

## 【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】	2020年6月18日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-3241-9511
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	マイバランスDC70
【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】

マイバランスDC70

（以下「ファンド」といいます。）

ファンドは、「確定拠出年金法」に基づいて、個人又は事業主が拠出した資金を運用するためのファンドです。ファンドを購入できる投資者については、後述の「(12)その他 申込みの方法」をご参照ください。

### （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口当たり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、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で、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】**

なし

**( 6 ) 【申込単位】**

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

**( 7 ) 【申込期間】**

2020年6月19日から2021年6月23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】**

取得申込日の翌々営業日までに申込金額を申込みの販売会社に支払うものとします。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に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、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。）の指定する口座を経由して、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

## ( 1 2 ) 【その他】

## 申込みの方法

受益権の申込みを行なう投資者は、販売会社所定の方法で申込みを行ないます。

受益権の申込みを行なう投資者は、確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会（以下「連合会」といいます。）等に限るものとします。

購入、換金の各お申込みの方法ならびに単位、および分配金のお取扱い等について、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。

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。)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、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（「振替制度」と称する場合があります。）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】

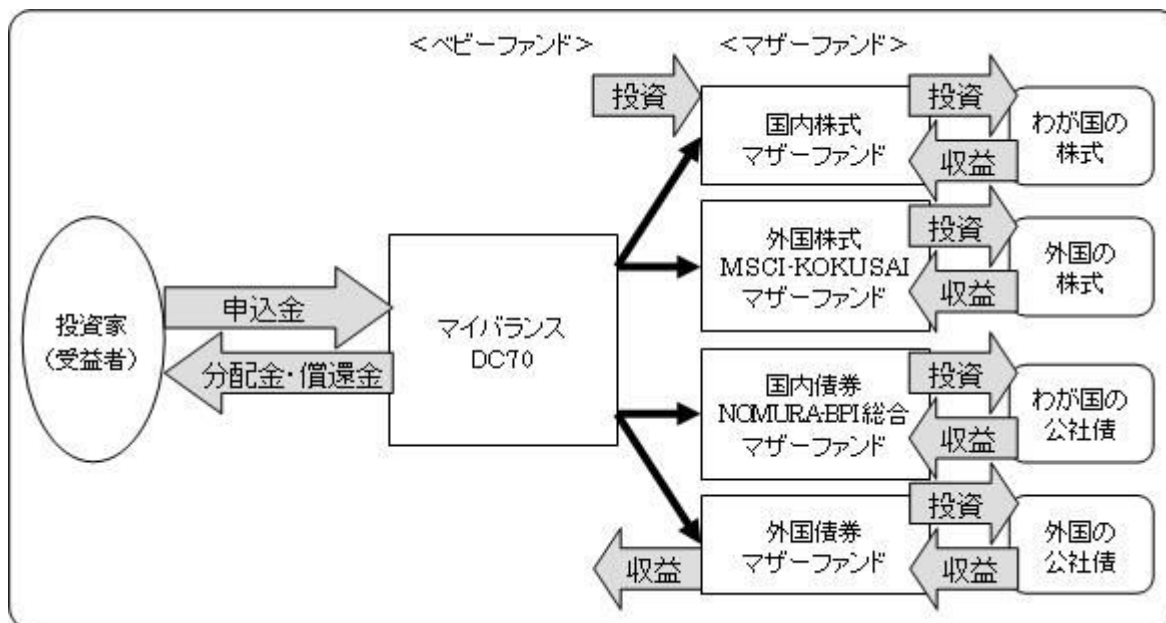
ファンドは、「確定拠出年金法」に基づいて、個人又は事業主が拠出した資金を運用するためのファンドです。

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NOMURA-BPI総合マザーファンド」「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。

##### 《ファミリーファンド方式について》

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NOMURA-BPI総合マザーファンド」「外国債券マザーファンド」をマザーファンドとするファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様が投資した資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行なうしくみをいいます。



マザーファンドの運用の方針等については、「第1 ファンドの状況 2 投資方針（参考）各マザーファンドの概要」をご参照ください。

ファンドは、マザーファンドのほか、株式および公社債に直接投資する場合があります。分配金は、無手数料で再投資されます。

#### 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。

<商品分類>

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

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

(マイバランスDC70)

《商品分類表》

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

《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	<b>年1回</b>	<b>グローバル (日本を含む)</b>			
	年2回	日本			日経225
	年4回	北米	<b>ファミリーファンド</b>	あり ( )	
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			T O P I X
	年12回 (毎月)	アジア			
	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)			
		エマージング			
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型					

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。

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」による区別のほか、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、為替のヘッジを行な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〕

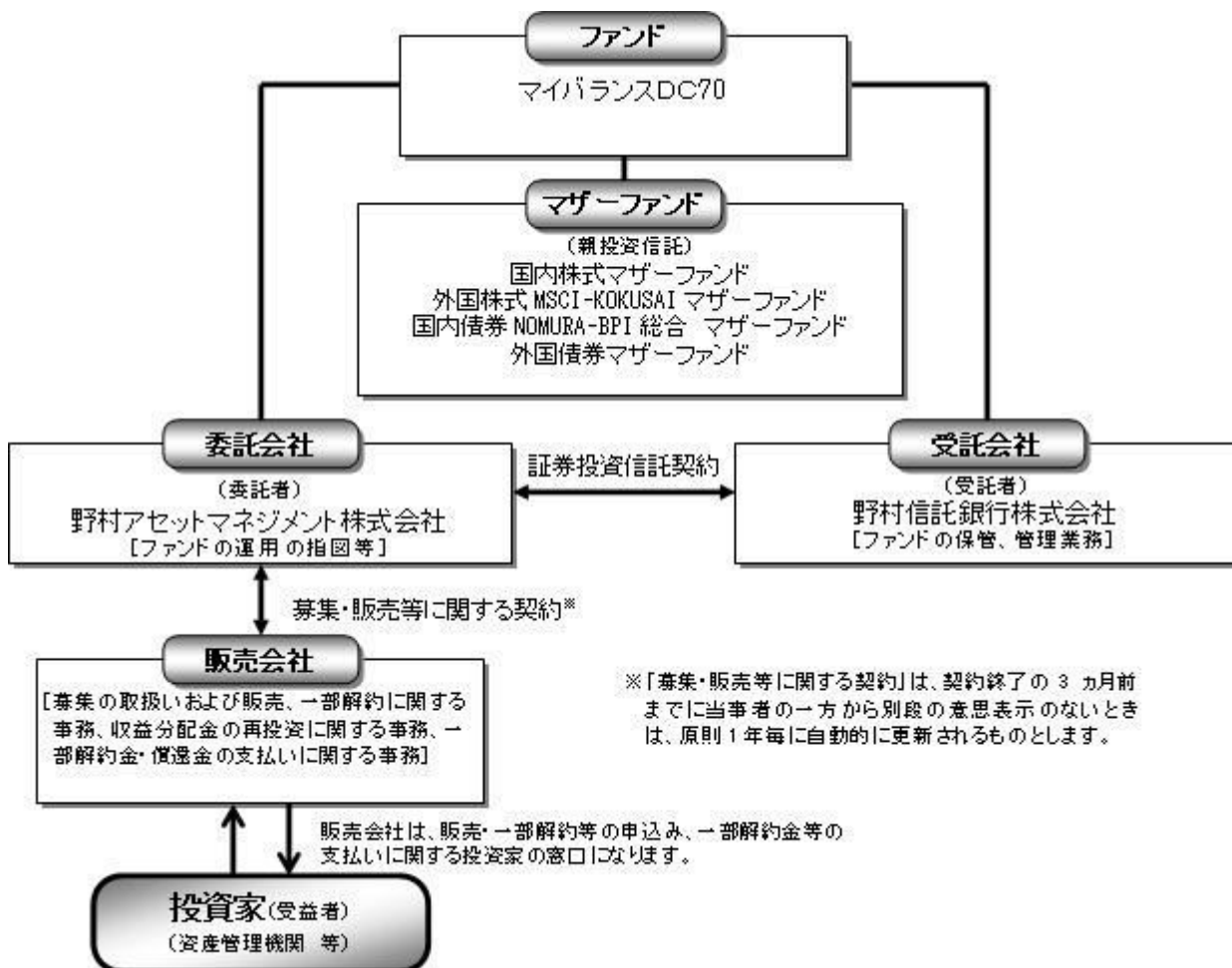
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定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

2007年9月27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】



## 委託会社の概況(2020年4月末現在)

## ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

## ・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

## ・資本金の額

17,180百万円

## ・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

## ・大株主の状況

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

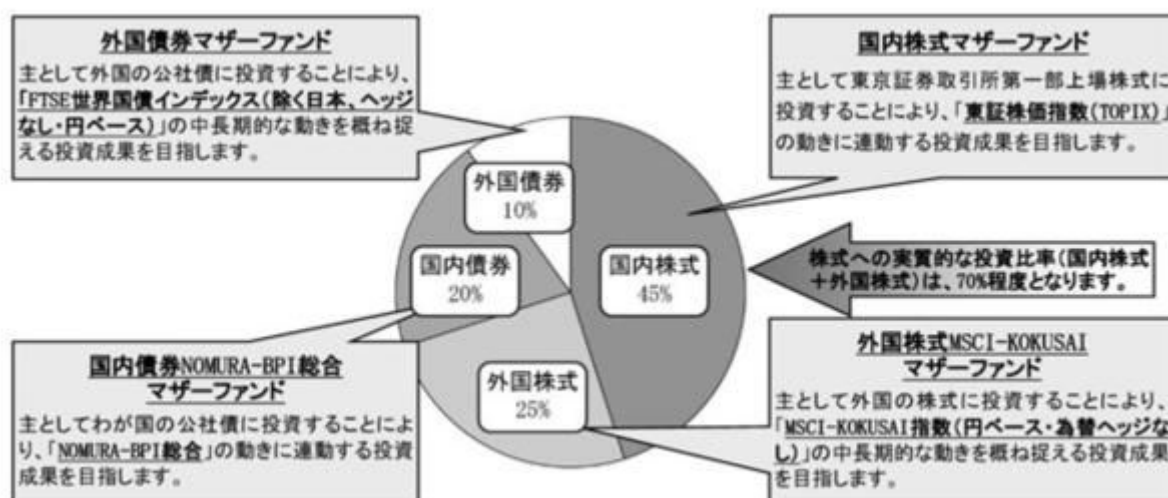
## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

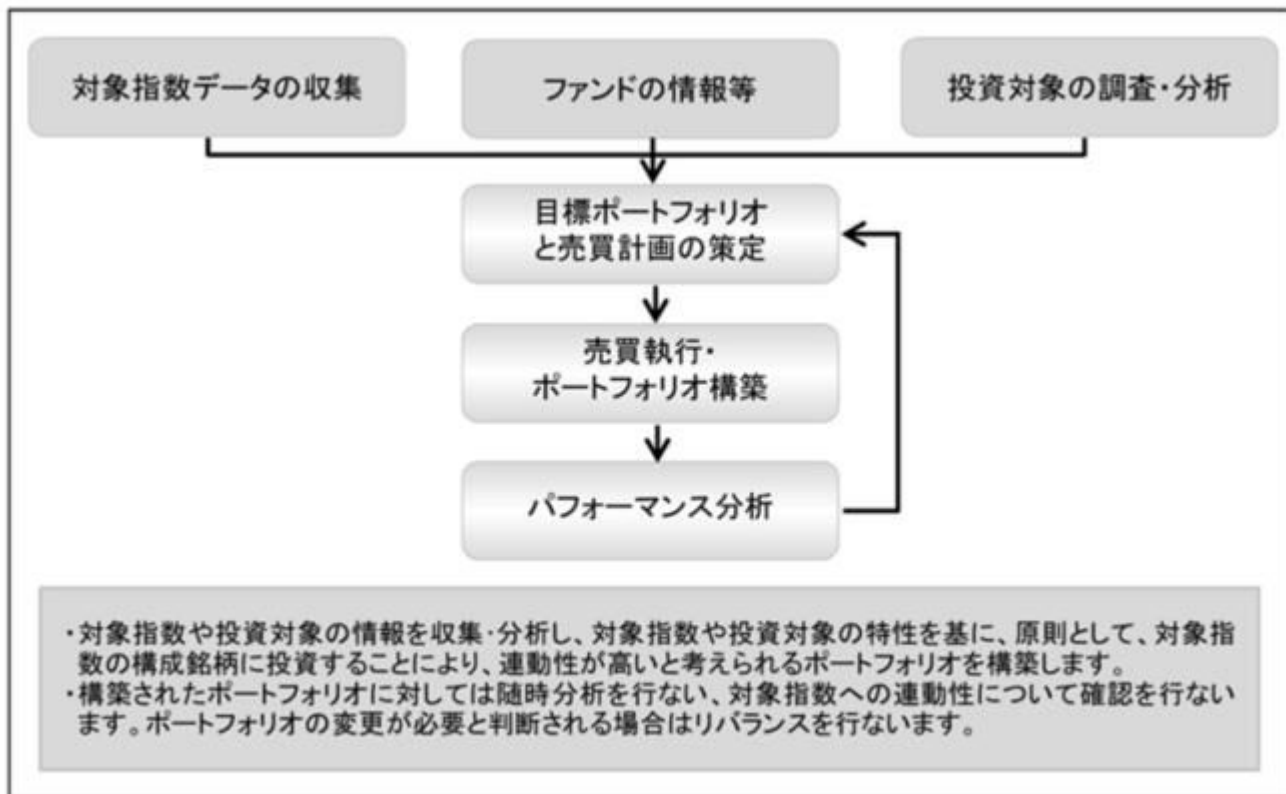
[1] 内外の株式および公社債に実質的に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

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NOMURA-BPI総合マザーファンド」「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について

##### 国内株式マザーファンド：東証株価指数(TOPIX)

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

東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(以下「(株)東京証券取引所」という。)の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。

(株)東京証券取引所は、TOPIXの算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行なう権利を有しています。

##### 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド：MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)

MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)は、MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

MSCI-KOKUSAI指数は、MSCIが開発した、日本を除く先進国で構成された時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。同指数の著作権、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。

##### 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド：NOMURA-BPI総合

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

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證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、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。

外国債券マザーファンド：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。

[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NOMURA-BPI総合マザーファンド」「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。

マザーファンドの主要投資対象

[1] 国内株式マザーファンド

わが国の株式を主要投資対象とします。

[2] 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

外国の株式を主要投資対象とします。

[3] 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド

わが国の公社債を主要投資対象とします。

[4] 外国債券マザーファンド

外国の公社債を主要投資対象とします。

なお、デリバティブの利用は、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15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)投資制限及び」に定めるものに限り、)に係る権利

ハ 約束手形(イに掲げるものに該当するものを除きます。)

ニ 金銭債権(イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。)

2 次に掲げる特定資産以外の資産

イ 為替手形

有価証券の指図範囲(約款第16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NOMURA-BPI総合マザーファンド受益証券(以下「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」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券
- 2 国債証券
- 3 地方債証券
- 4 特別の法律により法人の発行する債券(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 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 8 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 9 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 10 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 11 コマーシャル・ペーパー
- 12 新株引受権証券(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
- 13 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
- 14 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 15 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 16 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 17 預託証券(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。)
- 18 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19 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
- 20 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
- 21 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。)

22 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

なお、第1号の証券または証書、第13号ならびに第17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7号までの証券および第13号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第7号までの証券の性質を有するものを「公社債」といい、第14号および第15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16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。

