	12,190,875.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	72,700	105.11	7,641,497.00	
TRAVELERS COS INC/THE	46,600	171.92	8,011,472.00	

WILLIS TOWERS WATSON PLC	23,800	207.77	4,944,926.00
WR BERKLEY CORP	39,900	67.23	2,682,477.00
ACCENTURE PLC-CL A	120,300	287.49	34,585,047.00
AFFIRM HOLDINGS INC	33,000	20.59	679,470.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	31,300	95.50	2,989,150.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	80,600	209.79	16,909,074.00
BLOCK INC	97,500	83.86	8,176,350.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	21,800	137.71	3,002,078.00
CLOUDFLARE INC - CLASS A	49,300	56.56	2,788,408.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	99,700	76.27	7,604,119.00
EPAM SYSTEMS INC	11,000	317.89	3,496,790.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	116,700	94.54	11,032,818.00
FISERV INC	112,600	93.63	10,542,738.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	15,000	216.61	3,249,150.00
GARTNER INC	15,300	239.32	3,661,596.00
GLOBAL PAYMENTS INC	54,900	118.38	6,499,062.00
GODADDY INC - CLASS A	32,300	69.89	2,257,447.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	170,800	134.44	22,962,352.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	13,900	177.33	2,464,887.00
MASTERCARD INC	167,100	327.99	54,807,129.00
MONGODB INC	11,300	252.72	2,855,736.00
OKTA INC	28,000	88.83	2,487,240.00
PAYCHEX INC	62,400	120.27	7,504,848.00
PAYPAL HOLDINGS INC	213,500	79.53	16,979,655.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	40,600	143.29	5,817,574.00
TWILIO INC - A	32,200	100.75	3,244,150.00
VERISIGN INC	18,500	164.86	3,049,910.00
VISA INC-CLASS A SHARES	318,000	193.00	61,374,000.00
WESTERN UNION CO	75,000	17.19	1,289,250.00
WIX.COM LTD	12,200	64.63	788,486.00
ADOBE INC	90,650	376.91	34,166,891.50
ANSYS INC	16,400	249.17	4,086,388.00
ASANA INC - CL A	11,900	22.44	267,036.00
AUTODESK INC.	42,300	186.32	7,881,336.00
AVALARA INC	17,200	75.61	1,300,492.00

BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	33,000	36.18	1,193,940.00	
BILL.COM HOLDINGS INC	14,200	107.91	1,532,322.00	
BLACK KNIGHT INC	29,800	70.08	2,088,384.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	53,300	137.18	7,311,694.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	26,800	52.43	1,405,124.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	20,100	119.29	2,397,729.00	
CITRIX SYSTEMS INC	23,800	100.02	2,380,476.00	
COUPA SOFTWARE INC	14,200	68.55	973,410.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	36,900	143.69	5,302,161.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	8,300	112.86	936,738.00	
DATADOG INC - CLASS A	41,300	97.53	4,027,989.00	
DOCUSIGN INC	36,400	68.63	2,498,132.00	
DROPBOX INC-CLASS A	57,000	20.48	1,167,360.00	
DYNATRACE INC	33,000	31.92	1,053,360.00	
FAIR ISAAC CORP	5,120	341.44	1,748,172.80	
FORTINET INC	26,700	245.22	6,547,374.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	15,800	74.08	1,170,464.00	
HUBSPOT INC	8,400	332.91	2,796,444.00	
INTUIT INC	51,210	367.01	18,794,582.10	
MICROSOFT CORP	1,358,400	264.58	359,405,472.00	
NORTONLIFELOCK INC	110,000	24.57	2,702,700.00	
ORACLE CORPORATION	312,400	71.54	22,349,096.00	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	309,000	7.46	2,305,140.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	18,940	459.51	8,703,119.40	
PAYCOM SOFTWARE INC	9,600	280.17	2,689,632.00	
PTC INC	22,000	106.55	2,344,100.00	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	14,500	68.66	995,570.00	
SALESFORCE INC	186,440	163.60	30,501,584.00	
SERVICENOW INC	38,100	425.87	16,225,647.00	
SPLUNK INC	30,400	90.04	2,737,216.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	42,700	60.37	2,577,799.00	
SYNOPSYS INC	29,300	262.41	7,688,613.00	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	82,300	44.99	3,702,677.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	8,000	354.20	2,833,600.00	

UNITY SOFTWARE INC	11,200	50.38	564,256.00
VMMWARE INC - CLASS A	39,800	99.19	3,947,762.00
WORKDAY INC-CLASS A	36,400	176.21	6,414,044.00
ZENDESK INC	22,600	99.14	2,240,564.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	40,600	92.34	3,749,004.00
ZSCALER INC	16,400	153.09	2,510,676.00
ARISTA NETWORKS INC	44,000	102.48	4,509,120.00
CISCO SYSTEMS	803,300	48.96	39,329,568.00
F5 INC	11,300	166.44	1,880,772.00
JUNIPER NETWORKS INC	60,000	30.70	1,842,000.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	32,500	202.08	6,567,600.00
APPLE INC	3,124,700	152.06	475,141,882.00
DELL TECHNOLOGIES-C	55,800	45.19	2,521,602.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	246,000	15.84	3,896,640.00
HP INC	217,000	37.01	8,031,170.00
NETAPP INC	43,100	71.32	3,073,892.00
SEAGATE TECHNOLOGY	38,400	80.36	3,085,824.00
WESTERN DIGITAL CORP	58,600	56.53	3,312,658.00
AMPHENOL CORP-CL A	112,600	69.09	7,779,534.00
ARROW ELECTRS INC	13,700	124.74	1,708,938.00
CDW CORPORATION	26,300	164.80	4,334,240.00
COGNEX CORP	33,600	49.12	1,650,432.00
CORNING INC	155,000	35.76	5,542,800.00
IPG PHOTONICS CORP	6,900	100.78	695,382.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	34,900	132.20	4,613,780.00
TE CONNECTIVITY LTD	61,400	123.29	7,570,006.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	9,100	399.00	3,630,900.00
TRIMBLE INC	47,300	61.96	2,930,708.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	10,300	328.54	3,383,962.00
ADVANCED MICRO DEVICES	311,348	86.36	26,888,013.28
ANALOG DEVICES INC	102,600	152.25	15,620,850.00
APPLIED MATERIALS	172,000	105.75	18,189,000.00
BROADCOM INC	78,390	562.92	44,127,298.80
ENPHASE ENERGY INC	24,600	150.51	3,702,546.00
ENTEGRIS INC	25,700	105.50	2,711,350.00

INTEL CORP	774,500	43.07	33,357,715.00
KLA CORP	29,100	318.87	9,279,117.00
LAM RESEARCH	26,980	447.15	12,064,107.00
MARVELL TECHNOLOGY INC	156,200	53.73	8,392,626.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	105,600	64.31	6,791,136.00
MICRON TECHNOLOGY	214,100	67.93	14,543,813.00
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	8,400	406.74	3,416,616.00
NVIDIA CORP	476,140	169.50	80,705,730.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	51,100	172.90	8,835,190.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	81,700	50.82	4,151,994.00
QORVO INC	20,700	102.76	2,127,132.00
QUALCOMM INC	213,300	134.92	28,778,436.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	31,700	102.17	3,238,789.00
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	10,000	225.36	2,253,600.00
TERADYNE INC	30,200	100.22	3,026,644.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	175,900	164.94	29,012,946.00
AT & T INC	1,360,000	19.55	26,588,000.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	31,000	21.85	677,350.00
LIBERTY GLOBAL PLC-C	64,000	22.76	1,456,640.00
LUMEN TECHNOLOGIES INC	162,000	11.15	1,806,300.00
VERIZON COMMUNICATIONS	788,100	48.62	38,317,422.00
T-MOBILE US INC	119,500	121.73	14,546,735.00
ALLIANT ENERGY CORP	48,400	58.72	2,842,048.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	94,900	99.69	9,460,581.00
CONSTELLATION ENERGY	62,900	57.62	3,624,298.00
DUKE ENERGY CORP	147,200	110.80	16,309,760.00
EDISON INTERNATIONAL	72,700	70.06	5,093,362.00
ENTERGY CORP	37,600	119.26	4,484,176.00
EVERGY INC	42,900	67.90	2,912,910.00
EVERSOURCE ENERGY	64,400	90.54	5,830,776.00
EXELON CORPORATION	188,000	46.73	8,785,240.00
FIRSTENERGY CORP	104,000	42.17	4,385,680.00
NEXTERA ENERGY INC	373,700	70.71	26,424,327.00
NRG ENERGY INC	45,000	41.43	1,864,350.00
PG&E CORP	277,000	12.09	3,348,930.00

PPL CORPORATION	142,000	28.79	4,088,180.00
SOUTHERN CO.	200,600	74.23	14,890,538.00
XCEL ENERGY INC	102,500	73.65	7,549,125.00
ATMOS ENERGY CORP	24,400	113.63	2,772,572.00
UGI CORP	40,000	37.60	1,504,000.00
AMEREN CORPORATION	49,400	92.68	4,578,392.00
CENTERPOINT ENERGY INC	120,000	30.38	3,645,600.00
CMS ENERGY CORP	54,300	69.18	3,756,474.00
CONSOLIDATED EDISON INC	66,300	94.38	6,257,394.00
DOMINION ENERGY INC	153,400	83.77	12,850,318.00
DTE ENERGY COMPANY	36,200	129.52	4,688,624.00
NISOURCE INC	73,000	29.44	2,149,120.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	95,600	69.06	6,602,136.00
SEMPRA ENERGY	60,600	162.03	9,819,018.00
WEC ENERGY GROUP INC	60,200	101.94	6,136,788.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	34,700	145.79	5,058,913.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	44,000	43.42	1,910,480.00
ALLY FINANCIAL INC	71,000	40.60	2,882,600.00
AMERICAN EXPRESS CO	125,400	161.02	20,191,908.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	81,700	123.22	10,067,074.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	55,600	107.27	5,964,212.00
SOFI TECHNOLOGIES INC	92,000	5.97	549,240.00
SYNCHRONY FINANCIAL	103,800	37.03	3,843,714.00
UPSTART HOLDINGS INC	8,200	77.13	632,466.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	21,300	259.64	5,530,332.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	151,000	43.21	6,524,710.00
BLACKROCK INC	29,050	605.56	17,591,518.00
BLACKSTONE INC	129,900	96.66	12,556,134.00
CARLYLE GROUP INC/THE	29,000	35.52	1,030,080.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	19,500	107.19	2,090,205.00
CME GROUP INC	68,800	201.60	13,870,080.00
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	7,800	83.51	651,378.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,900	363.84	2,510,496.00
FRANKLIN RESOURCES INC	57,000	24.84	1,415,880.00
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	8,200	28.35	232,470.00

GOLDMAN SACHS GROUP	64,200	308.89	19,830,738.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	106,600	96.99	10,339,134.00
INVESCO LTD	65,000	17.71	1,151,150.00
KKR & CO INC-A	101,700	49.86	5,070,762.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	7,200	257.01	1,850,472.00
MOODYS CORP	31,700	285.63	9,054,471.00
MORGAN STANLEY	256,300	81.15	20,798,745.00
MSCI INC	15,900	379.08	6,027,372.00
NASDAQ INC	22,500	146.18	3,289,050.00
NORTHERN TRUST CORP	38,300	104.75	4,011,925.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	36,000	93.63	3,370,680.00
ROBINHOOD MARKETS INC -A	32,000	9.50	304,000.00
S&P GLOBAL INC	67,495	328.77	22,190,331.15
SCHWAB(CHARLES)CORP	277,100	64.13	17,770,423.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	22,500	54.86	1,234,350.00
STATE STREET CORP	69,800	69.25	4,833,650.00
T ROWE PRICE GROUP INC	42,100	122.44	5,154,724.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	18,700	60.48	1,130,976.00
AES CORP	127,000	20.06	2,547,620.00
VISTRA CORP	80,000	24.13	1,930,400.00
CERNER CORP	56,900	93.67	5,329,823.00
TELADOC HEALTH INC	27,600	30.52	842,352.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	26,500	166.12	4,402,180.00
10X GENOMICS INC-CLASS A	14,400	47.40	682,560.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	58,100	113.11	6,571,691.00
AVANTOR INC	105,000	29.37	3,083,850.00
BIO TECHNE CORP	7,500	347.06	2,602,950.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	4,300	479.05	2,059,915.00
CHARLES RIVER LABORATORIES	9,600	228.85	2,196,960.00
DANAHER CORP	122,500	239.37	29,322,825.00
ILLUMINA INC	28,000	220.68	6,179,040.00
IQVIA HOLDINGS INC	36,700	204.07	7,489,369.00
METTLER-TOLEDO INTL	4,380	1,196.07	5,238,786.60
PERKINELMER INC	21,200	142.45	3,019,940.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	75,050	517.39	38,830,119.50
	11,900	316.29	3,763,851.00

WATERS CORP			
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	14,000	296.82	4,155,480.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	24,800	81.40	2,018,720.00
CLARIVATE PLC	65,000	14.49	941,850.00
COSTAR GROUP INC	75,700	58.06	4,395,142.00
EQUIFAX INC	23,300	199.63	4,651,379.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	24,500	130.26	3,191,370.00
LEIDOS HOLDINGS INC	25,800	99.38	2,564,004.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	20,300	95.18	1,932,154.00
TRUNSON	37,400	82.51	3,085,874.00
VERISK ANALYTICS INC	29,600	177.98	5,268,208.00
CBRE GROUP INC	64,700	79.51	5,144,297.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	220,000	4.72	1,038,400.00
ZILLOW GROUP INC - A	9,800	36.52	357,896.00
ZILLOW GROUP INC - C	33,200	37.18	1,234,376.00
CABLE ONE INC	980	1,113.64	1,091,367.20
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	24,100	463.67	11,174,447.00
COMCAST CORP-CL A	868,100	39.76	34,515,656.00
DISH NETWORK CORP-A	43,400	21.30	924,420.00
FOX CORP-CLASS A	62,000	33.21	2,059,020.00
FOX CORP-CLASS B	30,000	30.57	917,100.00
INTERPUBLIC GROUP	73,000	32.47	2,370,310.00
LIBERTY BROADBAND CORP-A	4,000	109.99	439,960.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	26,400	114.76	3,029,664.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	29,900	38.46	1,149,954.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	17,000	38.62	656,540.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	75,000	17.50	1,312,500.00
OMNICOM GROUP	40,000	77.37	3,094,800.00
PARAMOUNT GLOBAL	114,000	27.44	3,128,160.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	175,000	6.05	1,058,750.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	147,500	77.17	11,382,575.00
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	91,000	12.52	1,139,320.00
DISNEY (WALT) CO	346,200	106.98	37,036,476.00
ELECTRONIC ARTS	53,200	112.04	5,960,528.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	37,100	55.59	2,062,389.00
	30,900	85.37	2,637,933.00



	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN				
	NETFLIX INC	84,800	173.10	14,678,880.00	
	ROKU INC	22,000	87.77	1,930,940.00	
	SEA LTD-ADR	60,300	64.62	3,896,586.00	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	21,900	106.15	2,324,685.00	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	428,000	17.10	7,318,800.00	
	ALPHABET INC-CL A	57,290	2,250.22	128,915,103.80	
	ALPHABET INC-CL C	54,460	2,261.68	123,171,092.80	
	IAC/INTERACTIVECORP	15,000	72.63	1,089,450.00	
	MATCH GROUP INC	50,900	70.71	3,599,139.00	
	META PLATFORMS INC	450,700	196.21	88,431,847.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	103,000	21.08	2,171,240.00	
	SNAP INC-A	204,000	23.39	4,771,560.00	
	TWITTER INC	153,800	47.96	7,376,248.00	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	54,100	42.34	2,290,594.00	
小計	銘柄数：605			6,584,679,592.35	
				(856,205,887,393)	
	組入時価比率：70.7%			73.4%	
カナダドル	CAMECO CORP	79,000	27.33	2,159,070.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	225,300	76.16	17,158,848.00	
	CENOVUS ENERGY INC	252,000	24.36	6,138,720.00	
	ENBRIDGE INC	388,000	56.45	21,902,600.00	
	IMPERIAL OIL	46,000	63.39	2,915,940.00	
	KEYERA CORP	41,000	31.53	1,292,730.00	
	PARKLAND CORP	28,000	34.09	954,520.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	107,000	49.18	5,262,260.00	
	SUNCOR ENERGY INC	280,000	45.28	12,678,400.00	
	TC ENERGY CORP	186,000	69.67	12,958,620.00	
	TOURMALINE OIL CORP	61,000	68.75	4,193,750.00	
	NUTRIEN LTD	108,200	120.85	13,075,970.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	28,200	54.69	1,542,258.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	86,800	70.33	6,104,644.00	
	BARRICK GOLD	336,000	27.93	9,384,480.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	111,000	31.24	3,467,640.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	36,500	184.09	6,719,285.00	