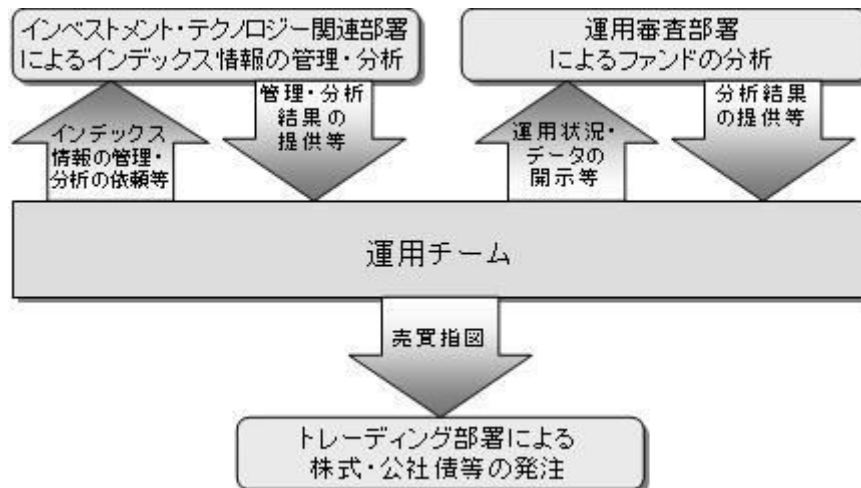
- 1 預金
- 2 指定金銭信託(上記「(2)投資対象 有価証券の指図範囲」に掲げるものを除く。)
- 3 コール・ローン
- 4 手形割引市場において売買される手形
- 5 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

その他の投資対象

- 1 先物取引等
- 2 スワップ取引

### (3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。

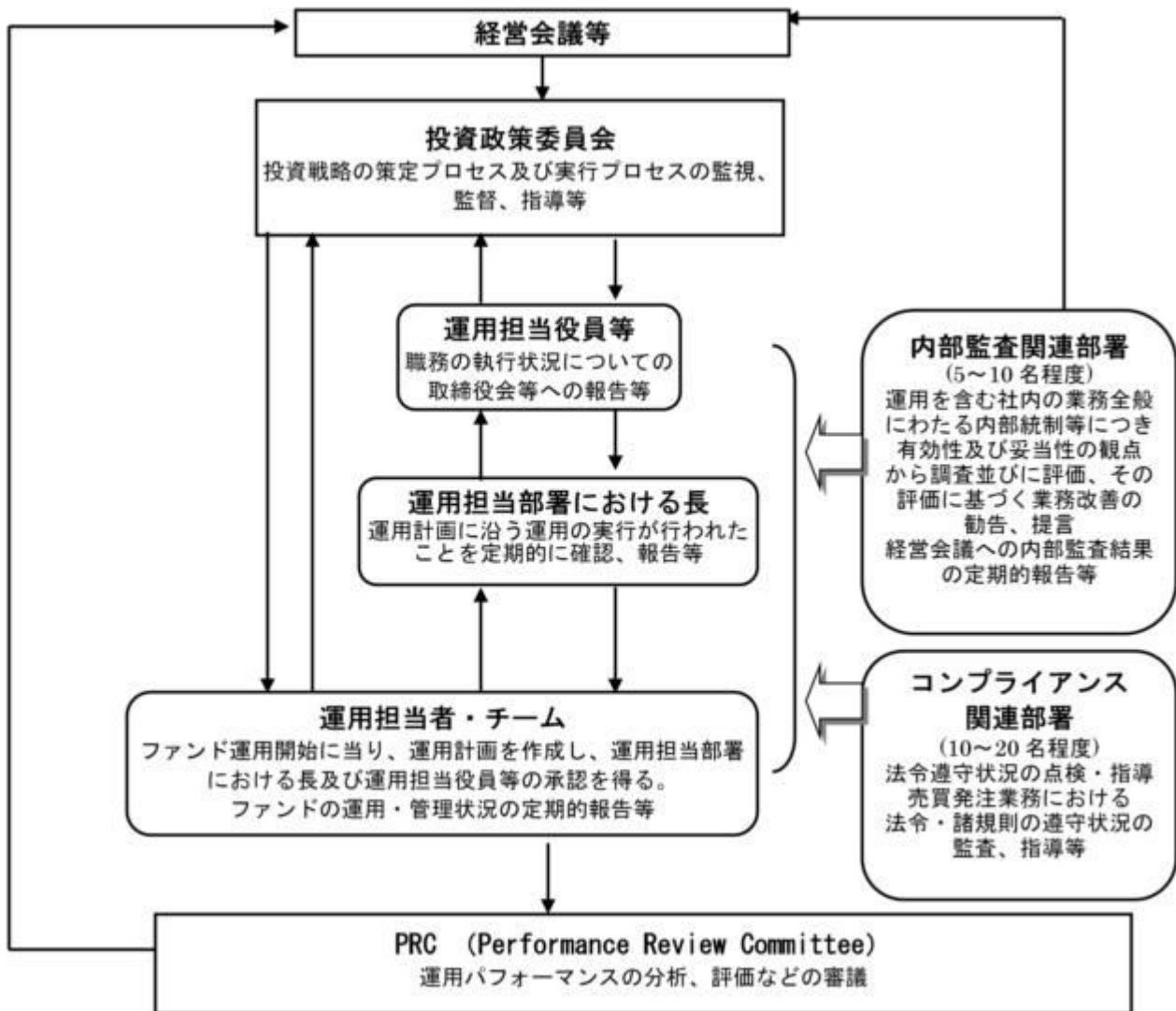


運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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

す。



#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

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いません。

分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益(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および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)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3月31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。

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。

デリバティブの利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23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(以下本号において「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24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(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- ( )スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ( )スワップ取引の指図にあたっては、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。

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。

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。

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。

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19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。

#### 信用取引の指図範囲(約款第22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せん。)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26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%を超えないものとします。
  - 2 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- ( )上記( )に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ( )委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第28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る場合には、制約されることがあります。

#### 外国為替予約の指図(約款第29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37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(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

委託者は、同一の法人の発行する株式を、次の( )の数が( )の数を越えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

- ( )その運用の指図を行なうすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として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

(参考)各マザーファンドの概要

(国内株式マザーファンド)

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1.基本方針

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

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

(外国株式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NOMURA-BPI総合 マザーファンド)

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

(外国債券マザーファンド)

## 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【投資リスク】

### 基準価額の変動要因

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

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

### [株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

### [為替変動リスク]

ファンドは、実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジ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。

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

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

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

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

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

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

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

#### 外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンドについて

##### 「MSCI」の著作権等について

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



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

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

## 委託会社におけるリスクマネジメント体制

### リスク管理関連の委員会

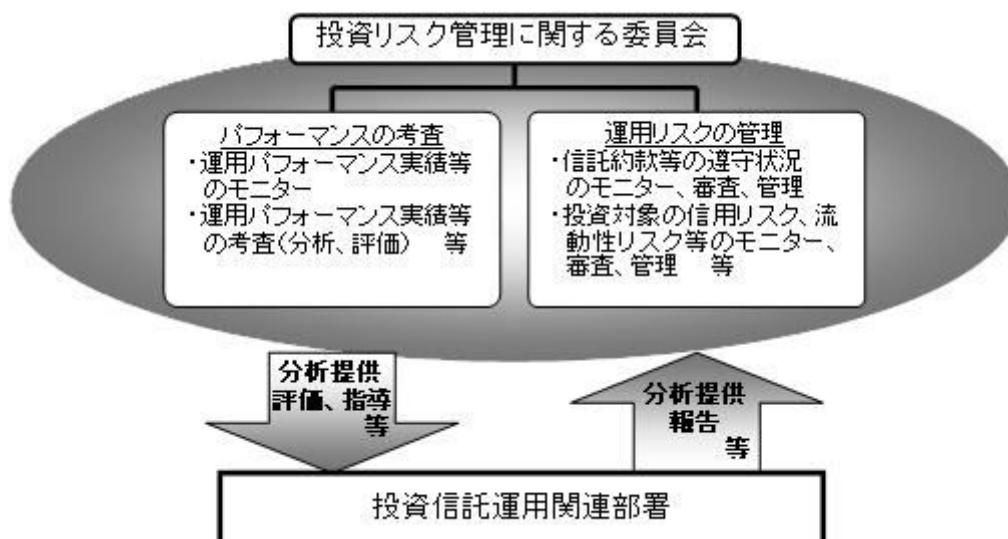
#### パフォーマンスの考査

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

#### 運用リスクの管理

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

### リスク管理体制図



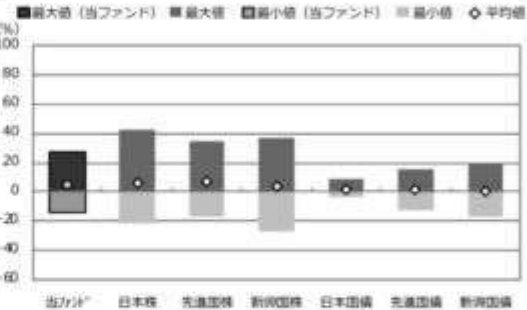
投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

## ■ リスクの定量的比較 (2015年5月末～2020年4月末；月次)

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	27.1	41.9	34.1	37.2	9.3	15.3	19.3
最小値 (%)	△14.4	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値 (%)	4.8	6.1	7.5	3.5	1.9	1.1	0.4

- 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。2015年5月末を10,000として指数化しております。
- 年間騰落率は、2015年5月から2020年4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。
- 2015年5月から2020年4月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- 決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

### <代表的な資産クラスの指数>

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

### ■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

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

申込手数料はありません。

## ( 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0.154% (税抜年0.14%)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0.06%	年0.06%	年0.02%

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	口座内でのファンドの管理および事務手続き、購入後の情報提供、各種書類の送付等	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】

信託財産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。

信託財産に関する租税、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る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用は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から支払われます。

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

## ( 5 ) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税、復興

特別所得税および地方税がかかりません。

なお、上記以外の受益者(法人)の場合の課税の取扱いは下記の通りです。

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(所得税及び復興特別所得税)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。

#### 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。

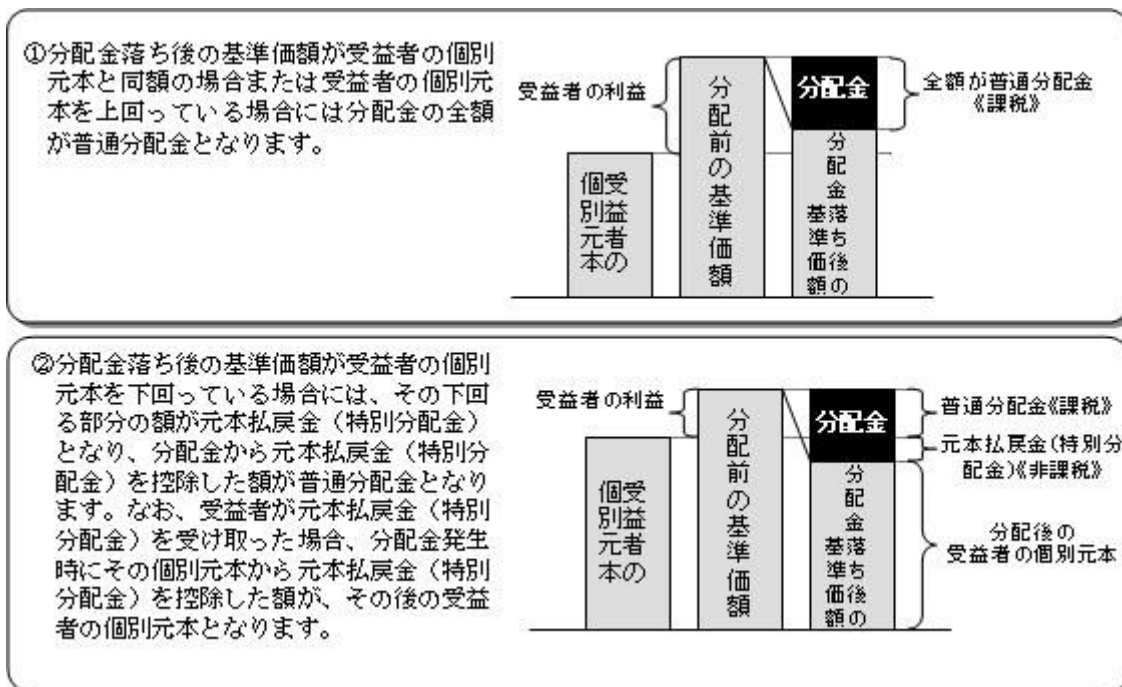
#### 換金(解約)時および償還時の課税について

換金(解約)時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

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。

#### 分配金の課税について

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



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

外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容(2020年4月末現在)が変更になる場合があります。

## 5【運用状況】

以下は2020年4月30日現在の運用状況であります。

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

### (1)【投資状況】

#### マイバランスDC70

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	16,363,898,150	99.96
現金・預金・その他資産(負債控除後)		6,536,378	0.03
合計(純資産総額)		16,370,434,528	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	406,761,825,500	97.70
現金・預金・その他資産(負債控除後)		9,564,679,259	2.29
合計(純資産総額)		416,326,504,759	100.00

#### その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	9,552,780,000	2.29

#### (参考)外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	423,347,029,460	68.54
	カナダ	21,161,870,933	3.42
	ドイツ	17,518,486,054	2.83
	イタリア	4,272,211,096	0.69
	フランス	21,288,126,825	3.44
	オランダ	8,117,285,020	1.31
	スペイン	5,106,364,081	0.82
	ベルギー	1,846,542,694	0.29

	オーストリア	379,452,008	0.06
	ルクセンブルグ	221,656,860	0.03
	フィンランド	2,070,293,528	0.33
	アイルランド	1,181,021,868	0.19
	ポルトガル	351,560,504	0.05
	イギリス	30,983,331,615	5.01
	スイス	21,641,992,069	3.50
	スウェーデン	5,753,216,505	0.93
	ノルウェー	1,139,751,211	0.18
	デンマーク	4,531,121,264	0.73
	オーストラリア	11,950,350,085	1.93
	ニュージーランド	655,256,334	0.10
	香港	6,853,506,285	1.10
	シンガポール	2,167,088,281	0.35
	イスラエル	698,235,714	0.11
	小計	593,235,750,294	96.04
投資証券	アメリカ	13,500,755,617	2.18
	カナダ	134,220,106	0.02
	フランス	411,584,762	0.06
	イギリス	369,000,616	0.05
	オーストラリア	853,677,367	0.13
	香港	368,579,120	0.05
	シンガポール	286,288,666	0.04
	小計	15,924,106,254	2.57
現金・預金・その他資産（負債控除後）		8,492,218,479	1.37
合計（純資産総額）		617,652,075,027	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	6,081,795,359	0.98
	買建	カナダ	295,688,190	0.04
	買建	ドイツ	873,902,240	0.14
	買建	イギリス	438,574,685	0.07
	買建	スイス	301,237,641	0.04
	買建	オーストラリア	177,812,640	0.02

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

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

国債証券	日本	533,780,142,530	78.48
地方債証券	日本	47,396,193,903	6.96
特殊債券	日本	61,794,213,015	9.08
社債券	日本	29,462,872,750	4.33
現金・預金・その他資産（負債控除後）		7,665,374,509	1.12
合計（純資産総額）		680,098,796,707	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	286,346,239,336	50.09
	カナダ	10,661,364,453	1.86
	メキシコ	3,973,150,524	0.69
	ドイツ	27,877,712,052	4.87
	イタリア	51,205,716,578	8.95
	フランス	51,805,833,335	9.06
	オランダ	7,934,258,882	1.38
	スペイン	35,014,332,710	6.12
	ベルギー	12,709,494,507	2.22
	オーストリア	6,546,796,155	1.14
	フィンランド	2,223,984,492	0.38
	アイルランド	5,453,291,898	0.95
	イギリス	36,695,649,894	6.41
	スウェーデン	1,543,405,713	0.26
	ノルウェー	1,247,241,607	0.21
	デンマーク	2,657,207,732	0.46
	ポーランド	3,182,255,154	0.55
	オーストラリア	10,525,954,669	1.84
	シンガポール	2,366,141,363	0.41
	マレーシア	2,532,570,374	0.44
南アフリカ	2,410,843,578	0.42	
	小計	564,913,445,006	98.82
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,722,935,565	1.17
合計（純資産総額）		571,636,380,571	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

マイバランスDC70

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	4,904,462,082	1.4355	7,040,672,868	1.4978	7,345,903,306	44.87
2	日本	親投資信託受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,584,836,154	2.4091	3,818,028,779	2.6460	4,193,476,463	25.61
3	日本	親投資信託受益証券	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	2,407,540,599	1.3340	3,211,865,385	1.3385	3,222,493,091	19.68
4	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	677,074,211	2.4108	1,632,312,369	2.3661	1,602,025,290	9.78

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.96
合計	99.96

## (参考)国内株式マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	2,205,300	6,631.97	14,625,483,441	6,666.00	14,700,529,800	3.53
2	日本	株式	ソニー	電気機器	1,238,100	5,562.42	6,886,832,202	6,932.00	8,582,509,200	2.06
3	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,538,800	5,300.12	8,155,824,656	4,633.00	7,129,260,400	1.71
4	日本	株式	キーエンス	電気機器	179,100	33,394.44	5,980,944,309	38,770.00	6,943,707,000	1.66
5	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,644,400	4,206.00	6,916,346,400	3,883.00	6,385,205,200	1.53
6	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,592,500	2,404.18	6,232,836,650	2,443.00	6,333,477,500	1.52
7	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	13,334,800	523.94	6,986,635,112	434.30	5,791,303,640	1.39
8	日本	株式	任天堂	その他製品	121,200	37,452.52	4,539,246,233	44,650.00	5,411,580,000	1.29
9	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,432,600	2,549.58	3,652,528,308	3,148.00	4,509,824,800	1.08
10	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,445,300	2,620.89	3,787,972,317	3,109.00	4,493,437,700	1.07
11	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,352,900	3,314.12	4,483,672,948	3,182.00	4,304,927,800	1.03
12	日本	株式	第一三共	医薬品	565,600	5,735.87	3,244,208,072	7,382.00	4,175,259,200	1.00
13	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,556,200	2,821.43	4,390,709,366	2,610.50	4,062,460,100	0.97
14	日本	株式	信越化学工業	化学	332,400	9,791.27	3,254,618,148	12,015.00	3,993,786,000	0.95
15	日本	株式	花王	化学	473,200	8,381.86	3,966,296,152	8,316.00	3,935,131,200	0.94
16	日本	株式	HOYA	精密機器	394,700	7,946.74	3,136,578,278	9,866.00	3,894,110,200	0.93
17	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,348,200	3,829.12	5,162,419,584	2,844.00	3,834,280,800	0.92
18	日本	株式	ダイキン工業	機械	251,800	13,701.68	3,450,083,024	14,005.00	3,526,459,000	0.84
19	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	689,200	5,493.32	3,785,996,144	5,086.00	3,505,271,200	0.84
20	日本	株式	村田製作所	電気機器	580,600	5,075.67	2,946,934,002	6,019.00	3,494,631,400	0.83
21	日本	株式	ファナック	電気機器	187,800	19,129.24	3,592,471,272	17,830.00	3,348,474,000	0.80



22	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	26,488,500	165.37	4,380,403,245	125.80	3,332,253,300	0.80
23	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,366,000	2,817.69	3,848,964,540	2,300.00	3,141,800,000	0.75
24	日本	株式	日立製作所	電気機器	949,700	3,745.31	3,556,920,907	3,241.00	3,077,977,700	0.73
25	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,713,700	1,475.67	2,528,855,679	1,786.50	3,061,525,050	0.73
26	日本	株式	S M C	機械	62,000	42,138.54	2,612,590,011	49,000.00	3,038,000,000	0.72
27	日本	株式	日本電産	電気機器	475,700	7,362.81	3,502,488,717	6,286.00	2,990,250,200	0.71
28	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,361,500	2,007.57	2,733,306,555	2,125.00	2,893,187,500	0.69
29	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	125,400	17,339.68	2,174,396,916	22,940.00	2,876,676,000	0.69
30	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	164,300	21,918.61	3,601,227,623	17,005.00	2,793,921,500	0.67

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.20
		建設業	2.58
		食料品	3.92
		繊維製品	0.50
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.23
		医薬品	6.48
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.62
		ガラス・土石製品	0.73
		鉄鋼	0.54
		非鉄金属	0.64
		金属製品	0.52
		機械	4.93
		電気機器	14.36
		輸送用機器	7.21
		精密機器	2.52
		その他製品	2.40
		電気・ガス業	1.62
		陸運業	4.19
		海運業	0.13
		空運業	0.34
		倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	9.57		
卸売業	4.55		
小売業	4.64		
銀行業	5.05		
証券、商品先物取引業	0.76		
保険業	2.14		

	その他金融業	1.06
	不動産業	2.12
	サービス業	5.02
合 計		97.70

## (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	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,147,800	17,133.39	19,665,714,684	18,961.94	21,764,519,438	3.52
2	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	703,700	27,258.26	19,181,639,110	30,749.70	21,638,567,479	3.50
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	66,740	210,198.32	14,028,636,424	253,571.51	16,923,363,091	2.73
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	380,900	17,743.62	6,758,547,182	20,753.08	7,904,850,191	1.27
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	48,940	122,664.31	6,003,191,688	143,363.96	7,016,232,574	1.13
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	47,420	122,605.53	5,813,954,650	143,438.77	6,801,866,786	1.10
7	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	416,600	14,229.74	5,928,109,892	16,056.14	6,688,991,590	1.08
8	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	471,000	10,930.38	5,148,212,136	11,275.28	5,310,656,974	0.85
9	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	271,000	17,695.53	4,795,489,876	19,427.89	5,264,960,168	0.85
10	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	496,300	9,987.00	4,956,548,845	10,458.29	5,190,453,397	0.84
11	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	394,600	12,293.25	4,850,918,857	12,512.33	4,937,369,206	0.79
12	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	149,890	26,870.32	4,027,592,879	30,741.15	4,607,791,798	0.74
13	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・ 半導体製 造装置	688,200	5,932.35	4,082,645,816	6,604.56	4,545,262,321	0.73
14	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術 サービス	142,000	27,066.96	3,843,509,016	30,317.95	4,305,148,943	0.69
15	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	207,900	19,578.58	4,070,387,614	20,263.62	4,212,806,744	0.68
16	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	111,150	33,822.55	3,759,377,088	37,429.15	4,160,250,745	0.67
17	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売 り	172,500	20,956.13	3,614,933,857	23,704.83	4,089,083,986	0.66
18	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気 通信サー ビス	654,200	5,854.33	3,829,908,312	6,211.28	4,063,422,254	0.65

19	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	1,155,400	3,229.61	3,731,493,011	3,358.92	3,880,900,905	0.62
20	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,351,000	2,354.34	3,180,721,582	2,648.23	3,577,770,349	0.57
21	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	875,200	3,493.58	3,057,581,479	4,073.88	3,565,463,627	0.57
22	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	402,700	8,226.85	3,312,953,542	8,631.88	3,476,062,063	0.56
23	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	285,000	10,668.83	3,040,617,149	11,996.15	3,418,904,888	0.55
24	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	669,000	4,009.76	2,682,531,046	5,072.05	3,393,201,584	0.54
25	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	643,600	4,810.21	3,095,856,755	5,035.71	3,240,985,788	0.52
26	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品	339,700	8,524.89	2,895,905,608	9,313.21	3,163,700,630	0.51
27	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	220,500	13,416.45	2,958,329,386	14,252.18	3,142,606,396	0.50
28	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	670,800	4,308.99	2,890,476,127	4,631.74	3,106,975,083	0.50
29	アメリカ	株式	NETFLIX INC	娯楽	69,300	39,692.58	2,750,696,258	44,018.68	3,050,494,822	0.49
30	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	298,900	7,697.84	2,300,886,200	10,112.03	3,022,488,577	0.48

## 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	3.73
		メディア	1.15
		娯楽	1.45
		不動産管理・開発	0.46
		エネルギー設備・サービス	0.15
		石油・ガス・消耗燃料	3.69
		化学	2.13
		建設資材	0.24
		容器・包装	0.28
		金属・鉱業	1.36
		紙製品・林産品	0.08
		航空宇宙・防衛	1.64
		建設関連製品	0.44
		建設・土木	0.28
		電気設備	0.71
		コングロマリット	1.14
		機械	1.55
		商社・流通業	0.26
		商業サービス・用品	0.43
		航空貨物・物流サービス	0.49
旅客航空輸送業	0.05		
海運業	0.04		
陸運・鉄道	1.03		
運送インフラ	0.16		
自動車部品	0.23		

自動車	0.82
家庭用耐久財	0.33
レジャー用品	0.03
繊維・アパレル・贅沢品	1.34
ホテル・レストラン・レジャー	1.55
販売	0.05
インターネット販売・通信販売	3.34
複合小売り	0.49
専門小売り	1.69
食品・生活必需品小売り	1.61
飲料	1.88
食品	2.06
タバコ	0.86
家庭用品	1.47
パーソナル用品	0.68
ヘルスケア機器・用品	3.09
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.13
バイオテクノロジー	2.17
医薬品	6.22
銀行	5.82
各種金融サービス	0.91
保険	3.24
情報技術サービス	4.53
ソフトウェア	6.54
通信機器	0.77
コンピュータ・周辺機器	3.73
電子装置・機器・部品	0.52
半導体・半導体製造装置	3.71
各種電気通信サービス	1.98
無線通信サービス	0.28
電力	2.15
ガス	0.18
総合公益事業	1.08
水道	0.12
消費者金融	0.36
資本市場	2.94
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.12
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.92
専門サービス	0.79
投資証券	2.57
合計	98.62

## (参考) 国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	7,500,000,000	100.40	7,530,375,000	100.47	7,535,700,000	0.1	2021/12/20	1.10
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 9回	7,000,000,000	100.34	7,024,220,000	100.41	7,028,700,000	0.1	2021/9/20	1.03
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	6,600,000,000	103.07	6,802,950,000	103.25	6,814,566,000	0.6	2024/6/20	1.00
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 3回	6,200,000,000	100.62	6,238,440,000	100.70	6,243,896,000	0.1	2022/9/20	0.91
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	6,000,000,000	102.47	6,148,680,000	102.67	6,160,500,000	0.3	2025/12/20	0.90
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 50回	5,850,000,000	101.64	5,946,349,500	101.95	5,964,309,000	0.1	2028/3/20	0.87
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 8回	5,900,000,000	100.82	5,948,498,000	101.04	5,961,537,000	0.1	2023/12/20	0.87
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	5,800,000,000	101.50	5,887,058,000	101.74	5,901,094,000	0.1	2026/9/20	0.86
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 51回	5,600,000,000	101.57	5,688,088,000	101.93	5,708,248,000	0.1	2028/6/20	0.83
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	5,400,000,000	102.69	5,545,260,000	102.87	5,555,250,000	0.6	2023/12/20	0.81
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	5,400,000,000	101.41	5,476,140,000	101.67	5,490,396,000	0.1	2026/6/20	0.80
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	5,300,000,000	103.00	5,459,318,000	103.09	5,463,823,000	0.8	2023/6/20	0.80
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 52回	5,300,000,000	101.49	5,379,353,000	101.86	5,398,792,000	0.1	2028/9/20	0.79
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	5,200,000,000	102.83	5,347,316,000	102.98	5,355,220,000	0.5	2024/9/20	0.78
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 53回	5,100,000,000	101.40	5,171,502,000	101.78	5,191,137,000	0.1	2028/12/20	0.76
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 55回	5,100,000,000	101.15	5,158,905,000	101.61	5,182,110,000	0.1	2029/6/20	0.76
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,000,000,000	102.20	5,110,200,000	102.26	5,113,050,000	0.6	2023/3/20	0.75
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	5,000,000,000	101.59	5,079,650,000	101.81	5,090,600,000	0.1	2026/12/20	0.74
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 47回	4,200,000,000	118.53	4,978,554,000	119.85	5,034,078,000	1.6	2033/12/20	0.74
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 46回	4,900,000,000	101.68	4,982,712,000	101.84	4,990,405,000	0.1	2027/3/20	0.73

21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 1回	4,800,000,000	100.47	4,822,704,000	100.54	4,826,304,000	0.1	2022/3/20	0.70
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 48回	4,600,000,000	101.81	4,683,352,000	101.94	4,689,424,000	0.1	2027/9/20	0.68
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	4,400,000,000	102.34	4,503,092,000	102.37	4,504,500,000	0.8	2022/9/20	0.66
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 56回	4,400,000,000	100.99	4,443,736,000	101.51	4,466,440,000	0.1	2029/9/20	0.65
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 9回	4,400,000,000	100.87	4,438,544,000	101.11	4,449,060,000	0.1	2024/3/20	0.65
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 54回	4,350,000,000	101.25	4,404,766,500	101.70	4,423,993,500	0.1	2029/3/20	0.65
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	4,200,000,000	102.92	4,322,640,000	103.10	4,330,200,000	0.4	2025/9/20	0.63
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 33回	4,200,000,000	102.86	4,320,498,000	103.07	4,328,982,000	0.6	2024/3/20	0.63
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	4,200,000,000	102.62	4,310,168,000	102.80	4,317,894,000	0.4	2025/3/20	0.63
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 39回	4,000,000,000	102.78	4,111,400,000	102.95	4,118,120,000	0.4	2025/6/20	0.60

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	78.48
地方債証券	6.96
特殊債券	9.08
社債券	4.33
合計	98.87

## (参考)外国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	72,200,000	13,190.51	9,523,553,972	14,101.82	10,181,521,213	6	2026/2/15	1.78
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	80,000,000	10,848.10	8,678,481,715	11,104.04	8,883,234,461	2.5	2022/1/15	1.55
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,300,000	10,632.72	7,474,808,681	11,751.52	8,261,321,786	2.25	2025/11/15	1.44
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	49,300,000	13,353.52	6,583,289,230	14,867.45	7,329,654,342	5.25	2028/11/15	1.28
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,500,000	10,967.11	5,648,063,655	13,645.96	7,027,671,009	2.5	2046/2/15	1.22
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	46,200,000	13,709.23	6,333,665,936	14,971.81	6,916,980,407	5.5	2028/8/15	1.21
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,400,000	10,086.00	4,982,484,591	13,554.95	6,696,148,185	2.5	2045/2/15	1.17

8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,700,000	14,306.68	5,965,888,437	16,002.94	6,673,228,806	5.375	2031/2/15	1.16
9	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	26,900,000	18,059.22	4,857,931,567	20,903.12	5,622,940,948	3.25	2044/1/22	0.98
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	10,969.20	4,047,635,929	14,685.44	5,418,927,579	3	2044/11/15	0.94
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,900,000	10,502.48	5,030,688,621	11,129.50	5,331,034,360	1.75	2023/1/31	0.93
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	10,736.16	4,842,008,250	11,612.09	5,237,054,140	2.375	2024/8/15	0.91
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,400,000	10,870.00	4,934,983,410	11,017.21	5,001,813,885	3.125	2021/5/15	0.87
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,417.79	4,818,103,599	12,792.67	4,963,556,905	6.25	2023/8/15	0.86
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,094.88	4,726,419,796	11,602.90	4,942,839,247	2.75	2023/11/15	0.86
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,000,000	10,915.60	4,693,708,342	11,450.11	4,923,550,766	2.25	2023/12/31	0.86
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,700,000	10,599.36	4,525,929,538	11,524.42	4,920,929,833	2.125	2024/9/30	0.86
18	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	14,491.88	4,941,731,080	14,247.12	4,858,267,920	3.5	2026/4/25	0.84
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,100,000	11,057.30	4,544,552,365	11,541.12	4,743,402,078	2.75	2023/7/31	0.82
20	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	17,556.60	4,740,282,000	17,466.23	4,715,883,720	5.5	2029/4/25	0.82
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,000,000	11,370.62	4,320,838,329	12,060.44	4,582,969,562	2.375	2027/5/15	0.80
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	40,300,000	10,745.50	4,330,440,156	10,870.26	4,380,716,775	1.625	2021/6/30	0.76
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	36,200,000	12,129.83	4,390,999,801	11,973.61	4,334,448,392	8	2021/11/15	0.75
24	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	22,200,000	17,274.97	3,835,044,680	18,912.80	4,198,642,133	3.25	2045/5/25	0.73
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	31,500,000	11,317.37	3,564,971,966	13,079.88	4,120,163,952	2.25	2046/8/15	0.72
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	27,500,000	13,271.11	3,649,557,065	14,976.82	4,118,627,716	5.25	2029/2/15	0.72
27	イギリス	国債証券	UK TREASURY	18,440,000	18,423.04	3,397,210,272	21,977.60	4,052,670,288	3.5	2045/1/22	0.70
28	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	31,100,000	13,251.13	4,121,102,536	12,939.80	4,024,277,800	5.5	2022/11/1	0.70
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,200,000	10,666.96	3,648,100,961	11,603.74	3,968,480,340	2.25	2024/11/15	0.69
30	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000	19,378.96	3,895,170,960	19,720.74	3,963,869,223	5.75	2032/10/25	0.69