IVANHOE MINES LTD-CL A	122,000	9.18	1,119,960.00	
KINROSS GOLD CORP	250,000	5.93	1,482,500.00	
LUNDIN MINING CORP	118,000	10.47	1,235,460.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	43,000	29.06	1,249,580.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	92,000	47.64	4,382,880.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	85,000	55.31	4,701,350.00	
WEST FRASER TIMBER	17,800	117.31	2,088,118.00	
CAE INC	60,000	29.06	1,743,600.00	
WSP GLOBAL INC	22,800	138.50	3,157,800.00	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	37,000	8.97	331,890.00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	15,000	107.84	1,617,600.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	30,000	36.54	1,096,200.00	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	21,100	66.31	1,399,141.00	
AIR CANADA	32,000	20.63	660,160.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	135,400	144.31	19,539,574.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	175,900	89.99	15,829,241.00	
TFI INTERNATIONAL INC	14,900	104.19	1,552,431.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	55,700	74.95	4,174,715.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	37,000	38.87	1,438,190.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	52,400	66.11	3,464,164.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	11,500	170.04	1,955,460.00	
DOLLARAMA INC	55,600	70.17	3,901,452.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	161,000	54.92	8,842,120.00	
EMPIRE CO LTD A	32,000	42.36	1,355,520.00	
LOBLAW COMPANIES	31,400	116.18	3,648,052.00	
METRO INC	46,700	69.14	3,228,838.00	
WESTON(GEORGE)LTD	14,100	158.84	2,239,644.00	
SAPUTO INC	50,000	26.04	1,302,000.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	58,000	16.78	973,240.00	
CANOPY GROWTH CORP	35,000	7.23	253,050.00	
BANK OF MONTREAL	123,900	132.49	16,415,511.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	232,600	81.40	18,933,640.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	86,400	139.31	12,036,384.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	63,400	89.40	5,667,960.00	

ROYAL BANK OF CANADA	271,400	127.73	34,665,922.00
TORONTO DOMINION BANK	347,100	92.49	32,103,279.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,640	667.79	3,098,545.60
GREAT-WEST LIFECO INC	50,000	33.74	1,687,000.00
IA FINANCIAL CORP INC	21,100	66.42	1,401,462.00
INTACT FINANCIAL CORP	32,900	177.31	5,833,499.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	370,000	24.53	9,076,100.00
POWER CORPORATION OF CANADA	109,000	36.46	3,974,140.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	110,800	64.10	7,102,280.00
CGI INC	42,100	102.59	4,319,039.00
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	14,000	58.22	815,080.00
SHOPIFY INC - CLASS A	21,800	442.39	9,644,102.00
BLACKBERRY LTD	94,000	6.67	626,980.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,810	1,922.75	7,325,677.50
LIGHTSPEED COMMERCE INC	19,400	23.51	456,094.00
OPEN TEXT CORP	51,000	47.96	2,445,960.00
BCE INC	14,400	69.97	1,007,568.00
TELUS CORP	78,600	31.81	2,500,266.00
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	67,000	64.19	4,300,730.00
EMERA INC	51,000	63.00	3,213,000.00
FORTIS INC	89,000	63.96	5,692,440.00
HYDRO ONE LTD	63,000	35.59	2,242,170.00
ALTAGAS LTD	52,000	28.40	1,476,800.00
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	126,000	17.66	2,225,160.00
CANADIAN UTILITIES LTD A	27,000	39.57	1,068,390.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	267,100	60.27	16,098,117.00
IGM FINANCIAL INC	15,000	36.48	547,200.00
ONEX CORPORATION	13,200	71.94	949,608.00
TMX GROUP LTD	11,300	132.32	1,495,216.00
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	24,000	45.35	1,088,400.00
NORTHLAND POWER INC	46,000	38.46	1,769,160.00
THOMSON REUTERS CORP	32,600	122.57	3,995,782.00
FIRSTSERVICE CORP	7,200	155.63	1,120,536.00
QUEBECOR INC-CL B	34,000	28.57	971,380.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	84,000	34.87	2,929,080.00

小計	銘柄数：86			460,193,323.10	
				(45,964,109,111)	
	組入時価比率：3.8%			3.9%	
ユーロ	TENARIS SA	88,000	13.98	1,230,240.00	
	ENI SPA	486,000	13.07	6,355,908.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	96,000	10.25	984,000.00	
	NESTE OYJ	82,000	38.93	3,192,260.00	
	OMV AG	28,100	45.51	1,278,831.00	
	REPSOL SA	274,000	13.57	3,718,180.00	
	TOTALENERGIES SE	477,700	48.13	22,994,089.50	
	AIR LIQUIDE SA	89,700	156.86	14,070,342.00	
	AKZO NOBEL	36,600	79.20	2,898,720.00	
	ARKEMA	11,600	111.70	1,295,720.00	
	BASF SE	176,500	47.08	8,309,620.00	
	COVESTRO AG	38,000	37.54	1,426,520.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	39,000	24.70	963,300.00	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	15,000	27.90	418,500.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	33,300	142.00	4,728,600.00	
	LANXESS	15,500	34.24	530,720.00	
	SOLVAY SA	14,200	90.24	1,281,408.00	
	SYMRISE AG	25,500	98.40	2,509,200.00	
	UMICORE	39,000	38.40	1,497,600.00	
	CRH PLC	146,000	36.27	5,296,150.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	27,400	53.74	1,472,476.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	46,200	37.78	1,745,436.00	
	ARCELORMITTAL	119,000	25.95	3,088,050.00	
	VOESTALPINE AG	20,000	23.34	466,800.00	
	STORA ENSO OYJ-R	108,000	17.47	1,886,760.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	102,000	31.22	3,184,440.00	
	AIRBUS SE	113,000	103.72	11,720,360.00	
	DASSAULT AVIATION SA	5,000	155.60	778,000.00	
	MTU AERO ENGINES AG	10,100	179.30	1,810,930.00	
	SAFRAN SA	64,400	92.28	5,942,832.00	
	THALES SA	20,600	118.20	2,434,920.00	
	COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	97,700	51.80	5,060,860.00	
	KINGSPAN GROUP PLC	29,900	76.90	2,299,310.00	

ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	46,168	23.64	1,091,411.52
BOUYGUES	46,000	30.63	1,408,980.00
EIFFAGE SA	15,900	92.70	1,473,930.00
FERROVIAL SA	95,000	22.98	2,183,100.00
VINCI	103,400	89.34	9,237,756.00
LEGRAND SA	51,200	78.02	3,994,624.00
PRYSMIAN SPA	48,000	28.06	1,346,880.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	102,300	121.90	12,470,370.00
SIEMENS ENERGY AG	73,000	16.68	1,217,640.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	45,000	13.08	588,825.00
SIEMENS AG	146,300	111.70	16,341,710.00
ALSTOM	61,000	22.76	1,388,360.00
CNH INDUSTRIAL NV	193,000	12.90	2,489,700.00
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	75,900	25.76	1,955,184.00
GEA GROUP AG	29,000	33.92	983,680.00
KION GROUP AG	13,100	46.74	612,294.00
KNORR-BREMSE AG	12,700	66.66	846,582.00
KONE OYJ	63,500	42.32	2,687,320.00
RATIONAL AG	1,050	509.50	534,975.00
WARTSILA OYJ	82,000	7.02	575,640.00
BRENNTAG SE	29,000	65.82	1,908,780.00
IMCD NV	10,200	125.25	1,277,550.00
DEUTSCHE POST AG-REG	191,000	36.26	6,925,660.00
INPOST SA	34,000	5.66	192,576.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	112,000	6.76	758,016.00
ADP	6,100	130.95	798,795.00
AENA SME SA	14,400	129.55	1,865,520.00
ATLANTIA SPA	98,000	22.89	2,243,220.00
GETLINK	83,000	17.17	1,425,110.00
CONTINENTAL AG	20,600	60.42	1,244,652.00
FAURECIA	20,688	19.55	404,553.84
MICHELIN (CGDE)	32,900	113.60	3,737,440.00
VALEO SA	44,000	16.84	740,960.00
BAYER MOTOREN WERK	64,000	77.62	4,967,680.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,200	70.40	718,080.00

FERRARI NV	24,100	182.00	4,386,200.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	164,200	60.56	9,943,952.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	29,400	74.56	2,192,064.00
RENAULT SA	33,700	22.45	756,733.50
STELLANTIS NV	384,000	12.70	4,876,800.00
VOLKSWAGEN AG	5,800	190.80	1,106,640.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	35,800	142.72	5,109,376.00
SEB SA	5,400	105.30	568,620.00
ADIDAS AG	36,200	173.54	6,282,148.00
ESSILORLUXOTTICA	55,200	151.85	8,382,120.00
HERMES INTERNATIONAL	5,970	1,015.00	6,059,550.00
KERING SA	14,110	442.45	6,242,969.50
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	52,870	542.60	28,687,262.00
MONCLER SPA	37,600	41.83	1,572,808.00
PUMA SE	21,200	63.30	1,341,960.00
ACCOR SA	32,000	28.91	925,120.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	31,100	93.02	2,892,922.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	20,000	32.04	640,800.00
SODEXO	15,900	67.50	1,073,250.00
DELIVERY HERO SE	29,000	25.64	743,560.00
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	32,900	18.57	611,216.20
PROSUS NV	179,000	40.06	7,171,635.00
ZALANDO SE	40,200	31.90	1,282,380.00
INDITEX SA	209,000	20.07	4,194,630.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	119,000	20.60	2,451,400.00
COLRUYT SA	8,700	34.26	298,062.00
HELLOFRESH SE	31,800	34.48	1,096,464.00
JERONIMO MARTINS	55,000	19.20	1,056,000.00
KESKO OYJ-B SHS	50,000	23.77	1,188,500.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	199,000	27.66	5,504,340.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	166,800	50.92	8,493,456.00
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	91,000	9.56	870,142.00
HEINEKEN HOLDING NV	22,000	70.95	1,560,900.00
HEINEKEN NV	49,600	90.18	4,472,928.00
PERNOD RICARD SA	40,300	176.20	7,100,860.00

REMY COINTREAU	3,900	164.20	640,380.00
DANONE	124,400	55.89	6,952,716.00
JDE PEET'S BV	21,000	27.52	577,920.00
KERRY GROUP PLC-A	31,000	95.22	2,951,820.00
HENKEL AG & CO KGAA	20,300	60.35	1,225,105.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	33,200	61.42	2,039,144.00
BEIERSDORF AG	19,800	89.04	1,762,992.00
LOREAL-ORD	48,000	304.40	14,611,200.00
BIOMERIEUX	6,900	88.38	609,822.00
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	7,200	105.45	759,240.00
DIASORIN SPA	4,800	114.15	547,920.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	174,000	23.44	4,079,430.00
SARTORIUS AG-VORZUG	5,100	314.90	1,605,990.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	53,900	49.70	2,678,830.00
AMPLIFON SPA	24,000	33.59	806,160.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	39,900	57.56	2,296,644.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	78,000	34.03	2,654,340.00
ORPEA	9,300	30.79	286,347.00
ARGENX SE	9,000	277.60	2,498,400.00
GRIFOLS SA	54,000	17.35	936,900.00
BAYER AG-REG	186,300	58.72	10,939,536.00
EUROAPI SASU	9,339	13.80	128,896.87
IPSEN	7,300	92.35	674,155.00
MERCK KGAA	24,300	163.45	3,971,835.00
ORION OYJ	21,000	35.22	739,620.00
RECORDATI SPA	19,900	41.44	824,656.00
SANOFI	216,600	96.46	20,893,236.00
UCB SA	24,500	99.46	2,436,770.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	82,000	10.97	899,950.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,286,000	4.57	5,888,594.00
BANCO SANTANDER SA	3,330,000	2.60	8,658,000.00
BNP PARIBAS	215,700	49.85	10,752,645.00
CAIXABANK	830,000	2.93	2,436,050.00
COMMERZBANK AG	188,000	6.04	1,137,024.00
CREDIT AGRICOLE SA	226,000	9.90	2,237,400.00

ERSTE GROUP BANK AG	65,000	27.58	1,792,700.00
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	111,000	11.74	1,303,695.00
ING GROEP NV	752,000	8.70	6,543,904.00
INTESA SANPAOLO	3,180,000	1.83	5,819,400.00
KBC GROEP NV	46,000	61.78	2,841,880.00
MEDIOBANCA S.P.A.	124,000	9.62	1,192,880.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	29,000	10.84	314,360.00
SOCIETE GENERALE	151,000	22.00	3,322,000.00
UNICREDIT SPA	406,000	8.02	3,256,526.00
EURAZEO SE	7,800	66.40	517,920.00
EXOR NV	19,500	61.68	1,202,760.00
GROUPE BRUXELLES LAM	21,400	82.44	1,764,216.00
SOFINA SA	2,900	269.40	781,260.00
WENDEL	4,300	86.00	369,800.00
AEGON NV	329,000	4.73	1,559,131.00
AGEAS	32,000	43.31	1,385,920.00
ALLIANZ SE-REG	78,200	191.66	14,987,812.00
ASSICURAZIONI GENERALI	208,000	17.44	3,627,520.00
AXA SA	374,000	22.24	8,317,760.00
CNP ASSURANCES	36,000	20.90	752,400.00
HANNOVER RUECK SE	12,000	137.20	1,646,400.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	26,700	213.70	5,705,790.00
NN GROUP NV	49,400	45.24	2,234,856.00
POSTE ITALIANE SPA	103,000	8.76	903,104.00
SAMPO OYJ-A SHS	95,000	43.21	4,104,950.00
ADYEN NV	3,830	1,403.40	5,375,022.00
AMADEUS IT GROUP SA	86,100	58.28	5,017,908.00
BECHTLE AG	15,700	39.79	624,703.00
CAPGEMINI SA	30,900	177.75	5,492,475.00
EDENRED	47,000	44.45	2,089,150.00
NEXI SPA	104,000	9.24	960,960.00
WORLDLINE SA	44,800	35.65	1,597,120.00
DASSAULT SYSTEMES SE	125,000	37.74	4,717,500.00
NEMETSCHEK SE	11,000	61.74	679,140.00
SAP SE	198,900	90.77	18,054,153.00