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.82
合計	98.82

## 【投資不動産物件】

## マイバランスDC70

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 - KOKUSA Iマザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

## マイバランスDC70

該当事項はありません。

## （参考）国内株式マザーファンド

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2020年06月限)	買建	657	日本円	9,423,998,810	9,552,780,000	2.29

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取 引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2020 年06月限)	買建	387	米ドル	52,613,800	5,622,836,810	56,908,350	6,081,795,359	0.98
	カナダ	モントリ オール取 引所	S&P TSX60株価指 数先物(2020年06 月限)	買建	21	カナダド ル	3,518,500	270,572,650	3,845,100	295,688,190	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(2020年06月 限)	買建	254	ユーロ	7,069,370	820,046,920	7,533,640	873,902,240	0.14



オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200株価指数先物(2020年06月限)	買建	19豪ドル	2,500,175	174,612,222	2,546,000	177,812,640	0.02
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2020年06月限)	買建	54英ポンド	3,076,595	409,125,604	3,298,050	438,574,685	0.07
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(2020年06月限)	買建	28スイスフラン	2,624,540	287,360,883	2,751,280	301,237,641	0.04

(参考) 国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

マイバランスDC70

2020年4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4計算期間	(2011年 3月31日)	1,622	1,622	0.7231	0.7231
第5計算期間	(2012年 4月 2日)	2,431	2,431	0.7374	0.7374
第6計算期間	(2013年 4月 1日)	3,339	3,339	0.8701	0.8701
第7計算期間	(2014年 3月31日)	4,574	4,576	1.0370	1.0375
第8計算期間	(2015年 3月31日)	6,732	6,735	1.2599	1.2604
第9計算期間	(2016年 3月31日)	7,669	7,673	1.1776	1.1781
第10計算期間	(2017年 3月31日)	9,689	9,693	1.2865	1.2870
第11計算期間	(2018年 4月 2日)	13,061	13,066	1.4019	1.4024
第12計算期間	(2019年 4月 1日)	15,544	15,550	1.4240	1.4245
第13計算期間	(2020年 3月31日)	15,539	15,545	1.3267	1.3272
	2019年 4月末日	15,631		1.4370	
	5月末日	15,118		1.3725	
	6月末日	15,621		1.4050	
	7月末日	15,861		1.4210	
	8月末日	15,657		1.3866	
	9月末日	16,241		1.4329	

10月末日	16,890		1.4798
11月末日	17,386		1.5056
12月末日	17,774		1.5264
2020年 1月末日	17,693		1.5146
2月末日	16,657		1.4193
3月末日	15,539		1.3267
4月末日	16,370		1.3829

## 【分配の推移】

マイバランスDC70

	計算期間	1口当たりの分配金
第4計算期間	2010年 4月 1日～2011年 3月31日	0.0000円
第5計算期間	2011年 4月 1日～2012年 4月 2日	0.0000円
第6計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	0.0000円
第7計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	0.0005円
第8計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	0.0005円
第9計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	0.0005円
第10計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	0.0005円
第11計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	0.0005円
第12計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	0.0005円
第13計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	0.0005円

## 【収益率の推移】

マイバランスDC70

	計算期間	収益率
第4計算期間	2010年 4月 1日～2011年 3月31日	3.4%
第5計算期間	2011年 4月 1日～2012年 4月 2日	2.0%
第6計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	18.0%
第7計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	19.2%
第8計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	21.5%
第9計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	6.5%
第10計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	9.3%
第11計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	9.0%
第12計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	1.6%
第13計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	6.8%

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

#### （４）【設定及び解約の実績】

##### マイバランスDC70

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第4計算期間	2010年 4月 1日～2011年 3月31日	954,798,757	205,009,319	2,244,155,976
第5計算期間	2011年 4月 1日～2012年 4月 2日	1,282,954,759	229,425,374	3,297,685,361
第6計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	975,482,362	435,268,097	3,837,899,626
第7計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	1,446,924,627	873,511,133	4,411,313,120
第8計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	1,874,209,965	941,707,489	5,343,815,596
第9計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	2,335,022,495	1,165,689,519	6,513,148,572
第10計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	2,013,180,892	994,706,771	7,531,622,693
第11計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	3,036,095,917	1,250,799,533	9,316,919,077
第12計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	2,639,131,143	1,039,783,471	10,916,266,749
第13計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	2,798,215,668	2,002,165,698	11,712,316,719

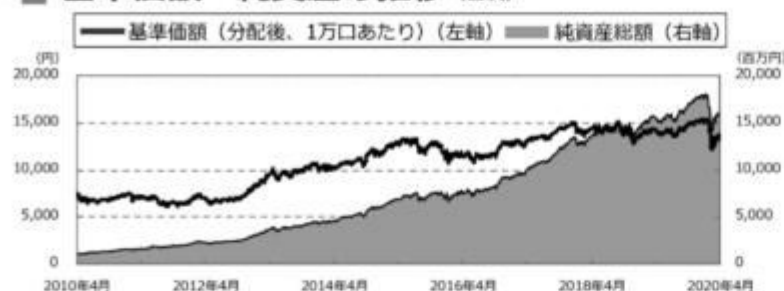
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### 参考情報



## 運用実績（2020年4月30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）

2020年3月	5 円
2019年4月	5 円
2018年4月	5 円
2017年3月	5 円
2016年3月	5 円
設定来累計	35 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	44.9
2	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	25.6
3	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	19.7
4	外国債券マザーファンド	9.8

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	1.6
2	ソニー	電気機器	0.9
3	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.8
4	キーエンス	電気機器	0.7
5	武田薬品工業	医薬品	0.7

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.9
2	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.9
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.7
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.3
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.3

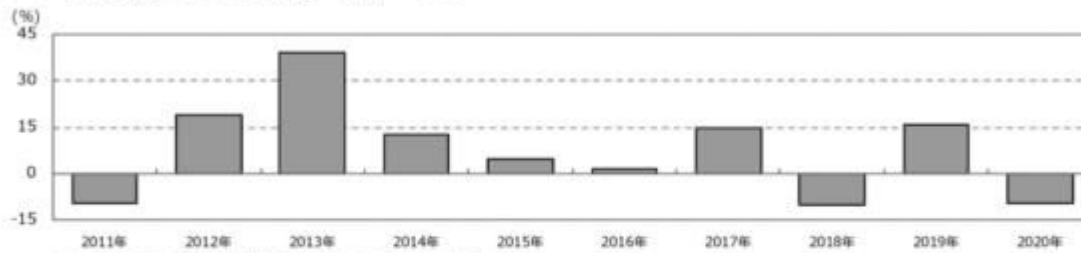
・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	国庫債券 利付（5年）第130回	国債証券	0.2
2	国庫債券 利付（5年）第129回	国債証券	0.2
3	国庫債券 利付（10年）第334回	国債証券	0.2
4	国庫債券 利付（5年）第133回	国債証券	0.2
5	国庫債券 利付（10年）第341回	国債証券	0.2

・「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 BOND	国債証券	0.2
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.2
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
4	US TREASURY BOND	国債証券	0.1
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.1

## ■ 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。
- ・2020年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

## 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。

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

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

販売の単位は、1円以上1円単位(当初元本1口=1円)とします。

受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で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、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

一部解約の実行の請求の受付については、午後3時まで、一部解約の実行の請求が行なわれかつ当該請求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。

換金価額は、解約申込みの受付日の翌営業日の基準価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社  
サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)  
<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口解約には制限を設ける場合があります。

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

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。

金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受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、当該証券の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとします。

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。

### 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<sup>\*</sup>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。

\* 一部償却原価法とは、残存期間1年以内の公社債等について適用する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いいます。

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せん。

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

## （２）【保管】

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

## （３）【信託期間】

無期限とします(2007年9月27日設定)。

## （４）【計算期間】

原則として、毎年4月1日から翌年3月31日までとします。

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

## （５）【その他】

### (a) ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託期間中において、やむを得ない事情が発生したとき等は、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

### (b) 信託期間の終了

( )委託者は、上記「(a)ファンドの繰上償還条項」にしたがい信託を終了させる場合は、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、公告を行ないません。
- ( )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、公告を行ないません。
- ( )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なう場合において、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す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続

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

##### 収益分配金に対する請求権

###### 収益分配金の支払い開始日

自動けいぞく投資契約に基づいて、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。

##### 償還金に対する請求権

###### 償還金の支払い開始日

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

###### 償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

##### 換金(解約)請求権

###### 換金(解約)の単位

受益者は、受益権を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。

### 第3【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間(2019年4月2日から2020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による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【マイバランスDC70】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第12期 (2019年 4月 1日現在)	第13期 (2020年 3月31日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	37,333,953	45,975,203
親投資信託受益証券	15,538,295,977	15,532,722,966
未収入金	4,520,373	-
流動資産合計	15,580,150,303	15,578,698,169
資産合計	15,580,150,303	15,578,698,169
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	5,458,133	5,856,158
未払解約金	10,852,021	20,211,519
未払受託者報酬	2,358,252	1,866,186
未払委託者報酬	16,507,694	11,197,009
未払利息	81	84
その他未払費用	235,764	279,865
流動負債合計	35,411,945	39,410,821
負債合計	35,411,945	39,410,821
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	10,916,266,749	11,712,316,719
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,628,471,609	3,826,970,629
(分配準備積立金)	2,224,133,307	2,079,110,100
元本等合計	15,544,738,358	15,539,287,348
純資産合計	15,544,738,358	15,539,287,348
負債純資産合計	15,580,150,303	15,578,698,169

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自	2018年 4月 3日	自	2019年 4月 2日
	至	2019年 4月 1日	至	2020年 3月31日
営業収益				
有価証券売買等損益		250,512,538		1,129,633,536
営業収益合計		250,512,538		1,129,633,536
営業費用				
支払利息		16,010		13,186
受託者報酬		4,625,390		3,901,052
委託者報酬		32,377,641		24,484,938
その他費用		462,415		531,097
営業費用合計		37,481,456		28,930,273
営業利益又は営業損失（ ）		213,031,082		1,158,563,809
経常利益又は経常損失（ ）		213,031,082		1,158,563,809
当期純利益又は当期純損失（ ）		213,031,082		1,158,563,809
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（ ）		8,774,411		2,402,749
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,744,868,269		4,628,471,609
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,106,753,585		1,217,210,029
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,106,753,585		1,217,210,029
剰余金減少額又は欠損金増加額		421,948,783		851,888,293
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		421,948,783		851,888,293
分配金		5,458,133		5,856,158
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,628,471,609		3,826,970,629

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2019年 4月 2日から2020年 3月 31日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第12期 2019年 4月 1日現在	第13期 2020年 3月31日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 10,916,266,749口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 11,712,316,719口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.4240円 (10,000口当たり純資産額) (14,240円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.3267円 (10,000口当たり純資産額) (13,267円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 2018年 4月 3日 至 2019年 4月 1日	第13期 自 2019年 4月 2日 至 2020年 3月31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>268,375,660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>5,030,732,734円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,961,215,780円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>7,260,324,174円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>10,916,266,749口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>6,650円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>5,458,133円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	268,375,660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	5,030,732,734円	分配準備積立金額	D	1,961,215,780円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,260,324,174円	当ファンドの期末残存口数	F	10,916,266,749口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,650円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	5,458,133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>220,041,790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>5,923,655,982円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,864,924,468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>8,008,622,240円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>11,712,316,719口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>6,837円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>5,856,158円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	220,041,790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	5,923,655,982円	分配準備積立金額	D	1,864,924,468円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,008,622,240円	当ファンドの期末残存口数	F	11,712,316,719口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,837円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	5,856,158円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	268,375,660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	5,030,732,734円																																																											
分配準備積立金額	D	1,961,215,780円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,260,324,174円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	10,916,266,749口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,650円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	5,458,133円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	220,041,790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	5,923,655,982円																																																											
分配準備積立金額	D	1,864,924,468円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,008,622,240円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	11,712,316,719口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,837円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	5,856,158円																																																											

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第12期 自 2018年 4月 3日 至 2019年 4月 1日	第13期 自 2019年 4月 2日 至 2020年 3月31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っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第12期 2019年 4月 1日現在	第13期 2020年 3月31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12期 自 2018年 4月 3日 至 2019年 4月 1日	第13期 自 2019年 4月 2日 至 2020年 3月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般 の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていない ため、該当事項はございません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

第12期 自 2018年 4月 3日 至 2019年 4月 1日	第13期 自 2019年 4月 2日 至 2020年 3月31日
期首元本額 9,316,919,077円	期首元本額 10,916,266,749円
期中追加設定元本額 2,639,131,143円	期中追加設定元本額 2,798,215,668円
期中一部解約元本額 1,039,783,471円	期中一部解約元本額 2,002,165,698円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第12期 自 2018年 4月 3日 至 2019年 4月 1日	第13期 自 2019年 4月 2日 至 2020年 3月31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	233,490,290	1,179,375,414
合計	233,490,290	1,179,375,414

## 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(2020年3月31日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2020年3月31日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	4,888,842,402	7,018,911,036	
		外国債券マザーファンド	681,643,863	1,643,852,340	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,584,081,235	3,816,685,327	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	2,288,811,292	3,053,274,263	
	小計	銘柄数:4 組入時価比率:100.0%	9,443,378,792	15,532,722,966 100.0%	
合計			15,532,722,966		

(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NOMURA-BPI総合マザーファンド」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)

(2020年 3月31日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	49,511,691,168
株式	390,332,931,970
派生商品評価勘定	212,478,549
未収入金	316,237,471
未収配当金	5,021,556,090
未収利息	2,473,969
その他未収収益	71,193,029
差入委託証拠金	1,293,084,596
流動資産合計	446,761,646,842
資産合計	446,761,646,842
負債の部	

流動負債	
派生商品評価勘定	203,704,550
未払金	4,395,831,922
未払解約金	466,265,468
未払利息	90,626
有価証券貸借取引受入金	38,723,900,107
流動負債合計	43,789,792,673
負債合計	43,789,792,673
純資産の部	
元本等	
元本	280,688,577,559
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	122,283,276,610
元本等合計	402,971,854,169
純資産合計	402,971,854,169
負債純資産合計	446,761,646,842

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 3月31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	1.4357円
(10,000口当たり純資産額)	(14,357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

36,237,552,550円

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月 2日

至 2020年 3月31日

## 1.金融商品に対する取組方針

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

## 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

## 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

## 市場リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月31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、新株予約権証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 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

2020年 3月31日現在

期首	2019年 4月 2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	251,590,853,832円
同期中における追加設定元本額	75,193,845,164円
同期中における一部解約元本額	46,096,121,437円
期末元本額	280,688,577,559円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	178,625,645円
バランスセレクト50	403,590,894円
バランスセレクト70	501,666,491円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,849,798,919円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	3,751,411,538円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	8,107,407,149円
野村資産設計ファンド2015	51,297,659円
野村資産設計ファンド2020	58,001,029円
野村資産設計ファンド2025	95,638,077円
野村資産設計ファンド2030	117,910,368円
野村資産設計ファンド2035	90,769,978円
野村資産設計ファンド2040	192,354,887円
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)	93,261,213,349円
のむらップ・ファンド(保守型)	3,340,349,497円
のむらップ・ファンド(普通型)	9,435,134,309円
のむらップ・ファンド(積極型)	2,420,340,745円
野村資産設計ファンド2045	28,925,921円
野村インデックスファンド・T O P I X	2,086,840,179円
マイ・ロード	4,572,417,925円
ネクストコア	6,897,993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	1,534,338,870円
野村T O P I Xインデックス(野村S M A・E W向け)	3,472,522,412円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,030,413,166円
野村資産設計ファンド2050	47,252,264円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	15,473,449円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	6,979,716円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	5,605,359円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	3,547,973円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	331,144,444円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	332,654,577円
インデックス・ブレンド(タイプ )	5,180,972円
インデックス・ブレンド(タイプ )	5,013,812円
インデックス・ブレンド(タイプ )	19,482,474円
インデックス・ブレンド(タイプ )	5,693,457円
インデックス・ブレンド(タイプ )	20,890,847円
野村6資産均等バランス	1,192,017,322円
世界6資産分散ファンド	123,873,839円
野村資産設計ファンド2060	15,748,823円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	576,920,769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)	452,132,748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)	330,580,794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)	699,804,617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)	794,652,611円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	4,885,870円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	10,036,164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)	1,330,050円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,252,211,666円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	15,065,834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)	134,965,736円
野村・国内株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	104,512,152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)	34,370,255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)	113,501,450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)	281,808,563円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	4,751,464,664円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	81,274,083円
ノムラ日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	229,096,102円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用)	3,455,923,771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)	231,250,800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)	848,059,661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)	204,706円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	7,162,546円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	29,674,772円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	39,044,925円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	135,508,534円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	10,715,841,412円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	26,403,617,855円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	28,109,972,967円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)	32,117,601,524円
マイバランスDC30	3,656,927,430円
マイバランスDC50	5,522,654,869円
マイバランスDC70	4,888,842,402円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,026,711,535円
野村DC運用戦略ファンド	100,305,935円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,671,185円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	886,304,341円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	680,063,547円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	516,237,853円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	6,531,361円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	3,567,380円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	42,636,116円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	8,747,851円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	6,671,717円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	6,675,914円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	261,901,937円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	193,138,789円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	89,575,941円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	100,376,543円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	2,130,984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(2020年3月31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	9,400	2,545.00	23,923,000	貸付有価証券 300株
		日本水産	268,500	478.00	128,343,000	貸付有価証券 200株
		マルハニチロ	38,800	2,258.00	87,610,400	
		カネコ種苗	8,100	1,335.00	10,813,500	
		サカタのタネ	32,000	3,280.00	104,960,000	貸付有価証券 15,000株
		ホクト	20,500	1,885.00	38,642,500	貸付有価証券 700株
		ホクリヨウ	4,200	611.00	2,566,200	
		住石ホールディングス	54,200	116.00	6,287,200	貸付有価証券 500株
		日鉄鉱業	6,200	4,235.00	26,257,000	
		三井松島ホールディングス	10,400	879.00	9,141,600	
		国際石油開発帝石	1,077,100	608.80	655,738,480	貸付有価証券 505,400株(7,800株)
		石油資源開発	35,100	1,777.00	62,372,700	貸付有価証券 16,300株
		K&Oエナジーグループ	13,000	1,496.00	19,448,000	貸付有価証券 6,100株
		ヒノキヤグループ	6,700	1,466.00	9,822,200	
		ショーボンドホールディングス	41,800	4,320.00	180,576,000	貸付有価証券 19,600株(1,300株)
		ミライト・ホールディングス	79,800	1,347.00	107,490,600	
		タマホーム	14,500	1,221.00	17,704,500	貸付有価証券 1,200株
サンヨーホームズ	2,300	609.00	1,400,700			

日本アクア	10,700	637.00	6,815,900	貸付有価証券 3,500株（100株）
ファーストコーポレーション	8,200	449.00	3,681,800	
ベステラ	4,600	911.00	4,190,600	貸付有価証券 2,100株（1,200株）
T A T E R U	55,300	109.00	6,027,700	貸付有価証券 12,100株（10,900株）
キャンディル	2,400	417.00	1,000,800	貸付有価証券 700株
スペースバリューホールディングス	32,700	373.00	12,197,100	
ダイセキ環境ソリューション	5,200	814.00	4,232,800	
第一カッター興業	3,300	1,617.00	5,336,100	
明豊ファシリティワークス	6,500	469.00	3,048,500	貸付有価証券 200株
安藤・間	159,900	689.00	110,171,100	貸付有価証券 59,300株（13,600株）
東急建設	78,600	569.00	44,723,400	貸付有価証券 100株
コムシスホールディングス	95,200	2,783.00	264,941,600	貸付有価証券 600株
ピーアールホールディングス	29,200	505.00	14,746,000	貸付有価証券 600株
高松コンストラクショングループ	16,700	2,321.00	38,760,700	
東建コーポレーション	8,300	7,990.00	66,317,000	貸付有価証券 3,800株
ソネック	2,800	703.00	1,968,400	
ヤマウラ	11,700	811.00	9,488,700	貸付有価証券 5,400株
大成建設	206,700	3,305.00	683,143,500	
大林組	620,000	926.00	574,120,000	貸付有価証券 400株
清水建設	629,200	845.00	531,674,000	貸付有価証券 2,600株
飛島建設	17,800	1,003.00	17,853,400	貸付有価証券 500株
長谷工コーポレーション	240,000	1,157.00	277,680,000	
松井建設	24,400	665.00	16,226,000	貸付有価証券 200株

銭高組	2,700	3,270.00	8,829,000	
鹿島建設	486,700	1,109.00	539,750,300	
不動テトラ	16,200	1,283.00	20,784,600	
大末建設	7,200	764.00	5,500,800	
鉄建建設	13,500	2,348.00	31,698,000	
西松建設	47,800	2,071.00	98,993,800	
三井住友建設	149,800	477.00	71,454,600	
大豊建設	13,900	2,264.00	31,469,600	貸付有価証券 500株
前田建設工業	155,300	797.00	123,774,100	
佐田建設	13,300	326.00	4,335,800	
ナカノフドー建設	16,900	363.00	6,134,700	
奥村組	33,600	2,248.00	75,532,800	
東鉄工業	26,600	2,917.00	77,592,200	
イチケン	4,500	1,203.00	5,413,500	
富士ピー・エス	9,100	530.00	4,823,000	
浅沼組	6,900	3,775.00	26,047,500	
戸田建設	257,500	629.00	161,967,500	
熊谷組	28,700	2,501.00	71,778,700	貸付有価証券 300株
北野建設	3,800	2,535.00	9,633,000	
植木組	2,700	2,550.00	6,885,000	
矢作建設工業	27,400	783.00	21,454,200	
ピーエス三菱	20,400	513.00	10,465,200	
日本ハウスホールディングス	42,300	293.00	12,393,900	貸付有価証券 100株
大東建託	74,300	10,065.00	747,829,500	
新日本建設	26,400	825.00	21,780,000	
N I P P O	51,300	2,380.00	122,094,000	
東亜道路工業	3,800	3,000.00	11,400,000	
前田道路	54,700	2,021.00	110,548,700	貸付有価証券 7,000株
日本道路	6,000	6,870.00	41,220,000	
東亜建設工業	19,300	1,444.00	27,869,200	貸付有価証券 3,200株（1,000株）
日本国土開発	45,200	531.00	24,001,200	貸付有価証券 5,700株
若築建設	11,100	1,210.00	13,431,000	



東洋建設	69,500	438.00	30,441,000	
五洋建設	245,800	569.00	139,860,200	
世紀東急工業	29,800	816.00	24,316,800	
福田組	7,200	4,230.00	30,456,000	貸付有価証券 3,300株
住友林業	157,000	1,385.00	217,445,000	貸付有価証券 4,500株
日本基礎技術	20,800	368.00	7,654,400	
巴コーポレーション	27,500	332.00	9,130,000	
大和ハウス工業	613,400	2,677.50	1,642,378,500	
ライト工業	35,500	1,227.00	43,558,500	貸付有価証券 3,400株
積水ハウス	678,300	1,784.50	1,210,426,350	貸付有価証券 318,400株
日特建設	16,200	738.00	11,955,600	
北陸電気工事	10,700	910.00	9,737,000	
ユアテック	35,500	615.00	21,832,500	
四電工	3,400	2,478.00	8,425,200	
中電工	25,000	2,201.00	55,025,000	
関電工	88,200	861.00	75,940,200	
きんでん	147,300	1,595.00	234,943,500	
東京エネシス	20,600	822.00	16,933,200	
トーエネック	6,200	3,180.00	19,716,000	
住友電設	17,500	2,223.00	38,902,500	
日本電設工業	34,000	2,107.00	71,638,000	
協和エクシオ	94,000	2,406.00	226,164,000	
新日本空調	16,400	2,163.00	35,473,200	
九電工	43,500	2,923.00	127,150,500	貸付有価証券 300株
三機工業	44,700	1,211.00	54,131,700	
日揮ホールディングス	190,900	868.00	165,701,200	貸付有価証券 300株
中外炉工業	6,700	1,468.00	9,835,600	
ヤマト	19,800	636.00	12,592,800	貸付有価証券 9,300株
太平電業	15,000	2,319.00	34,785,000	
高砂熱学工業	53,900	1,661.00	89,527,900	
三晃金属工業	2,700	2,022.00	5,459,400	

朝日工業社	4,200	3,195.00	13,419,000	
明星工業	40,100	734.00	29,433,400	貸付有価証券 400株
大気社	30,100	3,130.00	94,213,000	
ダイダン	14,800	2,906.00	43,008,800	
日比谷総合設備	20,000	1,938.00	38,760,000	
フィル・カンパニー	2,700	2,706.00	7,306,200	貸付有価証券 1,200株
OSJBホールディングス	97,800	239.00	23,374,200	
レイズネクスト	33,200	1,225.00	40,670,000	貸付有価証券 600株
日本製粉	58,100	1,687.00	98,014,700	
日清製粉グループ本社	224,200	1,802.00	404,008,400	貸付有価証券 300株
日東富士製粉	1,400	5,780.00	8,092,000	
昭和産業	18,200	3,210.00	58,422,000	
鳥越製粉	17,600	869.00	15,294,400	貸付有価証券 8,200株
中部飼料	24,200	1,445.00	34,969,000	貸付有価証券 300株
フィード・ワン	133,300	151.00	20,128,300	貸付有価証券 200株
東洋精糖	3,300	1,173.00	3,870,900	
日本甜菜製糖	10,300	1,719.00	17,705,700	
三井製糖	17,400	2,077.00	36,139,800	貸付有価証券 700株
塩水港精糖	21,500	195.00	4,192,500	貸付有価証券 9,700株
日新製糖	9,400	1,998.00	18,781,200	
森永製菓	46,600	4,420.00	205,972,000	
中村屋	5,100	3,910.00	19,941,000	
江崎グリコ	58,800	4,540.00	266,952,000	貸付有価証券 14,800株(4,100株)
名糖産業	9,500	1,339.00	12,720,500	
井村屋グループ	8,400	1,805.00	15,162,000	
不二家	11,100	2,062.00	22,888,200	貸付有価証券 5,200株
山崎製パン	148,700	2,257.00	335,615,900	貸付有価証券 4,600株

第一屋製パン	3,400	921.00	3,131,400	
モロゾフ	3,400	5,190.00	17,646,000	
亀田製菓	11,300	4,945.00	55,878,500	
寿スピリッツ	19,100	4,865.00	92,921,500	貸付有価証券 100株
カルビー	90,400	2,921.00	264,058,400	
森永乳業	36,700	4,180.00	153,406,000	
六甲バター	13,200	1,369.00	18,070,800	
ヤクルト本社	136,500	6,390.00	872,235,000	貸付有価証券 1,100株
明治ホールディングス	131,200	7,680.00	1,007,616,000	
雪印メグミルク	47,800	2,456.00	117,396,800	
プリマハム	31,000	2,453.00	76,043,000	
日本ハム	75,800	3,765.00	285,387,000	
林兼産業	6,600	559.00	3,689,400	
丸大食品	21,200	1,955.00	41,446,000	
S Foods	15,800	2,236.00	35,328,800	貸付有価証券 7,400株
柿安本店	6,900	2,293.00	15,821,700	貸付有価証券 400株
伊藤ハム米久ホールディングス	127,800	637.00	81,408,600	
サッポロホールディングス	67,700	1,993.00	134,926,100	貸付有価証券 31,700株
アサヒグループホールディングス	415,600	3,510.00	1,458,756,000	貸付有価証券 195,100株（33,600株）
キリンホールディングス	841,500	2,137.50	1,798,706,250	貸付有価証券 395,100株（60,700株）
宝ホールディングス	147,100	810.00	119,151,000	
オエノンホールディングス	52,300	393.00	20,553,900	貸付有価証券 24,600株
養命酒製造	6,100	1,960.00	11,956,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	139,300	2,219.00	309,106,700	貸付有価証券 65,400株
サントリー食品インターナショナル	132,800	4,085.00	542,488,000	貸付有価証券 62,200株
ダイドーグループホールディングス	10,200	3,655.00	37,281,000	貸付有価証券 3,100株

伊藤園	60,200	5,720.00	344,344,000	貸付有価証券 13,700株（13,300株）
キーコーヒー	19,500	2,298.00	44,811,000	
ユニカフェ	5,100	848.00	4,324,800	
ジャパンフーズ	2,800	1,133.00	3,172,400	
日清オイリオグループ	25,500	3,650.00	93,075,000	
不二製油グループ本社	48,400	2,608.00	126,227,200	貸付有価証券 700株
かどや製油	2,200	3,665.00	8,063,000	
J - オイルミルズ	10,300	4,570.00	47,071,000	
キッコーマン	142,800	4,605.00	657,594,000	貸付有価証券 100株
味の素	438,200	2,010.50	881,001,100	
キューピー	110,500	2,161.00	238,790,500	貸付有価証券 51,900株
ハウス食品グループ本社	74,200	3,525.00	261,555,000	
カゴメ	75,300	2,805.00	211,216,500	貸付有価証券 17,100株
焼津水産化学工業	9,600	957.00	9,187,200	
アリアケジャパン	18,100	6,820.00	123,442,000	貸付有価証券 200株
ピエトロ	2,600	1,550.00	4,030,000	
エバラ食品工業	4,800	2,160.00	10,368,000	
やまみ	1,300	1,712.00	2,225,600	
ニチレイ	94,500	3,055.00	288,697,500	
東洋水産	102,100	5,220.00	532,962,000	
イートアンド	6,900	1,730.00	11,937,000	貸付有価証券 3,000株
大冷	2,600	1,772.00	4,607,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,900	916.00	9,984,400	貸付有価証券 2,500株（100株）
日清食品ホールディングス	84,300	9,000.00	758,700,000	
永谷園ホールディングス	9,700	2,210.00	21,437,000	
一正蒲鉾	7,700	960.00	7,392,000	
フジッコ	21,500	1,947.00	41,860,500	
ロック・フィールド	21,400	1,467.00	31,393,800	貸付有価証券 9,900株
日本たばこ産業	1,145,800	1,996.00	2,287,016,800	貸付有価証券