NOKIA OYJ	1,042,000	4.55	4,750,999.00
ASM INTERNATIONAL NV	9,000	259.50	2,335,500.00
ASML HOLDING NV	78,720	486.75	38,316,960.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	251,000	25.64	6,436,895.00
STMICROELECTRONICS NV	128,000	33.40	4,275,200.00
CELLNEX TELECOM SA	99,000	40.16	3,975,840.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	615,000	17.14	10,542,330.00
ELISA OYJ	28,400	53.60	1,522,240.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	55,000	9.89	544,060.00
KONINKLIJKE KPN NV	660,000	3.31	2,188,560.00
ORANGE SA	382,000	11.64	4,447,244.00
PROXIMUS	26,000	16.42	426,920.00
TELECOM ITALIA SPA	1,930,000	0.25	490,606.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	210,000	2.85	598,920.00
TELEFONICA SA	990,000	4.63	4,584,690.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	30.38	510,384.00
ELECTRICITE DE FRANCE	113,000	8.05	910,328.00
ELIA GROUP SA/NV	6,200	144.70	897,140.00
ENDESA S.A.	57,000	19.29	1,099,530.00
ENEL SPA	1,561,000	5.87	9,167,753.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	509,000	4.34	2,210,078.00
FORTUM OYJ	89,000	14.99	1,334,110.00
IBERDROLA SA	1,116,000	10.61	11,840,760.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	79,000	18.75	1,481,645.00
TERNA SPA	275,000	7.45	2,049,850.00
VERBUND AG	12,700	82.60	1,049,020.00
ENAGAS SA	48,000	20.48	983,040.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	34,000	27.70	941,800.00
SNAM SPA	384,000	5.11	1,962,240.00
E.ON SE	425,000	9.76	4,148,850.00
ENGIE	354,000	11.00	3,896,124.00
RWE AG	124,000	40.03	4,963,720.00
VEOLIA ENVIRONNEMENT	125,000	25.27	3,158,750.00
AMUNDI SA	12,800	53.35	682,880.00
DEUTSCHE BANK AG-REG	387,000	8.95	3,465,972.00

	DEUTSCHE BOERSE AG	35,900	158.65	5,695,535.00	
	EURONEXT NV	15,300	70.62	1,080,486.00	
	EDP RENOVAVEIS SA	58,000	20.07	1,164,060.00	
	UNIPER SE	15,100	21.44	323,744.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	25,500	84.80	2,162,400.00	
	QIAGEN N.V.	44,000	42.87	1,886,280.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,950	286.50	1,418,175.00	
	BUREAU VERITAS SA	54,000	25.46	1,374,840.00	
	RANDSTAD NV	21,400	47.75	1,021,850.00	
	TELEPERFORMANCE	11,300	304.70	3,443,110.00	
	WOLTERS KLUWER	50,300	93.32	4,693,996.00	
	AROUNDTOWN SA	206,000	4.44	915,464.00	
	LEG IMMOBILIEN SE	14,000	92.18	1,290,520.00	
	VONOVIA SE	139,200	32.71	4,553,232.00	
	PUBLICIS GROUPE	43,300	52.60	2,277,580.00	
	VIVENDI SE	145,000	10.85	1,573,975.00	
	BOLLORE SE	168,000	4.55	764,400.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	17,300	44.01	761,373.00	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	135,000	19.75	2,667,330.00	
	SCOUT24 SE	15,200	58.08	882,816.00	
小計	銘柄数：228			786,785,251.93	
				(108,002,011,532)	
	組入時価比率：8.9%			9.3%	
英ポンド	BP PLC	3,761,000	4.04	15,224,528.00	
	SHELL PLC-NEW	1,466,000	22.25	32,618,500.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	26,300	66.92	1,759,996.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	34,800	22.78	792,744.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	242,300	33.00	7,995,900.00	
	ANTOFAGASTA PLC	79,000	13.62	1,075,980.00	
	GLENCORE PLC	1,902,000	4.58	8,721,621.00	
	RIO TINTO PLC-REG	215,100	51.88	11,159,388.00	
	MONDI PLC	91,000	15.62	1,421,420.00	
	BAE SYSTEMS PLC	599,000	7.44	4,457,758.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,520,000	0.78	1,193,200.00	
	DCC PLC	18,400	60.46	1,112,464.00	

MELROSE INDUSTRIES PLC	870,000	1.07	936,120.00
SMITHS GROUP PLC	71,000	14.48	1,028,435.00
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	14,100	108.55	1,530,555.00
ASHTED GROUP PLC	86,500	38.00	3,287,000.00
BUNZLE	66,000	29.90	1,973,400.00
FERGUSON PLC	41,800	91.10	3,807,980.00
RENTOKIL INTIAL PLC	345,000	5.17	1,784,340.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	207,000	4.59	950,337.00
PERSIMMON PLC	58,000	20.32	1,178,560.00
TAYLOR WIMPEY PLC	710,000	1.20	853,775.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	20,871	38.57	804,994.47
BURBERRY GROUP PLC	73,000	14.89	1,087,335.00
COMPASS GROUP PLC	343,000	15.76	5,407,395.00
ENTAIN PLC	110,000	12.48	1,373,350.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	35,400	47.41	1,678,314.00
WHITBREAD PLC	36,300	25.61	929,643.00
NEXT PLC	26,000	59.04	1,535,040.00
JD SPORTS FASHION PLC	465,000	1.17	546,607.50
KINGFISHER PLC	390,000	2.42	943,800.00
OCADO GROUP PLC	92,000	7.83	720,728.00
SAINSBURY	340,000	2.33	792,200.00
TESCO PLC	1,470,000	2.75	4,049,850.00
COCA-COLA HBC AG-DI	39,000	15.67	611,130.00
DIAGEO PLC	444,000	37.27	16,550,100.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	68,000	15.60	1,060,800.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	417,000	33.02	13,769,340.00
IMPERIAL BRANDS PLC	180,000	16.52	2,974,500.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	135,500	63.20	8,563,600.00
UNILEVER PLC	489,600	36.36	17,801,856.00
SMITH & NEPHEW PLC	170,000	12.51	2,126,700.00
NMC HEALTH PLC	13,300	0.00	53.20
ASTRAZENECA PLC	295,080	101.40	29,921,112.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	958,000	17.36	16,638,544.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	29,600	16.97	502,312.00
BARCLAYS PLC	3,190,000	1.45	4,656,762.00

HSBC HOLDINGS PLC	3,875,000	4.92	19,092,125.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	13,660,000	0.42	5,784,327.00	
NATWEST GROUP PLC	1,070,000	2.04	2,183,870.00	
STANDARD CHARTERED PLC	509,000	5.47	2,784,230.00	
M&G PLC	500,000	2.06	1,030,000.00	
ADMIRAL GROUP PLC	35,000	23.00	805,000.00	
AVIVA PLC	712,000	4.02	2,862,952.00	
LEGAL & GENERAL	1,140,000	2.35	2,681,280.00	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	122,000	5.71	696,864.00	
PRUDENTIAL PLC	518,000	8.81	4,563,580.00	
AVEVA GROUP PLC	26,000	20.77	540,020.00	
SAGE GROUP PLC (THE)	197,000	6.69	1,317,930.00	
HALMA PLC	70,000	21.92	1,534,400.00	
BT GROUP PLC	1,700,000	1.73	2,950,350.00	
VODAFONE GROUP PLC	5,250,000	1.18	6,232,800.00	
SSE PLC	204,000	18.04	3,681,180.00	
NATIONAL GRID PLC	694,000	11.79	8,182,260.00	
SEVERN TRENT PLC	48,000	29.58	1,419,840.00	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	135,000	10.78	1,455,300.00	
3I GROUP PLC	190,000	12.35	2,346,500.00	
ABRDN PLC	420,000	1.79	752,010.00	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	65,000	8.54	555,100.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	62,700	70.50	4,420,350.00	
SCHRODERS PLC	24,000	27.52	660,480.00	
ST JAMES S PLACE PLC	104,000	11.81	1,228,760.00	
EXPERIAN PLC	178,000	26.30	4,681,400.00	
INTERTEK GROUP PLC	31,000	48.96	1,517,760.00	
RELX PLC	371,000	22.99	8,529,290.00	
INFORMA PLC	275,000	5.43	1,494,900.00	
PEARSON	148,000	7.57	1,121,248.00	
WPP PLC	218,000	9.52	2,075,796.00	
AUTO TRADER GROUP PLC	171,000	5.60	958,284.00	
小計銘柄数：79			340,050,253.17	
			(54,533,859,100)	
組入時価比率：4.5%				4.7%

スイスフラン	CLARIANT AG-REG	41,000	16.78	687,980.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,370	800.00	1,096,000.00	
	GIVAUDAN-REG	1,740	3,457.00	6,015,180.00	
	SIKA AG-REG	27,000	258.60	6,982,200.00	
	HOLCIM LTD	101,300	44.92	4,550,396.00	
	GEBERIT AG-REG	6,880	498.20	3,427,616.00	
	ABB LTD	315,000	27.86	8,775,900.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,700	177.40	656,380.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,400	178.40	1,320,160.00	
	VAT GROUP AG	5,300	261.60	1,386,480.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	10,100	243.90	2,463,390.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	98,900	100.65	9,954,285.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	5,500	228.70	1,257,850.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10,500	43.82	460,110.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	710	2,170.00	1,540,700.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	195	9,750.00	1,901,250.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	20	102,400.00	2,048,000.00	
	NESTLE SA-REG	536,100	120.38	64,535,718.00	
	ALCON INC	95,100	65.10	6,191,010.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	10,300	322.20	3,318,660.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	19,000	103.75	1,971,250.00	
	NOVARTIS AG-REG	417,300	83.38	34,794,474.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	133,800	346.00	46,294,800.00	
	ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	6,300	374.20	2,357,460.00	
	VIFOR PHARMA AG/NEW	9,100	176.50	1,606,150.00	
	BALOISE HOLDING AG	8,600	157.50	1,354,500.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	6,010	532.80	3,202,128.00	
	SWISS RE LTD	57,100	77.96	4,451,516.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	28,500	436.80	12,448,800.00	
	TEMENOS AG-REG	12,000	95.72	1,148,640.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	34,200	57.20	1,956,240.00	
	SWISSCOM AG-REG	4,850	575.20	2,789,720.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	504,000	6.27	3,163,104.00		
JULIUS BAER GROUP LTD	42,200	45.52	1,920,944.00		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	4,290	987.20	4,235,088.00		

	UBS GROUP AG	674,000	16.36	11,026,640.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	5,500	68.15	374,825.00	
	LONZA AG-REG	14,320	519.60	7,440,672.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	33,000	33.88	1,118,040.00	
	SGS SA-REG	1,140	2,372.00	2,704,080.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	15,300	93.40	1,429,020.00	
小計	銘柄数：41			276,357,356.00	
				(36,194,522,915)	
	組入時価比率：3.0%				3.1%
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	37,000	409.80	15,162,600.00	
	BOLIDEN AB	53,000	372.80	19,758,400.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	112,000	174.95	19,594,400.00	
	ASSA ABLOY AB-B	190,000	228.30	43,377,000.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	273,000	81.42	22,227,660.00	
	SKANSKA AB-B SHS	66,000	162.00	10,692,000.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	26,000	216.70	5,634,200.00	
	LIFCO AB-B SHS	42,000	178.70	7,505,400.00	
	ALFA LAVAL AB	57,000	248.40	14,158,800.00	
	ATLAS COPCO AB-A	126,900	421.20	53,450,280.00	
	ATLAS COPCO AB-B	73,100	364.90	26,674,190.00	
	EPIROC AB - A	129,000	175.15	22,594,350.00	
	EPIROC AB - B	79,000	150.80	11,913,200.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	73,000	85.42	6,235,660.00	
	SANDVIK AB	219,000	176.15	38,576,850.00	
	SKF AB-B SHARES	78,000	161.35	12,585,300.00	
	VOLVO AB-A SHS	40,000	157.20	6,288,000.00	
	VOLVO AB-B SHS	269,000	153.06	41,173,140.00	
	SECURITAS AB-B SHS	54,000	99.76	5,387,040.00	
	ELECTROLUX AB-B	41,000	148.90	6,104,900.00	
	EVOLUTION AB	32,900	908.90	29,902,810.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	133,000	118.68	15,784,440.00	
	SWEDISH MATCH AB	308,000	76.06	23,426,480.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	116,000	254.40	29,510,400.00	
	GETINGE AB-B SHS	45,000	282.70	12,721,500.00	
	NORDEA BANK ABP	607,000	93.23	56,590,610.00	

	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	314,000	104.30	32,750,200.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	283,000	95.74	27,094,420.00	
	SWEDBANK AB	170,000	146.75	24,947,500.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	24,092	236.30	5,692,939.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	32,000	233.90	7,484,800.00	
	INVESTOR AB-A SHS	96,000	180.85	17,361,600.00	
	INVESTOR AB-B SHS	344,000	168.46	57,950,240.00	
	KINNEVIK AB - B	44,000	160.75	7,073,000.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	15,500	425.40	6,593,700.00	
	SINCH AB	92,000	39.15	3,602,260.00	
	ERICSSON LM-B	547,000	76.19	41,675,930.00	
	HEXAGON AB-B SHS	377,000	112.15	42,280,550.00	
	TELIA CO AB	530,000	39.73	21,056,900.00	
	TELE 2 AB-B SHS	92,000	129.10	11,877,200.00	
	EQT AB	59,000	235.20	13,876,800.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	18,700	402.90	7,534,230.00	
	SAGAX AB-B	29,000	203.40	5,898,600.00	
	EMBRACER GROUP AB	110,000	66.93	7,362,300.00	
小計	銘柄数：44			899,142,779.60	
				(11,571,967,573)	
	組入時価比率：1.0%			1.0%	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	22,000	343.00	7,546,000.00	
	EQUINOR ASA	185,000	321.85	59,542,250.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	33,100	465.80	15,417,980.00	
	NORSK HYDRO	266,000	69.64	18,524,240.00	
	MOWI ASA	84,000	245.10	20,588,400.00	
	ORKLA ASA	153,000	75.32	11,523,960.00	
	DNB BANK ASA	174,000	176.75	30,754,500.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	40,000	192.30	7,692,000.00	
	TELENOR ASA	129,000	127.40	16,434,600.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	18,100	152.00	2,751,200.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	14,400	169.10	2,435,040.00	
	ADEVINTA ASA	63,000	56.30	3,546,900.00	
小計	銘柄数：12			196,757,070.00	
				(2,636,544,738)	

		組入時価比率：0.2%		0.2%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S		20,400	514.00	10,485,600.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES		40,200	433.20	17,414,640.00
	ROCKWOOL A/S-B SHS		1,700	1,758.00	2,988,600.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S		191,000	153.68	29,352,880.00
	DSV A/S		38,800	1,039.00	40,313,200.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A		620	18,960.00	11,755,200.00
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B		1,090	19,610.00	21,374,900.00
	PANDORA A/S		20,000	515.80	10,316,000.00
	CARLSBERG B		19,300	850.80	16,420,440.00
	AMBU A/S-B		29,000	80.84	2,344,360.00
	COLOPLAST-B		22,100	850.60	18,798,260.00
	DEMANT A/S		20,100	276.80	5,563,680.00
	GN STORE NORD A/S		24,100	216.90	5,227,290.00
	GENMAB A/S		12,600	2,089.00	26,321,400.00
	NOVO NORDISK A/S-B		320,700	755.80	242,385,060.00
	DANSKE BANK AS		132,000	103.70	13,688,400.00
	TRYG A/S		68,000	154.30	10,492,400.00
	ORSTED A/S		35,100	692.80	24,317,280.00
小計	銘柄数：18				509,559,590.00 (9,401,374,435)
		組入時価比率：0.8%		0.8%	
豪ドル	AMPOL LTD		49,000	33.24	1,628,760.00
	SANTOS LTD.		610,000	8.08	4,928,800.00
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		38,000	27.14	1,031,320.00
	WOODSIDE PETROLEUM		185,000	31.58	5,842,300.00
	ORICA LTD		79,000	15.83	1,250,570.00
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC		85,000	38.47	3,269,950.00
	BHP GROUP LIMITED		964,000	46.21	44,546,440.00
	BLUESCOPE STEEL LTD		90,000	18.11	1,629,900.00
	EVOLUTION MINING LTD		340,000	3.67	1,247,800.00
	FORTESCUE METALS GROUP LTD		328,000	19.63	6,438,640.00
	MINERAL RESOURCES LTD		34,000	53.73	1,826,820.00
	NEWCREST MINING		164,000	26.01	4,265,640.00
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD		222,000	9.06	2,011,320.00