				534,900株(10,800株)
ケンコーマヨネーズ	11,100	2,037.00	22,610,700	貸付有価証券 900株
わらべや日洋ホールディングス	13,000	1,753.00	22,789,000	貸付有価証券 100株
なとり	11,100	1,714.00	19,025,400	貸付有価証券 4,900株
イフジ産業	3,500	788.00	2,758,000	
ピククルスコーポレーション	4,300	2,159.00	9,283,700	貸付有価証券 100株(100株)
北の達人コーポレーション	69,300	532.00	36,867,600	貸付有価証券 30,900株(8,400株)
ユーグレナ	84,600	693.00	58,627,800	貸付有価証券 39,300株(600株)
ミヨシ油脂	7,600	1,103.00	8,382,800	貸付有価証券 3,500株
理研ビタミン	18,700	2,191.00	40,971,700	
片倉工業	28,100	1,062.00	29,842,200	貸付有価証券 12,900株
ゲンゼ	14,200	3,630.00	51,546,000	
東洋紡	76,500	1,143.00	87,439,500	貸付有価証券 400株
ユニチカ	56,700	270.00	15,309,000	貸付有価証券 26,000株(8,600株)
富士紡ホールディングス	9,400	2,884.00	27,109,600	
倉敷紡績	19,200	2,589.00	49,708,800	
シキボウ	10,100	979.00	9,887,900	貸付有価証券 3,600株
日本毛織	63,700	938.00	59,750,600	貸付有価証券 29,900株
ダイトウボウ	31,300	160.00	5,008,000	貸付有価証券 14,500株(13,700株)
トーア紡コーポレーション	7,700	463.00	3,565,100	
ダイドーリミテッド	25,500	202.00	5,151,000	貸付有価証券 11,800株
帝国繊維	21,700	2,100.00	45,570,000	貸付有価証券 10,200株
帝人	158,000	1,830.00	289,140,000	貸付有価証券 1,900株
東レ	1,402,000	469.00	657,538,000	貸付有価証券

				2,700株
サカイオーボックス	5,100	1,900.00	9,690,000	
住江織物	4,200	1,701.00	7,144,200	貸付有価証券 100株（100株）
日本フェルト	11,000	437.00	4,807,000	貸付有価証券 4,900株
イチカワ	2,700	1,378.00	3,720,600	
日東製網	2,200	1,500.00	3,300,000	
アツギ	15,900	626.00	9,953,400	
ダイニック	7,300	769.00	5,613,700	
セーレン	47,600	1,300.00	61,880,000	
ソトー	7,700	949.00	7,307,300	
東海染工	2,700	1,153.00	3,113,100	
小松マテーレ	31,800	735.00	23,373,000	
ワコールホールディングス	50,500	2,347.00	118,523,500	
ホギメディカル	22,100	3,365.00	74,366,500	
レナウン	49,700	73.00	3,628,100	貸付有価証券 2,900株
クラウディアホールディングス	4,800	421.00	2,020,800	
T S Iホールディングス	64,900	396.00	25,700,400	貸付有価証券 29,800株
マツオカコーポレーション	5,500	1,682.00	9,251,000	貸付有価証券 300株
ワールド	27,400	1,507.00	41,291,800	貸付有価証券 1,000株
三陽商会	10,100	1,349.00	13,624,900	貸付有価証券 500株
ナイガイ	7,100	427.00	3,031,700	
オンワードホールディングス	116,300	475.00	55,242,500	貸付有価証券 54,600株
ルックホールディングス	6,600	761.00	5,022,600	
ゴールドウイン	35,100	6,020.00	211,302,000	貸付有価証券 300株
デサント	37,800	1,270.00	48,006,000	貸付有価証券 4,000株
キング	9,100	538.00	4,895,800	
ヤマトインターナショナル	11,800	280.00	3,304,000	

特種東海製紙	12,300	4,275.00	52,582,500	
王子ホールディングス	809,400	579.00	468,642,600	
日本製紙	85,600	1,539.00	131,738,400	貸付有価証券 800株
三菱製紙	22,000	353.00	7,766,000	
北越コーポレーション	128,400	404.00	51,873,600	貸付有価証券 5,700株（5,700株）
中越パルプ工業	8,200	1,382.00	11,332,400	
巴川製紙所	5,700	760.00	4,332,000	
大王製紙	84,900	1,453.00	123,359,700	貸付有価証券 32,400株（8,000株）
阿波製紙	5,000	439.00	2,195,000	貸付有価証券 700株
レンゴー	183,000	842.00	154,086,000	
トーモク	11,900	1,526.00	18,159,400	
ザ・パック	14,700	3,620.00	53,214,000	貸付有価証券 6,800株
クラレ	305,000	1,092.00	333,060,000	貸付有価証券 142,800株（400株）
旭化成	1,283,400	764.80	981,544,320	
共和レザー	10,500	717.00	7,528,500	
昭和電工	137,800	2,237.00	308,258,600	貸付有価証券 62,500株（22,700株）
住友化学	1,422,600	321.00	456,654,600	
住友精化	8,600	2,658.00	22,858,800	
日産化学	107,500	3,940.00	423,550,000	貸付有価証券 100株
ラサ工業	6,800	1,335.00	9,078,000	
クレハ	16,600	4,405.00	73,123,000	
多木化学	5,700	3,760.00	21,432,000	貸付有価証券 400株
テイカ	14,200	1,437.00	20,405,400	
石原産業	34,700	552.00	19,154,400	
片倉コープアグリ	5,000	1,106.00	5,530,000	
日本曹達	28,700	2,697.00	77,403,900	
東ソー	299,300	1,230.00	368,139,000	
トクヤマ	55,800	2,092.00	116,733,600	
セントラル硝子	39,600	1,882.00	74,527,200	
東亜合成	121,500	940.00	114,210,000	貸付有価証券

				57,000株
大阪ソーダ	19,700	2,574.00	50,707,800	
関東電化工業	45,900	775.00	35,572,500	
デンカ	70,700	2,277.00	160,983,900	
信越化学工業	332,500	10,730.00	3,567,725,000	貸付有価証券 300株
日本カーバイド工業	6,600	1,001.00	6,606,600	
堺化学工業	12,500	1,797.00	22,462,500	
第一稀元素化学工業	21,000	752.00	15,792,000	貸付有価証券 3,700株
エア・ウォーター	180,100	1,486.00	267,628,600	
大陽日酸	186,100	1,601.00	297,946,100	
日本化学工業	6,000	2,220.00	13,320,000	貸付有価証券 600株
東邦アセチレン	2,900	1,221.00	3,540,900	
日本パーカライジング	97,700	1,120.00	109,424,000	
高圧ガス工業	30,700	722.00	22,165,400	
チタン工業	2,400	1,623.00	3,895,200	貸付有価証券 700株
四国化成工業	29,900	993.00	29,690,700	
戸田工業	4,500	1,215.00	5,467,500	貸付有価証券 1,400株
ステラ ケミファ	10,500	2,425.00	25,462,500	
保土谷化学工業	7,200	3,080.00	22,176,000	
日本触媒	30,100	4,950.00	148,995,000	貸付有価証券 5,500株(1,300株)
大日精化工業	17,100	2,359.00	40,338,900	
カネカ	50,100	2,590.00	129,759,000	
三菱瓦斯化学	180,100	1,176.00	211,797,600	
三井化学	175,800	2,051.00	360,565,800	
J S R	180,400	1,993.00	359,537,200	
東京応化工業	33,200	4,145.00	137,614,000	貸付有価証券 15,600株
大阪有機化学工業	17,900	1,502.00	26,885,800	貸付有価証券 8,400株
三菱ケミカルホールディングス	1,294,400	642.80	832,040,320	貸付有価証券 1,100株
K Hネオケム	34,100	1,521.00	51,866,100	貸付有価証券 16,000株(300株)



ダイセル	264,900	789.00	209,006,100	
住友ベークライト	30,400	2,295.00	69,768,000	
積水化学工業	416,400	1,433.00	596,701,200	
日本ゼオン	174,600	814.00	142,124,400	
アイカ工業	58,100	3,095.00	179,819,500	
宇部興産	97,800	1,657.00	162,054,600	貸付有価証券 1,100株
積水樹脂	34,900	1,990.00	69,451,000	
タキロンシーアイ	41,900	599.00	25,098,100	
旭有機材	10,900	1,395.00	15,205,500	
日立化成	89,500	4,590.00	410,805,000	貸付有価証券 1,200株
ニチバン	10,200	1,496.00	15,259,200	貸付有価証券 100株
リケンテクノス	48,700	385.00	18,749,500	
大倉工業	9,100	1,577.00	14,350,700	貸付有価証券 4,200株
積水化成成品工業	26,000	560.00	14,560,000	
群栄化学工業	4,400	2,448.00	10,771,200	
タイガースポリマー	10,200	453.00	4,620,600	
ミライアル	6,800	935.00	6,358,000	
ダイキアクシス	6,900	740.00	5,106,000	
ダイキョーニシカワ	40,800	494.00	20,155,200	
竹本容器	6,900	629.00	4,340,100	
森六ホールディングス	10,400	1,497.00	15,568,800	
日本化薬	119,900	995.00	119,300,500	貸付有価証券 300株
カーリットホールディングス	20,700	466.00	9,646,200	貸付有価証券 9,400株
日本精化	15,600	1,495.00	23,322,000	
扶桑化学工業	19,600	3,035.00	59,486,000	貸付有価証券 800株
トリケミカル研究所	4,300	7,330.00	31,519,000	貸付有価証券 300株
A D E K A	89,100	1,351.00	120,374,100	
日油	72,900	3,430.00	250,047,000	
新日本理化	32,000	155.00	4,960,000	貸付有価証券 200株
ハリマ化成グループ	16,000	1,123.00	17,968,000	

花王	473,400	8,830.00	4,180,122,000	貸付有価証券 220,900株(13,000株)
第一工業製薬	7,200	3,750.00	27,000,000	貸付有価証券 800株(100株)
石原ケミカル	5,300	1,929.00	10,223,700	
日華化学	6,500	850.00	5,525,000	
ニイタカ	3,000	3,005.00	9,015,000	貸付有価証券 1,100株
三洋化成工業	11,600	3,955.00	45,878,000	
有機合成薬品工業	14,800	250.00	3,700,000	貸付有価証券 1,200株
大日本塗料	21,900	795.00	17,410,500	貸付有価証券 10,000株
日本ペイントホールディングス	159,800	5,660.00	904,468,000	貸付有価証券 15,200株(600株)
関西ペイント	217,500	2,058.00	447,615,000	
神東塗料	15,200	145.00	2,204,000	貸付有価証券 100株(100株)
中国塗料	55,100	879.00	48,432,900	
日本特殊塗料	14,500	791.00	11,469,500	
藤倉化成	26,100	488.00	12,736,800	
太陽ホールディングス	14,200	4,070.00	57,794,000	
D I C	81,800	2,393.00	195,747,400	貸付有価証券 38,400株
サカタインクス	42,300	909.00	38,450,700	貸付有価証券 19,800株
東洋インキSCホールディングス	40,900	2,045.00	83,640,500	貸付有価証券 200株
T & K T O K A	15,000	710.00	10,650,000	貸付有価証券 6,900株
富士フイルムホールディングス	379,100	5,439.00	2,061,924,900	貸付有価証券 800株
資生堂	392,800	6,382.00	2,506,849,600	貸付有価証券 184,500株(100株)
ライオン	257,000	2,313.00	594,441,000	貸付有価証券 120,000株
高砂香料工業	12,400	2,017.00	25,010,800	
マンダム	44,400	2,071.00	91,952,400	
ミルボン	26,400	5,450.00	143,880,000	貸付有価証券 12,200株

ファンケル	80,000	2,427.00	194,160,000	貸付有価証券 1,600株
コーセー	37,200	13,330.00	495,876,000	貸付有価証券 900株（900株）
コタ	11,420	1,233.00	14,080,860	
シーボン	2,600	2,036.00	5,293,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	84,400	1,995.00	168,378,000	貸付有価証券 39,100株（16,600株）
ノエビアホールディングス	18,900	5,520.00	104,328,000	貸付有価証券 100株
アジュバンコスメジャパン	4,400	924.00	4,065,600	貸付有価証券 100株
エステー	12,700	1,601.00	20,332,700	
アグロ カネショウ	6,200	1,520.00	9,424,000	貸付有価証券 200株
コニシ	32,500	1,432.00	46,540,000	
長谷川香料	26,200	2,037.00	53,369,400	
星光PMC	11,300	635.00	7,175,500	
小林製薬	55,400	10,000.00	554,000,000	貸付有価証券 25,900株（3,000株）
荒川化学工業	17,700	1,203.00	21,293,100	
メック	13,600	1,503.00	20,440,800	貸付有価証券 6,200株
日本高純度化学	5,400	2,393.00	12,922,200	
タカラバイオ	51,700	2,231.00	115,342,700	
JCU	23,900	2,253.00	53,846,700	
新田ゼラチン	12,400	591.00	7,328,400	
OATアグリオ	3,400	964.00	3,277,600	
デクセリアルズ	51,000	698.00	35,598,000	
アース製薬	14,900	5,730.00	85,377,000	
北興化学工業	20,200	559.00	11,291,800	
大成ラミック	6,500	2,522.00	16,393,000	
クミアイ化学工業	81,800	837.00	68,466,600	貸付有価証券 37,600株（3,500株）
日本農薬	35,200	418.00	14,713,600	
アキレス	13,600	1,753.00	23,840,800	
有沢製作所	31,300	802.00	25,102,600	貸付有価証券 2,000株
日東電工	136,400	4,825.00	658,130,000	貸付有価証券

				100株
レック	21,100	1,085.00	22,893,500	貸付有価証券 300株
三光合成	22,600	260.00	5,876,000	
きもと	33,600	133.00	4,468,800	
藤森工業	17,700	2,925.00	51,772,500	
前澤化成工業	12,600	996.00	12,549,600	
未来工業	10,600	2,000.00	21,200,000	
ウェーブロックホールディングス	6,800	505.00	3,434,000	貸付有価証券 800株
J S P	11,600	1,398.00	16,216,800	貸付有価証券 5,300株
エフピコ	21,700	7,170.00	155,589,000	
天馬	13,200	1,612.00	21,278,400	貸付有価証券 100株
信越ポリマー	35,500	844.00	29,962,000	
東リ	49,200	260.00	12,792,000	
ニフコ	72,600	1,940.00	140,844,000	
バルカー	16,100	1,750.00	28,175,000	
ユニ・チャーム	381,100	4,051.00	1,543,836,100	貸付有価証券 174,500株(900株)
ショーエイコーポレーション	2,200	675.00	1,485,000	
協和キリン	198,900	2,422.00	481,735,800	貸付有価証券 93,400株(700株)
武田薬品工業	1,644,900	3,308.00	5,441,329,200	
アステラス製薬	1,714,200	1,671.00	2,864,428,200	
大日本住友製薬	146,500	1,403.00	205,539,500	貸付有価証券 100株
塩野義製薬	252,800	5,317.00	1,344,137,600	貸付有価証券 200株
わかもと製薬	23,500	230.00	5,405,000	貸付有価証券 100株
あすか製薬	22,500	1,098.00	24,705,000	
日本新薬	51,700	8,480.00	438,416,000	
バイオフェルミン製薬	3,400	2,359.00	8,020,600	
中外製薬	206,100	12,500.00	2,576,250,000	貸付有価証券 96,800株(4,300株)
科研製薬	33,800	5,030.00	170,014,000	
エーザイ	236,600	7,931.00	1,876,474,600	貸付有価証券

				200株
ロート製薬	101,500	2,960.00	300,440,000	
小野薬品工業	454,000	2,486.00	1,128,644,000	
久光製薬	52,300	5,040.00	263,592,000	貸付有価証券 4,100株
持田製薬	27,400	4,170.00	114,258,000	
参天製薬	368,300	1,858.00	684,301,400	
扶桑薬品工業	7,000	2,093.00	14,651,000	
日本ケミファ	2,600	2,475.00	6,435,000	
ツムラ	61,300	2,752.00	168,697,600	貸付有価証券 500株
日医工	56,000	1,427.00	79,912,000	貸付有価証券 26,000株(26,000株)
キッセイ薬品工業	35,000	2,781.00	97,335,000	
生化学工業	38,400	1,128.00	43,315,200	
栄研化学	34,700	1,971.00	68,393,700	貸付有価証券 300株
日水製薬	8,300	1,227.00	10,184,100	
鳥居薬品	12,400	2,699.00	33,467,600	貸付有価証券 5,700株
JCRファーマ	13,900	9,420.00	130,938,000	
東和薬品	25,300	2,267.00	57,355,100	貸付有価証券 500株
富士製薬工業	13,400	1,213.00	16,254,200	
沢井製薬	40,600	5,770.00	234,262,000	
ゼリア新薬工業	35,900	2,088.00	74,959,200	
第一三共	565,800	7,434.00	4,206,157,200	
キョーリン製薬ホールディングス	43,600	2,198.00	95,832,800	貸付有価証券 400株
大幸薬品	24,100	1,556.00	37,499,600	貸付有価証券 10,800株(4,500株)
ダイト	11,800	2,950.00	34,810,000	貸付有価証券 5,500株
大塚ホールディングス	376,700	4,231.00	1,593,817,700	貸付有価証券 176,900株(100株)
大正製薬ホールディングス	41,800	6,640.00	277,552,000	
ペプチドリーム	100,500	3,770.00	378,885,000	貸付有価証券 45,200株
日本コークス工業	167,000	61.00	10,187,000	貸付有価証券

				200株
ニチレキ	23,300	1,300.00	30,290,000	貸付有価証券 400株
ユシロ化学工業	11,100	1,181.00	13,109,100	
ビーピー・カストロール	7,100	1,143.00	8,115,300	
富士石油	52,800	189.00	9,979,200	
MORESCO	7,100	856.00	6,077,600	
出光興産	222,400	2,478.00	551,107,200	
JXTGホールディングス	2,974,200	370.20	1,101,048,840	貸付有価証券 1,500株
コスモエネルギーホールディングス	57,200	1,521.00	87,001,200	
横浜ゴム	114,500	1,343.00	153,773,500	貸付有価証券 53,800株
TOYO TIRE	113,500	1,240.00	140,740,000	貸付有価証券 53,300株(2,200株)
ブリヂストン	569,500	3,323.00	1,892,448,500	貸付有価証券 267,600株(30,300株)
住友ゴム工業	177,600	1,019.00	180,974,400	貸付有価証券 11,200株(6,700株)
藤倉コンポジット	17,300	354.00	6,124,200	
オカモト	12,000	3,880.00	46,560,000	
フコク	8,600	618.00	5,314,800	貸付有価証券 3,900株
ニッタ	22,300	2,115.00	47,164,500	
住友理工	38,300	585.00	22,405,500	
三ツ星ベルト	26,000	1,221.00	31,746,000	
バンドー化学	34,800	629.00	21,889,200	
日東紡績	29,400	4,775.00	140,385,000	貸付有価証券 3,200株
AGC	195,500	2,659.00	519,834,500	貸付有価証券 91,800株
日本板硝子	94,600	333.00	31,501,800	貸付有価証券 1,200株
石塚硝子	3,600	1,981.00	7,131,600	
日本山村硝子	8,200	852.00	6,986,400	
日本電気硝子	79,400	1,448.00	114,971,200	貸付有価証券 37,300株
オハラ	7,800	872.00	6,801,600	貸付有価証券

				3,000株(2,000株)
住友大阪セメント	37,400	3,240.00	121,176,000	
太平洋セメント	124,900	1,850.00	231,065,000	
日本ヒューム	19,800	624.00	12,355,200	貸付有価証券 100株
日本コンクリート工業	42,600	268.00	11,416,800	貸付有価証券 100株
三谷セキサン	9,200	4,585.00	42,182,000	
アジアパイルホールディングス	28,100	402.00	11,296,200	
東海カーボン	207,100	892.00	184,733,200	貸付有価証券 93,400株(5,200株)
日本カーボン	10,200	3,215.00	32,793,000	貸付有価証券 4,500株
東洋炭素	11,600	1,399.00	16,228,400	貸付有価証券 5,400株
ノリタケカンパニーリミテド	10,900	3,440.00	37,496,000	
TOTO	141,200	3,595.00	507,614,000	貸付有価証券 900株
日本碍子	241,300	1,417.00	341,922,100	
日本特殊陶業	153,900	1,522.00	234,235,800	
ダントーホールディングス	14,700	71.00	1,043,700	貸付有価証券 400株(300株)
MARUWA	7,600	6,590.00	50,084,000	
品川リフラクトリーズ	5,200	2,215.00	11,518,000	
黒崎播磨	3,900	4,085.00	15,931,500	
ヨータイ	15,700	630.00	9,891,000	
イソライト工業	10,100	444.00	4,484,400	
東京窯業	25,100	282.00	7,078,200	貸付有価証券 200株
ニッカトー	8,900	584.00	5,197,600	貸付有価証券 2,100株
フジインコーポレーテッド	17,600	2,688.00	47,308,800	貸付有価証券 400株
クニミネ工業	8,000	914.00	7,312,000	
エーアンドエーマテリアル	3,300	1,161.00	3,831,300	
ニチアス	54,100	2,024.00	109,498,400	貸付有価証券 300株

ニチハ	27,500	2,048.00	56,320,000	
日本製鉄	875,000	925.40	809,725,000	貸付有価証券 352,000株（110,100 株）
神戸製鋼所	357,800	334.00	119,505,200	貸付有価証券 70,000株
中山製鋼所	27,100	402.00	10,894,200	貸付有価証券 100株
合同製鉄	10,500	2,102.00	22,071,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	528,000	703.00	371,184,000	貸付有価証券 241,000株（165,800 株）
東京製鉄	95,200	676.00	64,355,200	
共英製鋼	22,000	1,247.00	27,434,000	貸付有価証券 9,800株
大和工業	41,500	1,854.00	76,941,000	
東京鐵鋼	8,000	1,180.00	9,440,000	貸付有価証券 3,700株
大阪製鉄	10,400	1,154.00	12,001,600	貸付有価証券 700株（700株）
淀川製鋼所	26,400	1,767.00	46,648,800	
丸一鋼管	63,500	2,599.00	165,036,500	
モリ工業	5,900	2,494.00	14,714,600	
大同特殊鋼	32,000	3,480.00	111,360,000	貸付有価証券 400株
日本高周波鋼業	7,200	370.00	2,664,000	貸付有価証券 500株
日本冶金工業	16,200	1,683.00	27,264,600	貸付有価証券 3,700株
山陽特殊製鋼	13,400	968.00	12,971,200	貸付有価証券 2,500株
愛知製鋼	11,000	3,145.00	34,595,000	
日立金属	210,600	1,139.00	239,873,400	
日本金属	4,500	601.00	2,704,500	
大平洋金属	13,200	1,570.00	20,724,000	貸付有価証券 2,500株（200株）
新日本電工	126,000	150.00	18,900,000	貸付有価証券 58,500株
栗本鐵工所	9,600	1,895.00	18,192,000	
虹技	2,900	995.00	2,885,500	
日本鑄鉄管	2,000	1,282.00	2,564,000	貸付有価証券



				1,000株(1,000株)
三菱製鋼	14,500	796.00	11,542,000	
日亜鋼業	28,600	282.00	8,065,200	貸付有価証券 100株
日本精線	3,200	2,962.00	9,478,400	貸付有価証券 1,500株
エンビプロ・ホールディングス	8,300	545.00	4,523,500	貸付有価証券 200株
シンニッタン	30,400	224.00	6,809,600	
新家工業	4,500	1,054.00	4,743,000	
大紀アルミニウム工業所	32,100	578.00	18,553,800	貸付有価証券 500株
日本軽金属ホールディングス	494,700	169.00	83,604,300	貸付有価証券 5,700株
三井金属鉱業	52,800	1,807.00	95,409,600	貸付有価証券 400株
東邦亜鉛	10,000	1,200.00	12,000,000	貸付有価証券 100株
三菱マテリアル	129,100	2,215.00	285,956,500	
住友金属鉱山	249,900	2,218.00	554,278,200	
DOWAホールディングス	49,500	2,829.00	140,035,500	貸付有価証券 200株
古河機械金属	34,800	1,060.00	36,888,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,300	935.00	18,980,500	貸付有価証券 5,100株(2,400株)
東邦チタニウム	35,000	647.00	22,645,000	
UACJ	29,700	1,553.00	46,124,100	
CKサンエツ	4,100	2,940.00	12,054,000	
古河電気工業	60,700	1,965.00	119,275,500	貸付有価証券 1,300株
住友電気工業	731,000	1,138.00	831,878,000	
フジクラ	236,100	313.00	73,899,300	貸付有価証券 7,500株
昭和電線ホールディングス	22,700	1,010.00	22,927,000	
東京特殊電線	2,900	2,418.00	7,012,200	貸付有価証券 1,300株
タツタ電線	38,800	460.00	17,848,000	
カナレ電気	3,200	1,604.00	5,132,800	
平河ヒューテック	7,300	882.00	6,438,600	貸付有価証券

				3,300株
リョービ	24,000	1,327.00	31,848,000	貸付有価証券 11,300株
アーレスティ	25,600	354.00	9,062,400	
アサヒホールディングス	34,200	2,263.00	77,394,600	貸付有価証券 300株
稲葉製作所	11,000	1,276.00	14,036,000	貸付有価証券 200株
宮地エンジニアリンググループ	5,900	1,620.00	9,558,000	貸付有価証券 400株
トーカロ	54,300	1,019.00	55,331,700	
アルファC o	6,900	912.00	6,292,800	貸付有価証券 100株
SUMCO	234,000	1,393.00	325,962,000	貸付有価証券 109,900株(91,000株)
川田テクノロジーズ	4,000	5,410.00	21,640,000	貸付有価証券 100株
RS Technologies	5,500	2,119.00	11,654,500	
信和	8,400	732.00	6,148,800	
東洋製罐グループホールディングス	124,500	1,234.00	153,633,000	
ホッカンホールディングス	10,700	1,543.00	16,510,100	貸付有価証券 700株
コロナ	10,800	960.00	10,368,000	
横河ブリッジホールディングス	36,400	1,968.00	71,635,200	
駒井ハルテック	3,700	1,494.00	5,527,800	
高田機工	1,800	2,246.00	4,042,800	
三和ホールディングス	184,300	844.00	155,549,200	
文化シャッター	57,600	785.00	45,216,000	貸付有価証券 2,300株
三協立山	25,200	1,038.00	26,157,600	貸付有価証券 11,800株
アルインコ	14,200	931.00	13,220,200	貸付有価証券 100株
東洋シャッター	4,700	677.00	3,181,900	
LIXILグループ	288,500	1,345.00	388,032,500	
日本フィルコン	15,000	481.00	7,215,000	貸付有価証券 100株(100株)

ノーリツ	40,500	1,177.00	47,668,500	貸付有価証券 19,000株
長府製作所	19,900	2,545.00	50,645,500	貸付有価証券 9,300株
リンナイ	38,000	7,650.00	290,700,000	
ダイニチ工業	10,500	609.00	6,394,500	
日東精工	27,000	526.00	14,202,000	貸付有価証券 12,600株
三洋工業	2,600	1,698.00	4,414,800	
岡部	39,600	723.00	28,630,800	貸付有価証券 18,600株
ジーテクト	24,300	1,105.00	26,851,500	
東プレ	36,500	1,200.00	43,800,000	
高周波熱錬	37,600	704.00	26,470,400	貸付有価証券 17,100株
東京製綱	14,000	617.00	8,638,000	
サンコール	11,000	419.00	4,609,000	貸付有価証券 100株
モリテック スチール	15,200	262.00	3,982,400	
パイオラックス	28,900	1,519.00	43,899,100	貸付有価証券 2,700株
エイチワン	19,200	498.00	9,561,600	貸付有価証券 100株
日本発條	209,700	708.00	148,467,600	
中央発條	2,400	2,584.00	6,201,600	
アドバネクス	2,800	1,395.00	3,906,000	
立川ブラインド工業	8,600	1,085.00	9,331,000	
三益半導体工業	15,300	1,769.00	27,065,700	貸付有価証券 7,100株
日本ドライケミカル	4,800	1,384.00	6,643,200	
日本製鋼所	59,300	1,308.00	77,564,400	
三浦工業	84,600	3,855.00	326,133,000	
タクマ	66,200	1,202.00	79,572,400	
ツガミ	40,500	754.00	30,537,000	
オークマ	22,800	3,485.00	79,458,000	
東芝機械	22,100	2,146.00	47,426,600	貸付有価証券 5,200株
アマダホールディングス	248,600	853.00	212,055,800	
アイダエンジニアリング	51,200	691.00	35,379,200	

滝澤鉄工所	6,100	1,088.00	6,636,800	
F U J I	84,100	1,650.00	138,765,000	貸付有価証券 100株
牧野フライス製作所	22,900	2,853.00	65,333,700	貸付有価証券 3,400株
オーエスジー	90,400	1,447.00	130,808,800	貸付有価証券 42,400株
ダイジェット工業	2,200	1,243.00	2,734,600	
旭ダイヤモンド工業	51,300	463.00	23,751,900	
D M G 森精機	123,700	902.00	111,577,400	貸付有価証券 57,400株
ソディック	45,900	648.00	29,743,200	貸付有価証券 1,400株
ディスコ	26,500	21,360.00	566,040,000	
日東工器	10,700	1,707.00	18,264,900	
日進工具	5,800	2,434.00	14,117,200	貸付有価証券 1,400株
パンチ工業	17,700	409.00	7,239,300	
富士ダイス	8,600	604.00	5,194,400	
豊和工業	10,800	623.00	6,728,400	貸付有価証券 300株
O K K	8,000	457.00	3,656,000	
東洋機械金属	14,000	407.00	5,698,000	
津田駒工業	3,800	798.00	3,032,400	貸付有価証券 200株
エンシュウ	4,700	909.00	4,272,300	貸付有価証券 100株
島精機製作所	30,800	1,429.00	44,013,200	
オプトラ	21,800	2,572.00	56,069,600	貸付有価証券 200株
N C ホールディングス	5,900	598.00	3,528,200	
イワキポンプ	9,300	858.00	7,979,400	
フリー	19,100	824.00	15,738,400	貸付有価証券 1,200株
ヤマシンフィルタ	42,500	713.00	30,302,500	貸付有価証券 11,900株（5,300株）
日阪製作所	24,100	738.00	17,785,800	
やまびこ	37,900	812.00	30,774,800	貸付有価証券 17,500株
平田機工	9,200	4,605.00	42,366,000	貸付有価証券

				400株（400株）
ペガサスミシン製造	19,800	353.00	6,989,400	貸付有価証券 200株
マルマエ	8,000	718.00	5,744,000	貸付有価証券 3,700株（2,100株）
タツモ	9,100	1,049.00	9,545,900	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
ナブテスコ	115,200	2,495.00	287,424,000	貸付有価証券 54,100株（2,000株）
三井海洋開発	20,800	1,307.00	27,185,600	貸付有価証券 9,700株
レオン自動機	19,200	1,193.00	22,905,600	貸付有価証券 400株
S M C	62,000	45,750.00	2,836,500,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディング	17,000	746.00	12,682,000	貸付有価証券 6,400株
ホソカワミクロン	6,900	4,785.00	33,016,500	貸付有価証券 200株
ユニオンツール	7,300	2,533.00	18,490,900	貸付有価証券 3,400株
オイレス工業	25,300	1,368.00	34,610,400	貸付有価証券 11,700株（100株）
日精イー・エス・ビー機械	6,600	3,140.00	20,724,000	貸付有価証券 100株
サトーホールディングス	27,900	2,122.00	59,203,800	
技研製作所	17,200	3,535.00	60,802,000	貸付有価証券 8,000株
日本エアテック	6,200	967.00	5,995,400	貸付有価証券 2,800株（2,100株）
カワタ	5,800	700.00	4,060,000	
日精樹脂工業	16,400	925.00	15,170,000	
オカダアイヨン	6,200	841.00	5,214,200	貸付有価証券 800株
ワイエイシイホールディングス	8,400	413.00	3,469,200	貸付有価証券 2,200株
小松製作所	895,500	1,778.50	1,592,646,750	貸付有価証券 2,600株
住友重機械工業	113,200	1,951.00	220,853,200	貸付有価証券 500株
日立建機	79,200	2,189.00	173,368,800	貸付有価証券 200株
日工	27,000	609.00	16,443,000	貸付有価証券