RIO TINTO LTD	70,200	106.80	7,497,360.00	
SOUTH32 LTD	870,000	4.63	4,028,100.00	
REECE LTD	49,000	16.51	808,990.00	
BRAMBLES LTD	270,000	10.47	2,826,900.00	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	170,000	5.38	914,600.00	
AURIZON HOLDINGS LTD	380,000	4.01	1,523,800.00	
TRANSURBAN GROUP	586,000	14.15	8,291,900.00	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	110,000	31.38	3,451,800.00	
CROWN RESORTS LTD	77,000	12.85	989,450.00	
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	10,300	67.60	696,280.00	
TABCORP HOLDINGS	420,000	5.10	2,142,000.00	
WESFARMERS LIMITED	218,000	49.06	10,695,080.00	
COLES GROUP LTD	260,000	18.79	4,885,400.00	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	253,000	7.65	1,935,450.00	
WOOLWORTHS GROUP LTD	233,000	38.36	8,937,880.00	
TREASURY WINE ESTATES LTD	135,000	11.15	1,505,250.00	
COCHLEAR LTD	12,800	216.48	2,770,944.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	33,000	78.75	2,598,750.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	84,000	35.61	2,991,240.00	
CSL LIMITED	91,600	270.40	24,768,640.00	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	541,000	26.03	14,082,230.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	325,000	102.66	33,364,500.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	619,000	31.68	19,609,920.00	
WESTPAC BANKING CORP	695,000	24.60	17,097,000.00	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	480,000	4.62	2,217,600.00	
MEDIBANK PRIVATE LTD	520,000	3.22	1,674,400.00	
QBE INSURANCE	290,000	12.42	3,601,800.00	
SUNCORP GROUP LTD	245,000	11.28	2,763,600.00	
COMPUTERSHARE LTD	101,000	24.15	2,439,150.00	
WISETECH GLOBAL LTD	28,000	39.33	1,101,240.00	
XERO LIMITED	25,500	84.34	2,150,670.00	
TELSTRA CORP LTD	790,000	3.98	3,144,200.00	
ORIGIN ENERGY LTD	330,000	6.94	2,290,200.00	
APA GROUP	229,000	11.11	2,544,190.00	
ASX LTD	37,800	83.51	3,156,678.00	

	MACQUARIE GROUP LIMITED	65,100	182.00	11,848,200.00	
	IDP EDUCATION LTD	37,000	24.29	898,730.00	
	REA GROUP LTD	10,400	107.28	1,115,712.00	
	SEEK LTD	60,000	24.60	1,476,000.00	
小計	銘柄数：52			300,754,094.00	
				(27,088,921,246)	
	組入時価比率：2.2%			2.3%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	223,000	7.36	1,641,280.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	109,000	21.50	2,343,500.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	74,000	8.31	614,940.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	380,000	4.86	1,848,700.00	
	MERCURY NZ LTD	137,000	5.65	774,050.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	250,000	4.57	1,142,500.00	
小計	銘柄数：6			8,364,970.00	
				(684,589,144)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	330,000	17.48	5,768,400.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	509,040	55.05	28,022,652.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	262,000	94.65	24,798,300.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	280,000	26.90	7,532,000.00	
	MTR CORP	307,000	42.75	13,124,250.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	409,000	43.10	17,627,900.00	
	SANDS CHINA LTD	432,000	16.50	7,128,000.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	410,000	12.50	5,125,000.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	350,000	19.40	6,790,000.00	
	WH GROUP LIMITED	1,538,306	5.32	8,183,787.92	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	720,000	29.70	21,384,000.00	
	HANG SENG BANK	150,000	140.10	21,015,000.00	
	AIA GROUP LTD	2,304,000	74.00	170,496,000.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	719,600	11.28	8,117,088.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	134,000	52.75	7,068,500.00	
	CLP HLDGS	317,000	76.00	24,092,000.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	254,000	54.05	13,728,700.00	

	HONG KONG & CHINA GAS	2,070,383	8.54	17,681,070.82	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	228,000	327.60	74,692,800.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	383,040	53.70	20,569,248.00	
	ESR CAYMAN LTD	380,000	23.90	9,082,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	360,000	14.68	5,284,800.00	
	HENDERSON LAND	267,443	31.80	8,504,687.40	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	309,916	29.25	9,065,043.00	
	SINO LAND CO.LTD	620,000	10.66	6,609,200.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	250,000	92.80	23,200,000.00	
	SWIRE PACIFIC-A	104,000	44.75	4,654,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	230,000	18.96	4,360,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	311,000	36.55	11,367,050.00	
	小計 銘柄数：29			585,072,277.14	
				(9,688,796,909)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
シンガポールドル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	310,000	4.11	1,274,100.00	
	KEPPEL CORP.	280,000	6.69	1,873,200.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	240,000	5.32	1,276,800.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,130,000	0.79	892,700.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	380,000	4.29	1,630,200.00	
	DBS GROUP HLDGS	348,000	32.90	11,449,200.00	
	OCBC-ORD	649,000	11.88	7,710,120.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	228,000	29.25	6,669,000.00	
	VENTURE CORP LTD	58,000	17.50	1,015,000.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,610,000	2.75	4,427,500.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	148,000	9.53	1,410,440.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	480,000	3.92	1,881,600.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	8.09	566,300.00	
	UOL GROUP LIMITED	87,000	7.04	612,480.00	
	小計 銘柄数：14			42,688,640.00	
				(3,988,399,635)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
新シケル	ICL GROUP LTD	139,000	35.32	4,909,480.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	5,000	684.00	3,420,000.00	

	BANK HAPOLIM BM	224,000	28.96	6,487,040.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	267,000	32.64	8,714,880.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	213,000	18.69	3,980,970.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	28,000	109.00	3,052,000.00	
	NICE LTD	11,600	644.10	7,471,560.00	
	AZRIELI GROUP	8,600	256.00	2,201,600.00	
小計	銘柄数：8			40,237,530.00	
				(1,522,197,831)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計				1,167,483,181,562	
				(1,167,483,181,562)	

(注1)外貨建所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、外貨建所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(2022年5月10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	93,000	1,140,180.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,100	4,700,287.00	
		AMERICAN TOWER CORP	86,700	20,035,503.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	267,000	1,759,530.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	26,600	5,418,952.00	
		BOSTON PROPERTIES	28,600	3,260,686.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	18,800	2,695,356.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	82,700	14,503,926.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	54,000	7,202,520.00	
		DUKE REALTY CORP	74,000	3,530,540.00	
		EQUINIX INC	17,260	11,291,319.40	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	32,100	2,240,580.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	67,400	4,937,724.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,600	3,729,222.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	25,900	4,388,237.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	100,000	3,002,000.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	135,000	2,579,850.00			

	INVITATION HOMES INC	113,000	4,047,660.00	
	IRON MOUNTAIN INC	54,000	2,862,540.00	
	KIMCO REALTY CORP	115,000	2,685,250.00	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	108,000	1,933,200.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,400	3,799,356.00	
	PROLOGIS INC	140,800	18,637,696.00	
	PUBLIC STORAGE	30,300	9,504,807.00	
	REALTY INCOME CORP	106,800	6,895,008.00	
	REGENCY CENTERS CORP	28,800	1,927,872.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	20,500	6,623,550.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	63,200	7,469,608.00	
	SUN COMMUNITIES INC	22,500	3,549,825.00	
	UDR INC	59,100	2,818,479.00	
	VENTAS INC	77,400	4,305,762.00	
	VICI PROPERTIES INC	181,000	4,934,060.00	
	VORNADO REALTY TRUST	32,000	1,134,720.00	
	WELLTOWER INC	82,200	7,156,332.00	
	WEYERHAEUSER CO	143,000	5,608,460.00	
	WP CAREY INC	36,500	2,796,265.00	
小計	銘柄数：36	2,585,260	195,106,862.40	
			(25,369,745,317)	
	組入時価比率：2.1%		86.2%	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	691,211.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	28,000	611,240.00	
小計	銘柄数：2	42,900	1,302,451.00	
			(130,088,805)	
	組入時価比率：0.0%		0.4%	
ユーロ	COVIVIO	10,900	703,050.00	
	GECINA SA	8,100	818,100.00	
	KLEPIERRE	40,000	864,400.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,900	1,607,275.00	
小計	銘柄数：4	82,900	3,992,825.00	
			(548,095,087)	
	組入時価比率：0.0%		1.9%	
英ポンド	BRITISH LAND	159,000	762,405.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	132,000	922,416.00	

小計	SEGR0 PLC	231,000	2,478,630.00
	銘柄数：3	522,000	4,163,451.00 (667,692,636)
	組入時価比率：0.1%		2.3%
豪ドル	DEXUS/AU	196,000	2,107,000.00
	GOODMAN GROUP	319,000	6,112,040.00
	GPT GROUP	380,000	1,797,400.00
	LENDLEASE GROUP	135,000	1,534,950.00
	MIRVAC GROUP	750,000	1,620,000.00
	SCENTRE GROUP	1,010,000	2,747,200.00
	STOCKLAND TRUST GROUP	460,000	1,771,000.00
	VICINITY CENTRES	670,000	1,199,300.00
小計	銘柄数：8	3,920,000	18,888,890.00 (1,701,322,322)
	組入時価比率：0.1%		5.8%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	3,647,200.00
	LINK REIT	392,000	26,264,000.00
小計	銘柄数：2	862,000	29,911,200.00 (495,329,472)
	組入時価比率：0.0%		1.7%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	620,040	1,729,911.60
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	904,221	2,043,539.46
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	11,130	14,802.90
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	688,200.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	570,329	958,152.72
	小計	銘柄数：5	2,475,720
組入時価比率：0.0%			1.7%
合計			29,420,028,941 (29,420,028,941)

(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	2022年 5月10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	14,421,396,692	-	13,563,767,443	857,629,249
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	301,214,900	-	299,059,340	2,155,560
米ドル	301,214,900	-	299,059,340	2,155,560
合計	-	-	-	855,473,689

（注）時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2022年 5月10日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	161,484,035
国債証券	19,490,802,370
未収入金	50,485,500

(2022年 5月10日現在)

未収利息	40,275,594
前払費用	2,510,300
流動資産合計	19,745,557,799
資産合計	19,745,557,799
負債の部	
流動負債	
未払金	160,989,200
未払解約金	45,760,177
未払利息	61
流動負債合計	206,749,438
負債合計	206,749,438
純資産の部	
元本等	
元本	14,651,064,577
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,887,743,784
元本等合計	19,538,808,361
純資産合計	19,538,808,361
負債純資産合計	19,745,557,799

## 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。 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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 5月10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	1.3336円
(10,000口当たり純資産額)	(13,336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 2021年 5月11日

至 2022年 5月10日



## 1. 金融商品に対する取組方針

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

## 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

## 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

2022年 5月10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

2022年 5月10日現在

期首	2021年 5月11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	20,882,177,477円
同期中における追加設定元本額	5,648,045,236円
同期中における一部解約元本額	11,879,158,136円
期末元本額	14,651,064,577円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	569,708,169円
バランスセレクト50	627,011,387円
バランスセレクト70	307,023,879円
ネクストコア	177,219,328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）	471,591,932円
野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用）	905,448,424円

バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	24,878,485円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	56,337,066円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	23,110,834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)	5,023,791,633円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	177,602,830円
野村DC運用戦略ファンド	5,551,339,084円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	736,001,526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(2022年5月10日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年5月10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434回	100,000,000	100,117,000	
		国庫債券 利付(5年)第137回	300,000,000	300,693,000	
		国庫債券 利付(5年)第139回	420,000,000	421,209,600	
		国庫債券 利付(5年)第140回	370,000,000	371,132,200	
		国庫債券 利付(5年)第141回	340,000,000	341,122,000	
		国庫債券 利付(5年)第142回	150,000,000	150,547,500	
		国庫債券 利付(5年)第145回	270,000,000	271,179,900	
		国庫債券 利付(5年)第146回	250,000,000	251,127,500	
		国庫債券 利付(5年)第147回	250,000,000	250,192,500	
		国庫債券 利付(5年)第148回	160,000,000	160,097,600	
		国庫債券 利付(5年)第149回	250,000,000	250,052,500	
		国庫債券 利付(40年)第1回	80,000,000	106,738,400	
		国庫債券 利付(40年)第2回	110,000,000	142,004,500	
		国庫債券 利付(40年)第3回	70,000,000	90,672,400	
		国庫債券 利付(40年)第4回	110,000,000	142,758,000	
		国庫債券 利付(40年)第5回	110,000,000	137,504,400	
		国庫債券 利付(40年)第6回	80,000,000	98,369,600	
		国庫債券 利付(40年)第7回	70,000,000	82,637,100	
		国庫債券 利付(40年)第8回	60,000,000	66,016,800	
		国庫債券 利付(40年)第9回	40,000,000	32,689,200	
		国庫債券 利付(40年)第10回	70,000,000	66,978,100	
		国庫債券 利付(40年)第11回	30,000,000	27,756,900	
国庫債券 利付(40年)第12回	40,000,000	33,269,600			

国庫債券	利付(40年)第13回	80,000,000	66,197,600
国庫債券	利付(40年)第14回	100,000,000	88,389,000
国庫債券	利付(10年)第330回	70,000,000	70,829,500
国庫債券	利付(10年)第331回	90,000,000	90,821,700
国庫債券	利付(10年)第332回	350,000,000	353,752,000
国庫債券	利付(10年)第333回	250,000,000	253,042,500
国庫債券	利付(10年)第334回	220,000,000	222,994,200
国庫債券	利付(10年)第335回	200,000,000	202,552,000
国庫債券	利付(10年)第336回	120,000,000	121,693,200
国庫債券	利付(10年)第337回	100,000,000	100,888,000
国庫債券	利付(10年)第338回	80,000,000	81,006,400
国庫債券	利付(10年)第339回	100,000,000	101,354,000
国庫債券	利付(10年)第341回	200,000,000	202,348,000
国庫債券	利付(10年)第342回	230,000,000	231,018,900
国庫債券	利付(10年)第343回	200,000,000	200,904,000
国庫債券	利付(10年)第344回	300,000,000	301,308,000
国庫債券	利付(10年)第345回	240,000,000	241,048,800
国庫債券	利付(10年)第346回	270,000,000	271,112,400
国庫債券	利付(10年)第347回	200,000,000	200,662,000
国庫債券	利付(10年)第348回	150,000,000	150,400,500
国庫債券	利付(10年)第349回	100,000,000	100,195,000
国庫債券	利付(10年)第350回	320,000,000	320,371,200
国庫債券	利付(10年)第351回	180,000,000	180,000,000
国庫債券	利付(10年)第352回	150,000,000	149,857,500
国庫債券	利付(10年)第355回	100,000,000	99,543,000
国庫債券	利付(10年)第356回	60,000,000	59,629,200
国庫債券	利付(10年)第357回	130,000,000	129,025,000

国庫債券 利付(10年)第358回	100,000,000	99,149,000
国庫債券 利付(10年)第359回	170,000,000	168,373,100
国庫債券 利付(10年)第360回	130,000,000	128,612,900
国庫債券 利付(10年)第361回	150,000,000	148,290,000
国庫債券 利付(10年)第362回	80,000,000	79,028,000
国庫債券 利付(10年)第363回	70,000,000	69,094,900
国庫債券 利付(10年)第364回	20,000,000	19,734,400
国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	119,121,000
国庫債券 利付(30年)第3回	40,000,000	46,634,000
国庫債券 利付(30年)第6回	40,000,000	48,116,000
国庫債券 利付(30年)第7回	15,000,000	18,015,900
国庫債券 利付(30年)第8回	20,000,000	23,098,800
国庫債券 利付(30年)第9回	20,000,000	22,262,200
国庫債券 利付(30年)第10回	30,000,000	32,472,300
国庫債券 利付(30年)第11回	10,000,000	11,480,400
国庫債券 利付(30年)第12回	10,000,000	11,938,300
国庫債券 利付(30年)第13回	10,000,000	11,847,600
国庫債券 利付(30年)第14回	30,000,000	37,001,700
国庫債券 利付(30年)第15回	70,000,000	87,381,700
国庫債券 利付(30年)第16回	10,000,000	12,517,800
国庫債券 利付(30年)第17回	80,000,000	99,387,200
国庫債券 利付(30年)第18回	30,000,000	36,992,700
国庫債券 利付(30年)第19回	10,000,000	12,359,000
国庫債券 利付(30年)第20回	60,000,000	75,837,000
国庫債券 利付(30年)第21回	50,000,000	62,062,000
国庫債券 利付(30年)第22回	40,000,000	50,795,200
国庫債券 利付(30年)第23回	40,000,000	50,912,800
国庫債券 利付(30年)第24回	80,000,000	101,985,600
国庫債券 利付(30年)第25回	30,000,000	37,480,200
国庫債券 利付(30年)第26回	80,000,000	101,231,200
国庫債券 利付(30年)第27回	70,000,000	89,971,700
国庫債券 利付(30年)第28回	100,000,000	128,817,000
国庫債券 利付(30年)第29回	110,000,000	140,441,400
国庫債券 利付(30年)第30回	100,000,000	126,315,000
国庫債券 利付(30年)第31回	70,000,000	87,472,700
国庫債券 利付(30年)第32回	150,000,000	190,209,000
国庫債券 利付(30年)第33回	100,000,000	121,845,000
国庫債券 利付(30年)第34回	110,000,000	138,176,500

国庫債券	利付(30年)第35回	80,000,000	97,899,200
国庫債券	利付(30年)第36回	70,000,000	85,715,000
国庫債券	利付(30年)第37回	110,000,000	132,814,000
国庫債券	利付(30年)第38回	80,000,000	95,149,600
国庫債券	利付(30年)第39回	80,000,000	96,677,600
国庫債券	利付(30年)第40回	70,000,000	83,302,100
国庫債券	利付(30年)第41回	90,000,000	105,409,800
国庫債券	利付(30年)第42回	70,000,000	82,025,300
国庫債券	利付(30年)第43回	80,000,000	93,790,400
国庫債券	利付(30年)第44回	40,000,000	46,917,200
国庫債券	利付(30年)第45回	60,000,000	67,911,600
国庫債券	利付(30年)第46回	90,000,000	101,878,200
国庫債券	利付(30年)第47回	90,000,000	103,738,500
国庫債券	利付(30年)第48回	60,000,000	66,626,400
国庫債券	利付(30年)第49回	60,000,000	66,619,800
国庫債券	利付(30年)第54回	30,000,000	29,241,900
国庫債券	利付(30年)第55回	30,000,000	29,205,900
国庫債券	利付(30年)第56回	40,000,000	38,892,800
国庫債券	利付(30年)第57回	50,000,000	48,505,000
国庫債券	利付(30年)第58回	60,000,000	58,071,000
国庫債券	利付(30年)第59回	70,000,000	65,993,200
国庫債券	利付(30年)第60回	50,000,000	49,316,500
国庫債券	利付(30年)第61回	60,000,000	56,275,800
国庫債券	利付(30年)第62回	30,000,000	26,682,900
国庫債券	利付(30年)第63回	30,000,000	25,912,200
国庫債券	利付(30年)第64回	30,000,000	25,827,600
国庫債券	利付(30年)第65回	20,000,000	17,198,800
国庫債券	利付(30年)第67回	60,000,000	54,257,400
国庫債券	利付(30年)第68回	60,000,000	54,158,400
国庫債券	利付(30年)第69回	60,000,000	55,563,000
国庫債券	利付(30年)第70回	40,000,000	36,940,000
国庫債券	利付(30年)第71回	60,000,000	55,379,400
国庫債券	利付(30年)第72回	50,000,000	46,072,500
国庫債券	利付(30年)第73回	50,000,000	45,995,000
国庫債券	利付(30年)第74回	30,000,000	29,794,200
国庫債券	利付(20年)第62回	80,000,000	80,776,800
国庫債券	利付(20年)第63回	10,000,000	10,208,200
国庫債券	利付(20年)第64回	10,000,000	10,268,400
国庫債券	利付(20年)第65回	10,000,000	10,316,800
国庫債券	利付(20年)第66回	20,000,000	20,601,400
国庫債券	利付(20年)第67回	10,000,000	10,363,500
国庫債券	利付(20年)第68回	80,000,000	83,354,400
国庫債券	利付(20年)第69回	30,000,000	31,202,100

国庫債券	利付(20年)第71回	10,000,000	10,474,000
国庫債券	利付(20年)第72回	20,000,000	21,011,600
国庫債券	利付(20年)第73回	10,000,000	10,533,100
国庫債券	利付(20年)第74回	10,000,000	10,559,300
国庫債券	利付(20年)第75回	40,000,000	42,448,800
国庫債券	利付(20年)第76回	17,000,000	17,943,330
国庫債券	利付(20年)第77回	15,000,000	15,875,400
国庫債券	利付(20年)第78回	10,000,000	10,602,300
国庫債券	利付(20年)第79回	10,000,000	10,633,400
国庫債券	利付(20年)第80回	10,000,000	10,664,600
国庫債券	利付(20年)第81回	10,000,000	10,683,100
国庫債券	利付(20年)第82回	15,000,000	16,075,050
国庫債券	利付(20年)第83回	15,000,000	16,152,000
国庫債券	利付(20年)第84回	50,000,000	53,659,000
国庫債券	利付(20年)第85回	13,000,000	14,061,190
国庫債券	利付(20年)第86回	10,000,000	10,893,500
国庫債券	利付(20年)第88回	20,000,000	21,899,400
国庫債券	利付(20年)第90回	20,000,000	21,919,000
国庫債券	利付(20年)第91回	10,000,000	11,003,100
国庫債券	利付(20年)第92回	30,000,000	32,897,100
国庫債券	利付(20年)第93回	70,000,000	76,744,500
国庫債券	利付(20年)第94回	20,000,000	22,024,000
国庫債券	利付(20年)第95回	10,000,000	11,155,200
国庫債券	利付(20年)第96回	15,000,000	16,579,800
国庫債券	利付(20年)第97回	50,000,000	55,748,000
国庫債券	利付(20年)第99回	30,000,000	33,412,800
国庫債券	利付(20年)第100回	20,000,000	22,478,400
国庫債券	利付(20年)第101回	20,000,000	22,711,800
国庫債券	利付(20年)第102回	70,000,000	79,800,700
国庫債券	利付(20年)第103回	25,000,000	28,348,250
国庫債券	利付(20年)第104回	10,000,000	11,217,900
国庫債券	利付(20年)第105回	70,000,000	78,799,700
国庫債券	利付(20年)第107回	70,000,000	79,064,300
国庫債券	利付(20年)第108回	80,000,000	89,310,400
国庫債券	利付(20年)第109回	60,000,000	67,195,200
国庫債券	利付(20年)第110回	80,000,000	90,680,800

国庫債券 回	利付(20年)第111	10,000,000	11,438,000
国庫債券 回	利付(20年)第112	85,000,000	96,625,450
国庫債券 回	利付(20年)第113	160,000,000	182,384,000
国庫債券 回	利付(20年)第114	40,000,000	45,731,600
国庫債券 回	利付(20年)第115	50,000,000	57,539,500
国庫債券 回	利付(20年)第116	70,000,000	80,861,200
国庫債券 回	利付(20年)第117	60,000,000	68,845,200
国庫債券 回	利付(20年)第118	40,000,000	45,727,200
国庫債券 回	利付(20年)第119	50,000,000	56,361,500
国庫債券 回	利付(20年)第120	110,000,000	122,239,700
国庫債券 回	利付(20年)第121	70,000,000	79,688,000
国庫債券 回	利付(20年)第122	40,000,000	45,207,600
国庫債券 回	利付(20年)第123	100,000,000	115,887,000
国庫債券 回	利付(20年)第124	50,000,000	57,521,000
国庫債券 回	利付(20年)第125	40,000,000	46,860,400
国庫債券 回	利付(20年)第128	120,000,000	137,880,000
国庫債券 回	利付(20年)第129	50,000,000	57,004,000
国庫債券 回	利付(20年)第130	50,000,000	57,193,500
国庫債券 回	利付(20年)第132	10,000,000	11,376,900
国庫債券 回	利付(20年)第134	40,000,000	46,008,800
国庫債券 回	利付(20年)第135	10,000,000	11,405,900
国庫債券 回	利付(20年)第137	40,000,000	45,673,600
国庫債券 回	利付(20年)第139	30,000,000	33,959,700
国庫債券 回	利付(20年)第140	70,000,000	80,008,600
国庫債券 回	利付(20年)第141	100,000,000	114,455,000
国庫債券 回	利付(20年)第142	100,000,000	115,484,000
		90,000,000	102,195,000

国庫債券 利付(20年)第143回			
国庫債券 利付(20年)第144回	80,000,000	89,999,200	
国庫債券 利付(20年)第145回	150,000,000	172,206,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	140,000,000	160,916,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	150,000,000	170,919,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	150,000,000	169,348,500	
国庫債券 利付(20年)第149回	100,000,000	113,031,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	130,000,000	145,484,300	
国庫債券 利付(20年)第151回	100,000,000	109,538,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	150,000,000	164,371,500	
国庫債券 利付(20年)第153回	120,000,000	133,038,000	
国庫債券 利付(20年)第154回	110,000,000	120,549,000	
国庫債券 利付(20年)第155回	110,000,000	117,683,500	
国庫債券 利付(20年)第156回	10,000,000	9,889,600	
国庫債券 利付(20年)第158回	10,000,000	9,986,600	
国庫債券 利付(20年)第159回	20,000,000	20,217,200	
国庫債券 利付(20年)第160回	10,000,000	10,234,100	
国庫債券 利付(20年)第161回	30,000,000	30,230,100	
国庫債券 利付(20年)第162回	40,000,000	40,226,000	
国庫債券 利付(20年)第163回	50,000,000	50,179,000	
国庫債券 利付(20年)第164回	60,000,000	59,173,800	
国庫債券 利付(20年)第165回	50,000,000	49,193,000	
国庫債券 利付(20年)第166回	60,000,000	60,757,800	
国庫債券 利付(20年)第167回	40,000,000	39,158,800	
国庫債券 利付(20年)第168回	70,000,000	67,238,500	
国庫債券 利付(20年)第170回	50,000,000	46,940,000	
	60,000,000	56,148,600	



	国庫債券 利付（20年）第171回			
	国庫債券 利付（20年）第172回	70,000,000	66,507,700	
	国庫債券 利付（20年）第173回	50,000,000	47,360,500	
	国庫債券 利付（20年）第174回	30,000,000	28,328,100	
	国庫債券 利付（20年）第175回	80,000,000	76,733,600	
	国庫債券 利付（20年）第176回	90,000,000	86,139,900	
	国庫債券 利付（20年）第177回	50,000,000	46,879,000	
	国庫債券 利付（20年）第178回	60,000,000	57,222,000	
	国庫債券 利付（20年）第179回	20,000,000	19,031,200	
小計	銘柄数：228 組入時価比率：99.8%	18,275,000,000	19,490,802,370	100.0%
合計			19,490,802,370	

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2022年 5月10日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	2,803,889,865
コール・ローン	588,388,251
国債証券	633,482,065,266
派生商品評価勘定	2,907,680
未収入金	1,079,630,432
未収利息	6,384,022,110
前払費用	464,377,973
その他未収収益	31,497,859
流動資産合計	644,836,779,436
資産合計	644,836,779,436
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,392,795
未払金	2,361,728,913
未払解約金	1,895,799,065
未払利息	225
その他未払費用	12,418,311
流動負債合計	4,271,339,309
負債合計	4,271,339,309

純資産の部	
元本等	
元本	251,351,016,828
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	389,214,423,299
元本等合計	640,565,440,127
純資産合計	640,565,440,127
負債純資産合計	644,836,779,436

## 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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 5月10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	2.5485円
(10,000口当たり純資産額)	(25,485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	245,099,032,158円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	
3. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価	
貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。	
有価証券	257,316,326,862円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 5月11日  
至 2022年 5月10日

### 1. 金融商品に対する取組方針

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

### 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

2022年 5月10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

2022年 5月10日現在

期首	2021年 5月11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	229,270,699,136円
同期中における追加設定元本額	45,249,115,005円
同期中における一部解約元本額	23,168,797,313円
期末元本額	251,351,016,828円

期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	80,479,591円
バランスセレクト50	81,588,482円
バランスセレクト70	79,848,643円
野村外国債券インデックスファンド	267,862,695円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,569,553,345円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	23,188,750,740円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,887,417,781円
野村資産設計ファンド2015	18,725,131円
野村資産設計ファンド2020	19,271,101円
野村資産設計ファンド2025	34,361,697円
野村資産設計ファンド2030	40,845,984円
野村資産設計ファンド2035	30,016,151円
野村資産設計ファンド2040	50,985,722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）	73,257,696,615円
のむらップ・ファンド（保守型）	6,443,747,171円
のむらップ・ファンド（普通型）	21,235,457,674円
のむらップ・ファンド（積極型）	5,675,664,129円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	517,411,404円
野村資産設計ファンド2045	8,563,864円
野村インデックスファンド・外国債券	913,252,382円
マイ・ロード	8,756,944,831円
ネクストコア	122,618,726円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	283,375,933円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	8,661,587,773円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,180,177,357円
野村資産設計ファンド2050	8,418,371円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	4,208,610円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	2,239,053円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,483,901円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,173,121円
のむらップ・ファンド（やや保守型）	827,410,083円
のむらップ・ファンド（やや積極型）	901,778,414円
インデックス・ブレンド（タイプ）	3,611,059円
インデックス・ブレンド（タイプ）	1,949,204円
インデックス・ブレンド（タイプ）	8,698,234円
インデックス・ブレンド（タイプ）	1,493,195円
インデックス・ブレンド（タイプ）	7,574,560円
野村6資産均等バランス	2,355,899,222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）	6,628,014,121円
世界6資産分散ファンド	65,647,992円
野村資産設計ファンド2060	4,165,653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	9,661,709,782円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	6,614,449,673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）	6,255,673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）	1,080,898,866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）	177,073,767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)	1,138,845,144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)	590,181,608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)	2,409,833円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	8,354,055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)	372,299円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,876,148,066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)	7,448,079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)	37,998,069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)	7,817,581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)	167,487,665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)	151,098,257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)	1,901,593,567円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	71,250,985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)	967,461,300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)	1,147,385,291円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	6,032,213円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,523,699円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,300,257円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	6,001,300円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	591,185,049円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,340,957,191円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	6,736,883,818円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	5,124,408,264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)	20,730,136,901円
マイバランスDC30	2,028,527,683円
マイバランスDC50	1,538,399,924円
マイバランスDC70	1,107,641,509円
野村DC外国債券インデックスファンド	8,363,907,663円
野村DC運用戦略ファンド	3,811,926,740円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	453,289,889円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	280,375,646円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	516,164,387円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	252,575,189円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	20,043,176円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	45,832,317円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	21,303,043円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	12,120,415円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	8,490,413円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	4,426,481円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	158,040,030円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	103,546,969円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	56,992,507円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	78,526,376円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	2,016,841円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	19,688,153円
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	53,779,195円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	20,764,315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(2022年5月10日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2022年5月10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	36,400,000.00	38,188,717.84	
		US TREASURY BOND	46,700,000.00	46,326,031.07	
		US TREASURY BOND	66,600,000.00	73,926,000.00	
		US TREASURY BOND	15,000,000.00	17,333,202.00	
		US TREASURY BOND	129,400,000.00	146,029,918.64	
		US TREASURY BOND	100,000.00	115,062.50	
		US TREASURY BOND	2,300,000.00	2,096,054.63	
		US TREASURY BOND	1,200,000.00	1,253,343.72	
		US TREASURY N/B	900,000.00	896,167.89	
		US TREASURY N/B	400,000.00	402,593.72	
		US TREASURY N/B	35,500,000.00	35,358,553.80	
		US TREASURY N/B	21,200,000.00	21,080,750.00	
		US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,958,781.25	
		US TREASURY N/B	200,000.00	195,750.00	
		US TREASURY N/B	800,000.00	792,624.96	
		US TREASURY N/B	100,000.00	100,531.25	
		US TREASURY N/B	100,000.00	97,664.06	
		US TREASURY N/B	100,000.00	97,527.34	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,246,585.83	
		US TREASURY N/B	37,100,000.00	37,326,076.27	
		US TREASURY N/B	100,000.00	97,378.90	
		US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,517,772.95	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,226.56			

US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,762,046.33	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,006,093.70	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,456,875.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	194,062.50	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	34,716,000.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,006,875.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	291,257.79	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,515.62	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,474,125.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,005,781.20	
US TREASURY N/B	300,000.00	291,023.43	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	42,759,750.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	290,179.68	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,144,655.56	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	29,469,389.16	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,968.74	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,289.06	
US TREASURY N/B	45,900,000.00	45,670,500.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	801,624.96	
US TREASURY N/B	200,000.00	194,250.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,440,937.50	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,956,874.40	
US TREASURY N/B	11,600,000.00	11,587,311.92	
US TREASURY N/B	200,000.00	194,281.24	
US TREASURY N/B	800,000.00	802,281.20	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,628,812.50	
US TREASURY N/B	500,000.00	496,093.75	
US TREASURY N/B	400,000.00	398,609.36	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,089.84	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,789.06	
US TREASURY N/B	38,100,000.00	37,772,576.22	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,332.03	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,792.96	
US TREASURY N/B	500,000.00	494,062.50	
US TREASURY N/B	700,000.00	695,023.42	

US TREASURY N/B	72,000,000.00	71,811,561.60	
US TREASURY N/B	13,900,000.00	13,251,152.17	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,171,554.66	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,074.21	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,449,709.61	
US TREASURY N/B	500,000.00	490,332.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	285,292.95	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,752,202.84	
US TREASURY N/B	500,000.00	489,648.40	
US TREASURY N/B	200,000.00	189,671.86	
US TREASURY N/B	300,000.00	294,140.61	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,063,218.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,585.93	
US TREASURY N/B	43,600,000.00	42,971,545.24	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,067,257.73	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,960.93	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,369,718.72	
US TREASURY N/B	500,000.00	484,726.55	
US TREASURY N/B	57,850,000.00	57,063,598.67	
US TREASURY N/B	200,000.00	190,093.74	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,261,726.39	
US TREASURY N/B	500,000.00	484,140.60	
US TREASURY N/B	200,000.00	191,015.62	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,871,945.17	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,296.87	
US TREASURY N/B	200,000.00	191,281.24	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	991,484.30	
US TREASURY N/B	300,000.00	288,621.09	
US TREASURY N/B	23,800,000.00	23,274,724.48	
US TREASURY N/B	200,000.00	192,851.56	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,895,398.39	
US TREASURY N/B	17,300,000.00	16,510,011.07	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,035.15	
US TREASURY N/B	27,700,000.00	27,522,545.49	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,535.15	



US TREASURY N/B	100,000.00	99,406.25	
US TREASURY N/B	43,600,000.00	43,606,810.32	
US TREASURY N/B	100,000.00	92,957.03	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	7,876,735.82	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,000,312.50	
US TREASURY N/B	200,000.00	184,750.00	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,085,745.94	
US TREASURY N/B	200,000.00	184,273.42	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,201,218.36	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,726.56	
US TREASURY N/B	23,000,000.00	22,360,312.50	
US TREASURY N/B	700,000.00	696,992.17	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,390.62	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	32,807,295.24	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,078.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	100,382.81	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,500.00	
US TREASURY N/B	50,100,000.00	49,000,144.68	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,993,750.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,875.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,906,250.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,531.24	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	16,426,217.92	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,023.43	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,907,031.20	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	984,531.20	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,242.18	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,872,656.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,968.74	
US TREASURY N/B	42,300,000.00	41,407,732.26	
US TREASURY N/B	300,000.00	275,414.04	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,711,125.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	290,671.86	
US TREASURY N/B	300,000.00	274,804.68	
US TREASURY N/B	800,000.00	766,687.44	

US TREASURY N/B	300,000.00	275,882.79	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	6,899,062.32	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,804.68	
US TREASURY N/B	41,900,000.00	39,425,281.25	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,231,250.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,062.50	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	13,704,764.90	
US TREASURY N/B	300,000.00	274,195.29	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,288,500.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	276,843.75	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	13,696,718.75	
US TREASURY N/B	81,000,000.00	76,380,464.70	
US TREASURY N/B	500,000.00	463,359.35	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,625.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	185,000.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	186,953.12	
US TREASURY N/B	29,000,000.00	28,041,639.90	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,284,609.34	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,039.06	
US TREASURY N/B	300,000.00	268,007.79	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,804.68	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	15,056,952.70	
US TREASURY N/B	67,500,000.00	65,538,281.25	
US TREASURY N/B	700,000.00	617,968.75	
US TREASURY N/B	300,000.00	264,304.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	87,312.50	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	8,373,069.66	
US TREASURY N/B	100,000.00	87,687.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	86,890.62	
US TREASURY N/B	300,000.00	261,703.11	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	960,468.70	
US TREASURY N/B	300,000.00	263,015.61	
US TREASURY N/B	500,000.00	437,500.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	439,453.10	
US TREASURY N/B	27,700,000.00	27,245,545.49	

US TREASURY N/B	100,000.00	89,750.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	451,835.90	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,234.37	
US TREASURY N/B	53,600,000.00	53,040,968.08	
US TREASURY N/B	500,000.00	449,960.90	
US TREASURY N/B	500,000.00	449,121.05	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,277.34	
US TREASURY N/B	12,200,000.00	12,059,890.32	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,714.84	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,406.25	
US TREASURY N/B	300,000.00	269,988.27	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,202,859.36	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,621.09	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,855.46	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,937.50	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,069,878.81	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,269,140.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,652.34	
US TREASURY N/B	21,700,000.00	20,742,146.81	
US TREASURY N/B	300,000.00	272,343.75	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,918,710.78	
US TREASURY N/B	600,000.00	502,453.08	
US TREASURY N/B	11,700,000.00	10,452,303.81	
US TREASURY N/B	48,100,000.00	58,986,381.61	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	13,739,741.98	
US TREASURY N/B	100,000.00	82,312.50	
US TREASURY N/B	151,700,000.00	178,460,820.54	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	852,382.80	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,738.28	
US TREASURY N/B	20,100,000.00	17,169,009.96	
US TREASURY N/B	28,900,000.00	24,867,545.43	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	898,984.30	
US TREASURY N/B	21,100,000.00	24,629,304.16	
US TREASURY N/B	8,200,000.00	10,032,827.92	
US TREASURY N/B	100,000.00	116,625.00	

US TREASURY N/B	100,000.00	103,406.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	113,187.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	116,562.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	114,593.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	118,132.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	114,554.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	69,343.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	107,234.37	
US TREASURY N/B	100,000.00	68,867.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	112,117.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	71,835.93	
US TREASURY N/B	300,000.00	358,523.43	
US TREASURY N/B	200,000.00	156,953.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	113,726.56	
US TREASURY N/B	200,000.00	166,718.74	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,718.75	
US TREASURY N/B	200,000.00	152,156.24	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,679.68	
US TREASURY N/B	200,000.00	159,000.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,742.18	
US TREASURY N/B	200,000.00	169,859.36	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,789.06	
US TREASURY N/B	200,000.00	179,375.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,546.87	
US TREASURY N/B	290,000.00	275,613.27	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,546.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,453.12	
US TREASURY N/B	16,500,000.00	16,260,233.55	
US TREASURY N/B	39,950,000.00	37,773,036.61	
US TREASURY N/B	36,700,000.00	33,923,127.53	
US TREASURY N/B	43,700,000.00	36,960,638.44	
US TREASURY N/B	23,400,000.00	21,634,030.08	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	15,862,108.50	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	2,966,749.76	
US TREASURY N/B	49,700,000.00	42,000,381.57	

	US TREASURY N/B	28,200,000.00	23,857,639.92	
	US TREASURY N/B	34,500,000.00	27,767,107.65	
	US TREASURY N/B	14,200,000.00	12,904,250.00	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,857,500.00	
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,581,000.00	
	US TREASURY N/B	11,400,000.00	10,146,000.00	
	US TREASURY N/B	9,300,000.00	8,277,000.00	
	US TREASURY N/B	9,500,000.00	8,897,343.75	
	US TREASURY N/B	5,100,000.00	4,899,187.50	
	US TREASURY N/B	10,500,000.00	9,841,288.80	
	US TREASURY N/B	6,100,000.00	6,151,945.16	
	US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,333,378.12	
	US TREASURY N/B	100,000.00	92,281.25	
	US TREASURY N/B	11,250,000.00	9,129,198.37	
	US TREASURY N/B	300,000.00	250,898.43	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	765,625.00	
	US TREASURY N/B	10,200,000.00	6,417,234.12	
	US TREASURY N/B	9,100,000.00	5,927,085.71	
	US TREASURY N/B	7,900,000.00	5,506,546.48	
	US TREASURY N/B	13,900,000.00	10,348,983.68	
	US TREASURY N/B	60,050,000.00	50,273,109.37	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	768,007.80	
	US TREASURY N/B	100,000.00	74,554.68	
	US TREASURY N/B	100,000.00	81,742.18	
小計	銘柄数：257	2,460,310,000.00	2,425,740,849.67	
			(315,419,082,682)	
	組入時価比率：49.2%		49.9%	
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	6,680,000.00	6,612,111.16	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,070,000.00	3,049,559.94	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	496,928.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,175,309.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	34,400,000.00	33,058,365.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,650,838.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	318,429.65	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	285,746.10	

	CANADIAN GOVERNMENT	11,600,000.00	10,764,707.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	183,252.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	762,495.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	14,730,000.00	17,367,229.74	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	957,565.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,142,923.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	13,800,000.00	17,217,542.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	2,325,332.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,242,714.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	10,699,633.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,236,537.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,600,000.00	8,542,455.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	837,855.90	
小計	銘柄数：21	126,380,000.00	128,927,532.39	
			(12,877,281,935)	
	組入時価比率：2.0%		2.0%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	114,500,000.00	112,172,215.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	65,000,000.00	66,482,175.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	110,000,000.00	98,612,932.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	80,300,000.00	75,496,325.52	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	77,300,000.00	75,067,375.02	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	76,600,000.00	70,031,933.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	400,000.00	356,028.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	56,479,067.84	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,800,000.00	24,122,264.70	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,200,000.00	58,111,856.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	37,269,239.50	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	64,800,000.00	63,947,983.68	
小計	銘柄数：12	779,200,000.00	738,149,395.76	
			(4,697,582,754)	
	組入時価比率：0.7%		0.7%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,800,000.00	1,848,306.60	
	BELGIUM KINGDOM	1,900,000.00	1,904,940.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,188,800.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,000,679.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,708,676.80	

BELGIUM KINGDOM	6,700,000.00	7,671,888.60
BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,324,637.80
BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	1,979,100.00
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	980,956.00
BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	6,337,825.00
BELGIUM KINGDOM	11,400,000.00	10,907,451.60
BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,291,748.20
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	96,290.00
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	467,790.50
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	99,370.00
BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,693,839.50
BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	5,227,248.00
BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	4,710,612.40
BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	2,472,071.40
BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	3,204,274.70
BELGIUM KINGDOM	2,200,000.00	2,206,072.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	14,440,216.50
BELGIUM KINGDOM GOVT	10,500,000.00	14,281,323.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,015,590.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,300,000.00	7,747,241.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	20,700,000.00	22,258,233.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,600,000.00	14,421,712.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,700,000.00	5,976,666.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,100,000.00	2,137,422.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,900,000.00	19,925,832.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,600,000.00	6,835,189.02
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,081,969.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,650,000.00	41,277,886.65
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	800,344.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,800,000.00	9,730,910.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,800,000.00	2,771,941.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	4,920,250.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,500,000.00	17,556,600.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,012,255.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	5,421,600.00

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	938,259.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,900,000.00	2,581,619.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	5,609,259.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,000,000.00	15,892,646.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	3,375,207.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,500,000.00	10,625,793.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,200,000.00	5,784,069.72	
BUNDESobligation	2,000,000.00	1,981,360.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,652,550.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,747,039.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,100,000.00	10,347,551.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000.00	7,814,422.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,704,833.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	8,324,066.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,400,000.00	20,318,196.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	972,090.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	684,754.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	26,015,580.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	197,098.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,300,000.00	24,438,239.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	589,044.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,700,000.00	13,204,121.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,600,000.00	25,873,530.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	21,950,000.00	30,128,350.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,800,000.00	25,158,626.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	12,250,000.00	16,893,742.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,700,000.00	5,446,607.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,800,000.00	4,416,115.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,130,000.00	1,548,223.17	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	6,556,633.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,700,000.00	15,032,160.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	22,700,000.00	23,025,291.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,562,514.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	526,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,022,700.00	



BUONI POLIENNALI DEL TES	19,700,000.00	22,069,319.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	23,500,000.00	24,938,435.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	303,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,216,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,600,000.00	6,957,060.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,682,140.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,024,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	31,600,000.00	34,560,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	790,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,465,630.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	400,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,750,000.00	16,069,725.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,010,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,500,000.00	19,183,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,003,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	24,500,000.00	29,992,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	199,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	197,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	32,800,000.00	39,966,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	196,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,300,000.00	16,166,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	35,000,000.00	41,244,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	902,949.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,600,000.00	24,421,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	795,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	14,161,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,313,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	22,300,000.00	26,565,990.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,000,000.00	14,201,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	2,944,620.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	478,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	5,507,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	194,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	14,043,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	10,763,280.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,443,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	2,840,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	8,412,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,900,000.00	6,564,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,100,000.00	3,519,075.10	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	400,010.80	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	723,002.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	3,976,920.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	100,545.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	1,973,918.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	3,627,138.90	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,270,728.80	
FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,226,360.20	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	189,101.20	
FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	3,231,542.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	462,968.00	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	477,139.00	
FRANCE (GOVT OF)	970,000.00	988,919.85	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,991,550.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	99,392.00	
FRANCE (GOVT OF)	15,200,000.00	15,779,652.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,767,758.40	
FRANCE (GOVT OF)	13,000,000.00	12,938,562.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,773,937.80	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	12,888,777.30	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	7,996,800.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,900,000.00	6,748,020.60	
FRANCE (GOVT OF)	15,100,000.00	14,690,941.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,300,000.00	3,133,564.50	
FRANCE (GOVT OF)	9,400,000.00	10,230,696.80	
FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	9,540,742.80	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	92,300.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	98,851.30	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	10,645,103.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,787,644.00	

FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	356,842.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,400,000.00	6,789,120.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,700,000.00	5,873,274.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	11,210,579.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,048,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	290,823.90	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000.00	36,461,305.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,700,000.00	6,207,870.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,700,000.00	38,201,277.51	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,600,000.00	14,639,157.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,650,000.00	34,480,025.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	30,100,000.00	40,553,188.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	391,573.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,150,000.00	11,437,416.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,450,000.00	30,263,476.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,850,000.00	10,073,692.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,040,000.00	21,246,732.00	
IRISH GOVERNMENT	6,130,000.00	6,948,888.31	
IRISH GOVERNMENT	6,900,000.00	6,765,091.20	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	590,317.20	
IRISH TSY 1.3% 2033	5,100,000.00	4,829,926.95	
IRISH TSY 1.35% 2031	3,300,000.00	3,253,661.40	
IRISH TSY 1.5% 2050	2,600,000.00	2,273,003.20	
IRISH TSY 1.7% 2037	3,100,000.00	3,012,700.90	
IRISH TSY 1% 2026	7,100,000.00	7,146,490.80	
IRISH TSY 2.4% 2030	7,500,000.00	8,049,982.50	
IRISH TSY 2% 2045	1,600,000.00	1,594,148.80	
IRISH TSY 3.4% 2024	11,200,000.00	11,837,661.92	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	408,640.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	99,760.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,300,000.00	3,418,113.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,481,550.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	1,875,490.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,473,500.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	15,325,800.00	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	983,450.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	748,400.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	11,750,000.00	12,972,000.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,700,000.00	6,244,857.10	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	424,206.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3,600,000.00	4,987,911.60	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	9,600,000.00	12,386,899.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	801,023.36	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	900,864.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	153,837.45	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,290,185.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	721,179.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,318,693.48	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	6,237,540.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,980,572.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	9,627,414.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	11,600,000.00	11,007,240.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	8,600,000.00	9,354,839.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	532,407.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	5,625,146.56	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,000,000.00	6,710,200.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,553,315.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	1,477,865.60	
	SPANISH GOVERNMENT	25,200,000.00	32,208,019.20	
	SPANISH GOVERNMENT	27,900,000.00	37,213,020.00	
	SPANISH GOVERNMENT	6,300,000.00	7,719,301.80	
小計	銘柄数：206	1,454,920,000.00	1,670,579,492.61 (229,320,446,950)	
	組入時価比率：35.8%		36.2%	
英ポンド	UK TREASURY	1,350,000.00	1,341,235.80	
	UK TREASURY	2,800,000.00	2,832,302.48	
	UK TREASURY	300,000.00	293,413.92	
	UK TREASURY	2,000,000.00	1,985,037.60	
	UK TREASURY	4,550,000.00	4,686,036.81	
	UK TREASURY	15,070,000.00	16,514,453.47	

	UK TREASURY	200,000.00	195,197.20
	UK TREASURY	200,000.00	203,492.80
	UK TREASURY	4,310,000.00	4,309,129.38
	UK TREASURY	500,000.00	473,849.00
	UK TREASURY	400,000.00	393,667.20
	UK TREASURY	13,700,000.00	15,605,387.78
	UK TREASURY	200,000.00	199,698.40
	UK TREASURY	6,650,000.00	8,430,537.50
	UK TREASURY	6,650,000.00	8,200,841.18
	UK TREASURY	9,610,000.00	11,627,042.90
	UK TREASURY	17,150,000.00	21,655,407.90
	UK TREASURY	750,000.00	619,021.50
	UK TREASURY	4,330,000.00	5,415,697.27
	UK TREASURY	100,000.00	135,939.42
	UK TREASURY	350,000.00	454,007.40
	UK TREASURY	500,000.00	655,817.60
	UK TREASURY	320,000.00	441,311.10
	UK TREASURY	18,440,000.00	22,663,497.60
	UK TREASURY	5,900,000.00	8,182,474.00
	UK TREASURY	8,200,000.00	7,111,860.00
	UK TREASURY	16,100,000.00	14,750,176.00
	UK TREASURY	5,350,000.00	7,642,778.88
	UK TREASURY	1,100,000.00	886,314.00
	UK TREASURY	6,750,000.00	9,163,800.00
	UK TREASURY	1,300,000.00	1,155,739.00
	UK TREASURY	700,000.00	646,072.00
	UK TREASURY	8,950,000.00	13,574,465.00
	UK TREASURY	100,000.00	115,067.00
	UK TREASURY	200,000.00	291,840.00
	UK TSY 3 1/4% 2044	5,950,000.00	7,014,395.50
	UNITED KINGDOM(GOVERNMEN	6,400,000.00	9,727,872.00
小計	銘柄数：37	177,430,000.00	209,594,876.59 (33,612,730,358)
	組入時価比率：5.2%		5.3%
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	7,900,000.00	7,919,703.39
	SWEDISH GOVERNMENT	36,350,000.00	37,175,145.00

小計	SWEDISH GOVERNMENT	16,000,000.00	15,445,520.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	17,300,000.00	16,197,505.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	18,900,000.00	17,356,888.71	
	SWEDISH GOVERNMENT	13,100,000.00	11,142,018.98	
	SWEDISH GOVERNMENT	21,300,000.00	25,647,370.47	
	銘柄数：7	130,850,000.00	130,884,152.15	(1,684,479,038)
	組入時価比率：0.3%			0.3%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,309,312.10	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	37,800,000.00	38,220,336.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	12,500,000.00	12,188,662.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	6,783,865.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	9,695,100.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	8,938,930.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	28,000,000.00	25,873,932.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,400,000.00	6,561,062.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,486,900.00	
	小計	銘柄数：9	124,700,000.00	120,058,100.00
組入時価比率：0.3%			0.3%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	870,000.00	887,400.00	
	KINGDOM OF DENMARK	24,800,000.00	25,551,440.00	
	KINGDOM OF DENMARK	18,400,000.00	17,814,272.80	
	KINGDOM OF DENMARK	37,250,000.00	35,149,100.00	
	KINGDOM OF DENMARK	40,200,000.00	58,439,222.40	
	KINGDOM OF DENMARK	3,500,000.00	2,436,315.00	
	小計	銘柄数：6	125,020,000.00	140,277,750.20
組入時価比率：0.4%			0.4%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	38,800,000.00	34,766,740.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	2,700,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	59,100,000.00	48,160,590.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,033,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,100,000.00	2,030,190.00	
	小計	銘柄数：5	106,600,000.00	89,690,720.00

			(2,621,274,075)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,500,925.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	7,746,866.05	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,080,000.00	17,761,362.19	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,660,446.11	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,166,046.12	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	288,678.87	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,770,312.16	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	9,649,540.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	22,200,000.00	20,678,598.48	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	4,638,697.05	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	2,778,971.58	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,596,733.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	10,610,167.96	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,450,000.00	2,214,881.34	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,250,000.00	8,257,269.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	651,910.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,273,423.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,900,000.00	4,200,280.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	1,888,800.00	
小計	銘柄数：19	110,680,000.00	106,333,910.01	
			(9,577,495,274)	
	組入時価比率：1.5%		1.5%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,318,152.75	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,444,968.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,335,329.38	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,099,859.42	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,378,887.44	
	SINGAPORE GOVERNMENT	5,350,000.00	5,539,229.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	499,180.90	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	303,139.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,850,000.00	3,879,689.66	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,080,000.00	2,189,231.61	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,920,000.00	1,753,660.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,750,000.00	2,636,562.50	

小計	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	1,854,180.93
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	1,728,766.62
	銘柄数：14	29,300,000.00	28,960,839.81 (2,705,811,263)
	組入時価比率：0.4%		0.4%
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	402,512.32
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,576,114.06
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,700,000.00	2,441,791.71
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	396,070.08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,225,278.22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,848,527.44
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,700,941.29
	MALAYSIAN GOVERNMENT	16,600,000.00	16,783,873.22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,518,003.16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,732,597.90
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,119,865.22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	267,707.18
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,400,000.00	15,235,705.10
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,217,627.96
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	8,986,636.26
	MALAYSIAN GOVERNMENT	11,100,000.00	10,431,468.09
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	9,523,450.30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,500,000.00	9,905,009.10
	MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	287,222.76
	小計	銘柄数：19	108,680,000.00
	組入時価比率：0.5%		0.5%
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	141,900,000.00	142,237,409.82
	CHINA GOVERNMENT BOND	62,100,000.00	61,852,531.50
	CHINA GOVERNMENT BOND	89,500,000.00	89,904,540.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	32,691,450.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	19,892,100.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	70,000,000.00	70,384,517.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	30,000,000.00	29,950,650.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	33,387,090.00



小計	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,078,962.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	19,892,716.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,975,075.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	36,000,000.00	37,300,860.00	
	銘柄数：12 組入時価比率：1.7%	570,500,000.00	573,547,901.32 (11,078,938,035) 1.7%	
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,016,918.00	
	ISRAEL FIXED BOND	6,200,000.00	6,452,900.48	
	ISRAEL FIXED BOND	11,900,000.00	11,822,861.82	
	ISRAEL FIXED BOND	6,500,000.00	7,647,214.25	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	4,964,041.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	4,978,075.50	
	ISRAEL FIXED BOND	8,500,000.00	7,611,784.85	
	ISRAEL FIXED BOND	5,900,000.00	4,842,501.70	
	ISRAEL FIXED BOND	6,000,000.00	8,107,093.20	
	ISRAEL FIXED BOND	5,700,000.00	6,163,355.28	
小計	銘柄数：10 組入時価比率：0.4%	65,700,000.00	67,606,746.08 (2,557,583,486) 0.4%	
合計			633,482,065,266 (633,482,065,266)	

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

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(3)貸付有価証券の明細(2022年 5月10日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	18,000,000	
		US TREASURY N/B	10,385,000	
		US TREASURY N/B	2,500,000	
		US TREASURY N/B	33,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	23,000,000	
		US TREASURY BOND	85,000	
		US TREASURY N/B	5,500,000	
		US TREASURY N/B	19,000,000	
		US TREASURY N/B	10,700,000	
		US TREASURY N/B	19,000,000	

US TREASURY N/B	33,000,000
US TREASURY N/B	246,000
US TREASURY N/B	12,000,000
US TREASURY N/B	4,200,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	17,185,000
US TREASURY BOND	43,000,000
US TREASURY BOND	50,000,000
US TREASURY BOND	13,000,000
US TREASURY N/B	18,300,000
US TREASURY N/B	15,000,000
US TREASURY N/B	26,000,000
US TREASURY N/B	27,000,000
US TREASURY N/B	35,500,000
US TREASURY BOND	50,000,000
US TREASURY BOND	5,000,000
US TREASURY BOND	11,000,000
US TREASURY BOND	30,000,000
US TREASURY N/B	11,000,000
US TREASURY N/B	23,000,000
US TREASURY N/B	255,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	14,450,000
US TREASURY N/B	255,000
US TREASURY N/B	13,298,000
US TREASURY N/B	255,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	170,000
US TREASURY N/B	14,705,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	425,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	935,000
US TREASURY N/B	29,000,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	8,400,000
US TREASURY N/B	19,000,000
US TREASURY N/B	425,000
US TREASURY N/B	5,000,000
US TREASURY N/B	50,000,000
US TREASURY N/B	12,000,000
US TREASURY N/B	18,000,000
US TREASURY N/B	26,000,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	19,000,000
US TREASURY N/B	6,800,000
US TREASURY N/B	12,750,000
US TREASURY N/B	11,050,000

	US TREASURY N/B	5,000,000
	US TREASURY N/B	5,950,000
	US TREASURY N/B	1,870,000
	US TREASURY N/B	5,000,000
	US TREASURY N/B	37,000,000
	US TREASURY N/B	1,445,000
	US TREASURY N/B	7,395,000
	US TREASURY N/B	5,000,000
	US TREASURY N/B	37,000,000
	US TREASURY N/B	41,000,000
	US TREASURY N/B	35,000,000
	US TREASURY N/B	2,000,000
	US TREASURY N/B	1,040,000
	US TREASURY N/B	1,000,000
	US TREASURY BOND	30,618,000
	US TREASURY N/B	22,500,000
	US TREASURY N/B	30,000,000
	US TREASURY N/B	17,000,000
	US TREASURY N/B	3,455,000
	US TREASURY N/B	25,000,000
	US TREASURY N/B	7,500,000
	US TREASURY N/B	37,000,000
	US TREASURY N/B	680,000
	US TREASURY N/B	12,750,000
	US TREASURY N/B	22,000,000
	US TREASURY N/B	578,000
	US TREASURY N/B	23,000,000
	US TREASURY N/B	36,000,000
	US TREASURY N/B	850,000
	US TREASURY N/B	31,000,000
	US TREASURY N/B	7,735,000
	US TREASURY N/B	8,415,000
	US TREASURY N/B	14,000,000
	US TREASURY N/B	30,000,000
	US TREASURY N/B	7,644,000
	US TREASURY N/B	27,000,000
	US TREASURY N/B	24,000,000
	US TREASURY N/B	8,000,000
	US TREASURY N/B	12,000,000
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,600,000
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,900,000
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,000,000
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,500,000
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	500,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	102,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	351,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	176,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	759,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	153,000

	MEX BONOS DESARR FIX RT	529,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	579,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	500,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	151,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	179,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	794,000
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	550,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	365,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	219,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	250,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	407,000
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	7,200,000
	ISRAEL FIXED BOND	1,100,000
	ISRAEL FIXED BOND	1,000,000
ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,295,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,240,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000
	BUNDESREPLIGATION	1,700,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	595,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	770,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,450,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,160,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,930,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,375,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	945,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	960,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,410,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,900,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,235,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,000,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	16,400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,170,000
	FRANCE (GOVT OF)	1,700,000
	FRANCE (GOVT OF)	11,305,000
	FRANCE (GOVT OF)	8,058,000
	FRANCE (GOVT OF)	5,800,000
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000
	BELGIUM KINGDOM	850,000

	BELGIUM KINGDOM	2,210,000
	BELGIUM KINGDOM GOVT	9,770,000
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,500,000
	SPANISH GOVERNMENT	20,000,000
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000
	FINNISH GOVERNMENT	1,700,000
	IRISH TSY 2.4% 2030	6,000,000
	BUONI POLIENNALI DEL TES	264,000
	BUONI POLIENNALI DEL TES	15,800,000

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年 5月10日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	1,362,548,065	-	1,361,033,180	1,514,885
米ドル	666,035,010	-	663,131,580	2,903,430
ユーロ	616,326,705	-	617,719,500	1,392,795
英ポンド	80,186,350	-	80,182,100	4,250
合計	1,362,548,065	-	1,361,033,180	1,514,885

## (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。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## バランスセレクト70

2022年5月31日現在

資産総額	2,067,912,676円
負債総額	925,877円
純資産総額（ - ）	2,066,986,799円
発行済口数	997,522,927口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0721円

## （参考）国内株式マザーファンド

2022年5月31日現在

資産総額	459,847,808,605円
負債総額	25,218,156,314円
純資産総額（ - ）	434,629,652,291円
発行済口数	212,237,149,837口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0478円

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2022年5月31日現在

資産総額	1,287,121,051,371円
負債総額	4,603,671,047円
純資産総額（ - ）	1,282,517,380,324円
発行済口数	282,835,132,933口
1口当たり純資産額（ / ）	4.5345円

## （参考）国内債券マザーファンド

2022年5月31日現在

資産総額	20,436,739,268円
負債総額	404,415,392円
純資産総額（ - ）	20,032,323,876円
発行済口数	14,989,678,839口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3364円

## （参考）外国債券マザーファンド

2022年5月31日現在

資産総額	652,015,233,949円
負債総額	1,697,940,147円
純資産総額（ - ）	650,317,293,802円
発行済口数	253,646,530,892口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5639円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

## (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

## (3) 受益権の譲渡

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

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

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

## (4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

## (5) 受益権の再分割

委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。



### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額

2022年6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2022年5月31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	1,007	38,742,985
単位型株式投資信託	196	743,186
追加型公社債投資信託	14	6,246,104
単位型公社債投資信託	510	1,398,981
合計	1,727	47,131,256

### 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(2021年4月1日から2022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。

#### (1)【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022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		4,281	2,006
金銭の信託		35,912	35,894
有価証券		30,400	29,300
前払金		-	11
前払費用		167	454
未収入金		632	694
未収委託者報酬		24,499	27,176
未収運用受託報酬		4,347	4,002
短期貸付金		-	1,835
その他		268	57
貸倒引当金		14	15
流動資産計		100,496	101,417
固定資産			
有形固定資産			
建物	2	1,935	1,219
器具備品	2	731	525
無形固定資産			
ソフトウェア		5,428	5,209
その他		0	0

投資その他の資産		16,487		16,067
投資有価証券			2,201	
関係会社株式	1,767		9,214	
長期差入保証金	9,942		443	
長期前払費用	330		13	
前払年金費用	15		1,297	
繰延税金資産	1,301		2,784	
その他	3,008		112	
固定資産計	122	24,583		23,023
資産合計		125,080		124,440

区分	注記 番号	前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
<b>(負債の部)</b>					
<b>流動負債</b>					
預り金			123		120
未払金			16,948		17,615
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		8		17	
未払手数料		7,256		8,357	
関係会社未払金		8,671		8,149	
その他未払金		1,011		1,089	
未払費用	1		9,171		9,512
未払法人税等			2,113		1,319
前受収益			22		22
賞与引当金			3,795		4,416
その他			-		121
流動負債計			32,175		33,127
<b>固定負債</b>					
退職給付引当金			3,299		3,194
時効後支払損引当金			580		588
資産除去債務			1,371		1,123
固定負債計			5,250		4,905
負債合計			37,425		38,033
<b>(純資産の部)</b>					
<b>株主資本</b>					
資本金			87,596		86,232
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			56,686		55,322
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		56,001		54,637	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		31,395		30,030	
評価・換算差額等			57		174
その他有価証券評価差額金			57		174
純資産合計			87,654		86,407
負債・純資産合計			125,080		124,440

## (2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			106,355		115,733
運用受託報酬			16,583		17,671
その他営業収益			428		530
営業収益計			123,367		133,935
営業費用					
支払手数料			34,739		39,087
広告宣伝費			1,005		804
公告費			0		0
調査費			24,506		26,650
調査費		5,532		4,867	
委託調査費		18,974		21,783	
委託計算費			1,358		1,384
営業雑経費			4,149		3,094
通信費		73		72	
印刷費		976		918	
協会費		88		79	
諸経費		3,011		2,023	
営業費用計			65,760		71,021
一般管理費					
給料			10,985		12,033
役員報酬		147		229	
給料・手当		7,156		7,375	
賞与		3,682		4,427	
交際費			35		47
旅費交通費			64		65
租税公課			1,121		1,049
不動産賃借料			1,147		1,432
退職給付費用			1,267		1,212
固定資産減価償却費			2,700		2,525
諸経費			10,739		11,190
一般管理費計			28,063		29,556
営業利益			29,542		33,357

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,540		3,530	

受取利息		0		10	
金銭の信託運用益		1,698		-	
その他		447		1,268	
営業外収益計			6,687		4,809
営業外費用					
金銭の信託運用損		-		1,387	
時効後支払損引当金繰入額		13		12	
為替差損		26		23	
その他		32		266	
営業外費用計			72		1,689
経常利益			36,157		36,477
特別利益					
投資有価証券等売却益		71		26	
株式報酬受入益		48		53	
固定資産売却益		-		9	
資産除去債務履行差額		-		141	
移転補償金		2,077		-	
特別利益計			2,197		230
特別損失					
投資有価証券等売却損		-		0	
投資有価証券等評価損		36		-	
関係会社株式評価損		582		727	
固定資産除却損	2	105		374	
資産除去債務履行差額		-		0	
事務所移転費用		406		54	
特別損失計			1,129		1,158
税引前当期純利益			37,225		35,549
法人税、住民税及び事業税			11,239		10,474
法人税等調整額			290		171
当期純利益			26,276		24,904

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270
当期変動額									
剰余金の配当							23,950	23,950	23,950
当期純利益							26,276	26,276	26,276

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,326	2,326	2,326
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596

(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	10	10	85,281
当期変動額			
剰余金の配当			23,950
当期純利益			26,276
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	46	46	46
当期変動額合計	46	46	2,372
当期末残高	57	57	87,654

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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		別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596
当期変動額									
剰余金の配当							26,268	26,268	26,268
当期純利益							24,904	24,904	24,904
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,364	1,364	1,364
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,030	55,322	86,232

(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	57	57	87,654
当期変動額			
剰余金の配当			26,268
当期純利益			24,904
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	116	116	116
当期変動額合計	116	116	1,247
当期末残高	174	174	86,407

## [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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法						
4. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。						
5. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table style="margin-left: 40px;"> <tr> <td>建物</td> <td>6年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>6～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によるっております。</p>	建物	6年	附属設備	6～15年	器具備品	4～15年
建物	6年						
附属設備	6～15年						
器具備品	4～15年						
6. 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>						



## (3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

## 退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

## 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。

退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。

## (4) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

## 7. 収益及び費用の計上基準

当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

## 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

## 運用受託報酬

運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき契約期間の純資産総額等に対する一定割合として認識され、確定した報酬を顧問口座によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

## 成功報酬

成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。

## 8. 消費税等の会計処理方法

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。

## 9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

## [ 会計上の見積りに関する注記 ]

該当事項はありません。

## [ 会計方針の変更 ]

## （収益認識に関する会計基準等の適用）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識しています。

これにより、営業外収益に計上しておりますシステム利用サービスに係る収益について、従来は、当該システム利用サービスに係るシステム関連費用を控除し、純額で認識しておりましたが、控除せず、総額で収益を認識する方法に変更しております。

収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当事業年度の期首の繰越利益剰余金に反映させ、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。

これによる財務諸表に与える影響は軽微であります。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識に関する注記」については記載していません。

## （時価の算定に関する会計基準の適用）

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載していません。

## [ 未適用の会計基準等 ]

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

## （1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

## （2）適用予定日

2023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

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

・「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日 企業会計基準委員会）

## (1) 概要

2020年3月27日に成立した「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において、連結納税制度を見直しグループ通算制度へ移行することとされたことを受け、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを明らかにすることを目的として企業基準委員会から公表されたものです。

## (2) 適用予定日

2023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

「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022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 1,256百万円	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 1,223百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 346百万円 器具備品 643 合計 990	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 589百万円 器具備品 618 合計 1,207

## 損益計算書関係

前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022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 4,334百万円	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 3,525百万円

2. 固定資産除却損		2. 固定資産除却損	
建物	-百万円	建物	346百万円
器具備品	2	器具備品	28
ソフトウェア	102	ソフトウェア	-
ア		ア	
合計	105	合計	374

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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

2020年5月19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	23,950百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,650円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月30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

2021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	26,268百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,100円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月30日

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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

2021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	26,268百万円
配当の原資	利益剰余金

1株当たり配当額	5,100円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月30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

2022年5月18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	24,877百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,830円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022年6月30日

## 金融商品関係

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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

2021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	4,281	4,281	-
(2)金銭の信託	35,912	35,912	-
(3)未収委託者報酬	24,499	24,499	-
(4)未収運用受託報酬	4,347	4,347	-
(5)有価証券及び投資有価証券	30,400	30,400	-
その他有価証券	30,400	30,400	-
資産計	99,441	99,441	-
(6)未払金	16,948	16,948	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	8	8	-
未払手数料	7,256	7,256	-
関係会社未払金	8,671	8,671	-
その他未払金	1,011	1,011	-
(7)未払費用	9,171	9,171	-
(8)未払法人税等	2,113	2,113	-
負債計	28,233	28,233	-

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1,767百万円、関係会社株式9,942百万円）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618百万円（投資有価証券35百万円、関係会社株式582百万円）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	4,281	-	-	-
金銭の信託	35,912	-	-	-
未収委託者報酬	24,499	-	-	-
未収運用受託報酬	4,347	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	30,400	-	-	-
合計	99,441	-	-	-

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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

2022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。

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	35,894	35,894	-
資産計	35,894	35,894	-
(2) その他（デリバティブ取引）	121	121	-
負債計	121	121	-

(注) 1 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、有価証券、短期貸付金、未払金、未払費用、未払法人税等は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注) 2 投資有価証券及び関係会社株式は、市場価格のない株式等及び組合出資金等であることから、上表には含まれておりません。当該金融商品の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

	当事業年度（百万円）
市場価格のない株式等（ ）1.2	9,529
組合出資金等	1,886
合計	11,415

( ) 1 市場価格のない株式等には非上場株式等が含まれております。

2 非上場株式等について、当事業年度において727百万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	2,006	-	-	-
金銭の信託	35,894	-	-	-
未収委託者報酬	27,176	-	-	-
未収運用受託報酬	4,002	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
其他有価証券	29,300	-	-	-
短期貸付金	1,835			
合計	100,215	-	-	-

## 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接または間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

区分	貸借対照表計上額（単位：百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託（運用目的・その他）（ ）	-	1,736	-	1,736
資産計	-	1,736	-	1,736
デリバティブ取引（通貨関連）	-	121	-	121
負債計	-	121	-	121

（ ）時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、投資信託を主要な構成物とする金銭の信託34,157百万円は表中に含まれておりません。

## (注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

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。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、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。

デリバティブ取引

時価の算定方法は、取引先金融機関から提示された価格等に基づき算出しており、レベル2の時価に分類しております。

## 有価証券関係

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2021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(2021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(2021年3月31日)

時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式及び関連会社株式の貸借対照表計上額

区分	前事業年度 (百万円)
子会社株式	9,835
関連会社株式	106

## 4．その他有価証券(2021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	30,400	30,400	-
小計	30,400	30,400	-
合計	30,400	30,400	-

非上場株式（貸借対照表計上額312百万円）及び投資事業有限責任組合への出資金（貸借対照表計上額1,455百万円）は、記載していません。

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2022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(2022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(2022年3月31日)

## 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額

区分	当事業年度 (百万円)
子会社株式	9,107
関連会社株式	106

## 4．その他有価証券(2022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	29,300	29,300	-
小計	29,300	29,300	-
合計	29,300	29,300	-

市場価格のない株式等（貸借対照表計上額315百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額1,886百万円）は、記載していません。

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当事項はありません。

## デリバティブ取引関係

## 1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

## 前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

## 当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

区分	取引の種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち一年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,714	-	121	121

## 退職給付関係

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	23,761 百万円
勤務費用	1,016
利息費用	139
数理計算上の差異の発生額	893
退職給付の支払額	781
その他	28
退職給付債務の期末残高	23,270

## (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	17,413 百万円
期待運用収益	409
数理計算上の差異の発生額	1,328
事業主からの拠出額	824
退職給付の支払額	626
年金資産の期末残高	19,349

## (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	19,959 百万円
年金資産	19,349
	610
非積立型制度の退職給付債務	3,311
未積立退職給付債務	3,921
未認識数理計算上の差異	2,074
未認識過去勤務費用	151
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998
退職給付引当金	3,299
前払年金費用	1,301
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	1,016 百万円
利息費用	139
期待運用収益	409
数理計算上の差異の費用処理額	469
過去勤務費用の費用処理額	34
確定給付制度に係る退職給付費用	1,182

## (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	52%
株式	30%
生保一般勘定	11%
生保特別勘定	7%
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	0.8%
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、206百万円でした。	

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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	23,270 百万円
勤務費用	961
利息費用	176
数理計算上の差異の発生額	1,521
退職給付の支払額	904
その他	14
退職給付債務の期末残高	21,967

(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	19,349 百万円
期待運用収益	454
数理計算上の差異の発生額	258
事業主からの拠出額	814
退職給付の支払額	672
年金資産の期末残高	19,687

(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	18,807 百万円
年金資産	19,687
	879
非積立型制度の退職給付債務	3,159
未積立退職給付債務	2,279
未認識数理計算上の差異	489
未認識過去勤務費用	106
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,896
退職給付引当金	3,194
前払年金費用	1,297
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,896

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	961 百万円
利息費用	176
期待運用収益	454
数理計算上の差異の費用処理額	322
過去勤務費用の費用処理額	45
確定給付制度に係る退職給付費用	959

## (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	51%
株式	32%
生保一般勘定	10%
生保特別勘定	6%
その他	1%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

## 税効果会計関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022年3月31日)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
繰延税金資産 百万円	繰延税金資産 百万円
賞与引当金 1,176	賞与引当金 1,381
退職給付引当金 1,022	退職給付引当金 990
関係会社株式評価減 784	関係会社株式評価減 1,010
未払事業税 430	未払事業税 285
投資有価証券評価減 428	投資有価証券評価減 110
減価償却超過額 223	減価償却超過額 272
時効後支払損引当金 179	時効後支払損引当金 182
関係会社株式売却損 148	関係会社株式売却損 505
ゴルフ会員権評価減 135	ゴルフ会員権評価減 92
資産除去債務 425	資産除去債務 348
未払社会保険料 95	未払社会保険料 114
その他 358	その他 84
繰延税金資産小計 5,410	繰延税金資産小計 5,376
評価性引当額 1,530	評価性引当額 1,795
繰延税金資産合計 3,879	繰延税金資産合計 3,581
繰延税金負債	繰延税金負債
資産除去債務に対応する除去費用 361	資産除去債務に対応する除去費用 233
関係会社株式評価益 80	関係会社株式評価益 81
その他有価証券評価差額金 25	その他有価証券評価差額金 78
前払年金費用 403	前払年金費用 402
繰延税金負債合計 871	繰延税金負債合計 796
繰延税金資産の純額 3,008	繰延税金資産の純額 2,784

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 (調整)	法定実効税率 (調整)
31.0%	31.0%
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
0.0%	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	受取配当金等永久に益金に算入されない項目
3.5%	2.9%
タックスヘイブン税制	タックスヘイブン税制
1.9%	1.8%
外国税額控除	外国税額控除
0.5%	0.5%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税
0.2%	0.4%
その他	その他
0.3%	0.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	税効果会計適用後の法人税等の負担率
29.4%	29.9%

### 資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

#### 1. 当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

#### 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を当該不動産賃貸借契約期間とし、割引率は0.0%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

#### 3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：百万円)

	前事業年度		当事業年度	
	自	2020年4月1日 至 2021年3月31日	自	2021年4月1日 至 2022年3月31日
期首残高		-		1,371
有形固定資産の取得に伴う増加		1,371		48
資産除去債務の履行による減少		-		296
期末残高		1,371		1,123

### 収益認識に関する注記

#### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

委託者報酬	115,670百万円
運用受託報酬	16,675百万円
成功報酬（注）	1,058百万円
その他営業収益	530百万円
合計	133,935百万円

（注）成功報酬は、損益計算書において委託者報酬または運用受託報酬に含めて表示しております。

## 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

[重要な会計方針] 7. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

## 3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## セグメント情報等

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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 2021年4月1日 至 2022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 2020年4月1日 至 2021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

（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(*1)	26,722	未払手数料	5,690
							コマーシャル・ペーパーの償還(*2)	20,000	有価証券	-
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

##### （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) 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) コマーシャル・ペーパーの購入については、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. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

##### （１）親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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

該当はありません。

## (イ) 子会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
子会社	ノムラ・エー ム・ファイ ナンス・イン ク	ケイマン	2,500 (米ドル)	資金管理	直接100%	資産の賃貸借	資金の貸付	3,427	短期貸付 金	1,835
							資金の返済	1,709		
							貸付金利息 の受取	9	未収利息	4

## (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都 中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託 の募集の取扱 及び売上の取 扱ならびに投 資信託に係る 事務代行の委 託等 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払(*1)	29,119	未払手 数料	6,013

## (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) 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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
1株当たり純資産額	17,018円01銭	1株当たり純資産額	16,775円81銭
1株当たり当期純利益	5,101円61銭	1株当たり当期純利益	4,835円10銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	26,276百万円	損益計算書上の当期純利益	24,904百万円
普通株式に係る当期純利益	26,276百万円	普通株式に係る当期純利益	24,904百万円
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 <sup>*</sup>	(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。

\* 2022年5月末現在

## (2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323百万円	
株式会社十八親和銀行	36,878百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社筑波銀行	48,868百万円	
株式会社トマト銀行	17,810百万円	
株式会社沖縄海邦銀行	4,537百万円	

\* 2022年5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

販売会社として、募集の取扱いおよび販売を行ない、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、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。

一般コースのみを取り扱う販売会社は、収益分配金の再投資に関する事務を行ないません。

## 3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

### 第3【その他】

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

## 独立監査人の監査報告書

2022年6月7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 東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	湯原	尚
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	津村	健二郎
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	水永	真太郎

#### 監査意見

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2021年4月1日から2022年3月31日までの第63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。

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2022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、全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。

#### 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

#### その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

## 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. 上記の監査報告書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

2022年7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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚  
業務執行社員

## 監査意見

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」に掲げられているバランスセレクト70の2021年5月11日から2022年5月10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。

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、バランスセレクト70の2022年5月10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、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

### 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. 上記の監査報告書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。