				500株
巴工業	8,400	2,062.00	17,320,800	
井関農機	19,800	1,141.00	22,591,800	貸付有価証券 9,200株
TOWA	20,000	746.00	14,920,000	
丸山製作所	4,300	1,121.00	4,820,300	貸付有価証券 2,000株
北川鉄工所	8,900	1,543.00	13,732,700	
ローツェ	8,700	3,105.00	27,013,500	貸付有価証券 100株
タカキタ	6,900	546.00	3,767,400	
クボタ	1,048,900	1,381.50	1,449,055,350	貸付有価証券 492,900株(53,400 株)
荏原実業	4,900	2,181.00	10,686,900	貸付有価証券 1,800株
三菱化工機	6,800	1,604.00	10,907,200	貸付有価証券 100株
月島機械	36,400	1,355.00	49,322,000	
帝国電機製作所	16,300	1,313.00	21,401,900	貸付有価証券 100株
東京機械製作所	8,000	254.00	2,032,000	
新東工業	46,900	753.00	35,315,700	
澁谷工業	17,300	2,542.00	43,976,600	貸付有価証券 8,100株
アイチ コーポレーショ ン	34,100	685.00	23,358,500	
小森コーポレーション	50,100	737.00	36,923,700	
鶴見製作所	15,400	1,941.00	29,891,400	
住友精密工業	2,900	2,216.00	6,426,400	
日本ギア工業	5,900	243.00	1,433,700	
酒井重工業	3,700	2,420.00	8,954,000	
荏原製作所	81,800	2,057.00	168,262,600	貸付有価証券 26,000株
石井鐵工所	2,600	2,142.00	5,569,200	
西島製作所	19,900	764.00	15,203,600	
北越工業	20,400	1,083.00	22,093,200	
ダイキン工業	251,900	13,170.00	3,317,523,000	貸付有価証券 200株
オルガノ	7,100	5,480.00	38,908,000	

トーヨーカネツ	8,600	1,955.00	16,813,000	
栗田工業	107,000	2,498.00	267,286,000	
椿本チエイン	28,200	2,460.00	69,372,000	貸付有価証券 400株
大同工業	9,400	694.00	6,523,600	
木村化工機	16,400	437.00	7,166,800	貸付有価証券 7,500株
アネスト岩田	30,700	996.00	30,577,200	
ダイフク	101,000	6,850.00	691,850,000	
サムコ	5,400	1,555.00	8,397,000	貸付有価証券 2,400株（1,100株）
加藤製作所	10,800	1,182.00	12,765,600	貸付有価証券 100株
油研工業	3,300	1,422.00	4,692,600	
タダノ	95,400	774.00	73,839,600	貸付有価証券 13,800株
フジテック	71,900	1,391.00	100,012,900	貸付有価証券 17,100株（15,300株）
C K D	55,000	1,480.00	81,400,000	貸付有価証券 500株
キトー	14,900	997.00	14,855,300	
平和	55,100	2,021.00	111,357,100	貸付有価証券 25,000株
理想科学工業	17,500	1,633.00	28,577,500	
SANKYO	44,000	3,145.00	138,380,000	貸付有価証券 600株
日本金銭機械	21,800	541.00	11,793,800	貸付有価証券 900株（900株）
マースグループホールディングス	12,600	1,715.00	21,609,000	
フクシマガリレイ	12,200	3,400.00	41,480,000	
オーイズミ	8,300	356.00	2,954,800	
ダイコク電機	9,100	1,228.00	11,174,800	
竹内製作所	33,100	1,348.00	44,618,800	貸付有価証券 15,500株
アマノ	51,800	2,387.00	123,646,600	貸付有価証券 200株
JUKI	27,500	551.00	15,152,500	貸付有価証券 12,900株
サンデンホールディング	25,800	362.00	9,339,600	貸付有価証券

ス				10,700株(2,400株)
蛇の目ミシン工業	18,000	292.00	5,256,000	
マックス	30,200	1,665.00	50,283,000	
グローリー	50,800	2,490.00	126,492,000	
新晃工業	18,400	1,396.00	25,686,400	貸付有価証券 500株
大和冷機工業	28,600	944.00	26,998,400	貸付有価証券 13,400株
セガサミーホールディングス	196,100	1,315.00	257,871,500	
日本ピストンリング	7,200	1,130.00	8,136,000	
リケン	9,200	2,757.00	25,364,400	
T P R	26,600	1,152.00	30,643,200	
ツバキ・ナカシマ	40,300	676.00	27,242,800	貸付有価証券 18,900株
ホシザキ	57,800	8,110.00	468,758,000	貸付有価証券 600株
大豊工業	16,100	538.00	8,661,800	
日本精工	372,200	694.00	258,306,800	貸付有価証券 1,300株
N T N	457,600	189.00	86,486,400	貸付有価証券 11,900株
ジェイテクト	189,600	735.00	139,356,000	貸付有価証券 700株
不二越	18,400	2,921.00	53,746,400	貸付有価証券 8,600株
日本トムソン	58,700	369.00	21,660,300	
T H K	115,000	2,212.00	254,380,000	貸付有価証券 54,000株(4,400株)
ユースン精機	15,300	673.00	10,296,900	
前澤給装工業	7,200	1,916.00	13,795,200	
イーグル工業	24,400	678.00	16,543,200	
前澤工業	13,200	315.00	4,158,000	
日本ピラー工業	20,000	1,258.00	25,160,000	
キッツ	80,100	653.00	52,305,300	
マキタ	257,800	3,315.00	854,607,000	
日立造船	156,700	348.00	54,531,600	
三菱重工業	331,300	2,732.50	905,277,250	
I H I	142,400	1,262.00	179,708,800	貸付有価証券



				800株
スター精密	30,400	1,091.00	33,166,400	貸付有価証券 8,000株(5,700株)
日清紡ホールディングス	131,800	721.00	95,027,800	貸付有価証券 61,900株
イビデン	121,000	2,371.00	286,891,000	貸付有価証券 500株
コニカミノルタ	432,000	439.00	189,648,000	貸付有価証券 2,700株
ブラザー工業	241,400	1,654.00	399,275,600	貸付有価証券 1,000株
ミネベアミツミ	367,000	1,614.00	592,338,000	
日立製作所	950,000	3,143.00	2,985,850,000	
三菱電機	1,977,000	1,335.00	2,639,295,000	
富士電機	119,100	2,449.00	291,675,900	
東洋電機製造	7,200	1,126.00	8,107,200	
安川電機	212,800	2,976.00	633,292,800	貸付有価証券 99,900株(26,800株)
シンフォニアテクノロジー	25,600	960.00	24,576,000	
明電舎	36,300	1,622.00	58,878,600	
オリジン	5,300	1,419.00	7,520,700	
山洋電気	9,600	4,355.00	41,808,000	
デンヨー	16,800	1,925.00	32,340,000	
東芝テック	24,800	3,400.00	84,320,000	
芝浦メカトロニクス	3,500	2,383.00	8,340,500	
マブチモーター	54,700	3,220.00	176,134,000	貸付有価証券 25,600株
日本電産	475,800	5,607.00	2,667,810,600	貸付有価証券 200株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,800	221.00	2,607,800	貸付有価証券 3,500株(500株)
トレックス・セミコンダクター	11,300	1,023.00	11,559,900	
東光高岳	11,000	950.00	10,450,000	
ダブル・スコープ	31,300	356.00	11,142,800	貸付有価証券 14,500株(1,900株)
ダイヘン	21,600	2,906.00	62,769,600	
ヤーマン	32,200	668.00	21,509,600	貸付有価証券 14,900株(300株)

JVCケンウッド	161,100	195.00	31,414,500	
ミマキエンジニアリング	17,700	413.00	7,310,100	
第一精工	8,000	1,928.00	15,424,000	貸付有価証券 3,200株
日新電機	46,300	926.00	42,873,800	貸付有価証券 1,000株
大崎電気工業	39,300	534.00	20,986,200	
オムロン	177,200	5,630.00	997,636,000	
日東工業	29,000	1,729.00	50,141,000	
I D E C	28,600	1,370.00	39,182,000	
正興電機製作所	4,600	924.00	4,250,400	
不二電機工業	2,500	1,105.00	2,762,500	
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	66,000	1,454.00	95,964,000	
サクサホールディングス	4,600	1,511.00	6,950,600	
メルコホールディングス	6,800	2,183.00	14,844,400	
テクノメディカ	4,400	1,874.00	8,245,600	
ダイヤモンドエレクト リックホールディング	3,200	462.00	1,478,400	貸付有価証券 200株
日本電気	239,800	3,945.00	946,011,000	
富士通	190,600	9,755.00	1,859,303,000	
沖電気工業	80,300	1,014.00	81,424,200	
岩崎通信機	8,700	822.00	7,151,400	
電気興業	9,500	2,495.00	23,702,500	
サンケン電気	21,600	2,103.00	45,424,800	
ナカヨ	3,800	1,450.00	5,510,000	
アイホン	11,200	1,441.00	16,139,200	貸付有価証券 100株
ルネサスエレクトロニク ス	945,200	389.00	367,682,800	貸付有価証券 27,500株
セイコーエプソン	245,300	1,170.00	287,001,000	貸付有価証券 400株
ワコム	132,900	318.00	42,262,200	貸付有価証券 100株
アルバック	36,400	2,590.00	94,276,000	貸付有価証券 17,100株
アクセル	8,200	637.00	5,223,400	貸付有価証券 1,400株
E I Z O	15,300	3,150.00	48,195,000	

日本信号	50,300	1,055.00	53,066,500	
京三製作所	46,300	466.00	21,575,800	貸付有価証券 20,000株
能美防災	26,100	2,002.00	52,252,200	
ホーチキ	14,300	1,366.00	19,533,800	
星和電機	9,800	539.00	5,282,200	貸付有価証券 200株
エレコム	21,900	3,765.00	82,453,500	
パナソニック	2,258,800	825.00	1,863,510,000	貸付有価証券 700株
シャープ	228,800	1,135.00	259,688,000	貸付有価証券 34,700株（5,700株）
アンリツ	127,300	2,006.00	255,363,800	貸付有価証券 60,700株（2,300株）
富士通ゼネラル	53,700	1,953.00	104,876,100	貸付有価証券 9,800株
ソニー	1,250,900	6,421.00	8,032,028,900	
T D K	95,500	8,380.00	800,290,000	貸付有価証券 100株
帝国通信工業	8,700	1,187.00	10,326,900	
タムラ製作所	66,000	396.00	26,136,000	
アルプスアルパイン	175,000	1,049.00	183,575,000	貸付有価証券 500株
池上通信機	6,300	838.00	5,279,400	
日本電波工業	17,800	339.00	6,034,200	貸付有価証券 5,200株
鈴木	9,700	692.00	6,712,400	
日本トリム	2,700	2,844.00	7,678,800	貸付有価証券 400株
ローランド ディー . ジー .	10,900	1,165.00	12,698,500	
フォスター電機	20,700	1,112.00	23,018,400	
S M K	5,100	2,307.00	11,765,700	
ヨコオ	12,800	2,162.00	27,673,600	
ティアック	14,200	146.00	2,073,200	貸付有価証券 100株
ホシデン	54,000	756.00	40,824,000	
ヒロセ電機	30,600	11,200.00	342,720,000	
日本航空電子工業	45,300	1,301.00	58,935,300	
T O A	21,200	805.00	17,066,000	

マクセルホールディングス	42,600	1,064.00	45,326,400	貸付有価証券 400株
古野電気	25,500	843.00	21,496,500	貸付有価証券 11,900株
ユニデンホールディングス	5,400	1,822.00	9,838,800	貸付有価証券 100株
スミダコーポレーション	15,200	662.00	10,062,400	
アイコム	10,900	2,555.00	27,849,500	貸付有価証券 4,000株
リオン	8,300	2,263.00	18,782,900	貸付有価証券 300株
本多通信工業	16,900	379.00	6,405,100	
船井電機	20,000	482.00	9,640,000	貸付有価証券 5,100株
横河電機	181,400	1,303.00	236,364,200	
新電元工業	7,000	2,329.00	16,303,000	
アズビル	124,800	2,804.00	349,939,200	
東亜ディーケーケー	9,800	903.00	8,849,400	
日本光電工業	81,700	4,060.00	331,702,000	
チノー	6,800	1,226.00	8,336,800	貸付有価証券 2,100株
共和電業	20,700	410.00	8,487,000	貸付有価証券 9,600株
日本電子材料	7,800	813.00	6,341,400	貸付有価証券 2,900株
堀場製作所	39,200	5,380.00	210,896,000	貸付有価証券 18,300株
アドバンテスト	147,000	4,340.00	637,980,000	貸付有価証券 200株
小野測器	8,200	511.00	4,190,200	
エスペック	17,500	1,642.00	28,735,000	
キーエンス	179,100	34,830.00	6,238,053,000	貸付有価証券 84,100株(8,600株)
日置電機	10,300	3,075.00	31,672,500	貸付有価証券 4,800株
シスメックス	141,300	7,846.00	1,108,639,800	貸付有価証券 700株
日本マイクロニクス	34,400	781.00	26,866,400	貸付有価証券 200株
メガチップス	18,400	1,555.00	28,612,000	貸付有価証券

				4,400株
OBARA GROUP	10,200	2,320.00	23,664,000	
澤藤電機	2,400	1,292.00	3,100,800	
原田工業	9,300	830.00	7,719,000	貸付有価証券 600株
コーセル	26,300	987.00	25,958,100	貸付有価証券 1,700株
イリソ電子工業	16,600	3,190.00	52,954,000	貸付有価証券 200株
オブテックスグループ	32,400	1,000.00	32,400,000	貸付有価証券 15,200株
千代田インテグレ	9,100	1,604.00	14,596,400	貸付有価証券 4,100株
アイ・オー・データ機器	6,400	803.00	5,139,200	
レーザーテック	86,800	5,060.00	439,208,000	貸付有価証券 40,800株
スタンレー電気	139,000	2,132.00	296,348,000	
岩崎電気	7,700	1,276.00	9,825,200	
ウシオ電機	109,100	1,033.00	112,700,300	
岡谷電機産業	15,500	314.00	4,867,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	18,200	316.00	5,751,200	貸付有価証券 8,300株(8,100株)
エノモト	5,900	828.00	4,885,200	
日本セラミック	20,100	1,846.00	37,104,600	貸付有価証券 9,400株
遠藤照明	10,000	584.00	5,840,000	
古河電池	14,100	545.00	7,684,500	貸付有価証券 4,000株
双信電機	9,600	353.00	3,388,800	貸付有価証券 1,900株
山一電機	14,300	1,386.00	19,819,800	
図研	12,900	2,306.00	29,747,400	
日本電子	39,000	2,637.00	102,843,000	
カシオ計算機	174,900	1,517.00	265,323,300	貸付有価証券 2,100株
ファナック	187,900	14,655.00	2,753,674,500	
日本シイエムケイ	46,400	445.00	20,648,000	貸付有価証券 1,500株(700株)
エンプラス	10,100	2,120.00	21,412,000	
大真空	7,200	1,485.00	10,692,000	貸付有価証券

				2,700株(100株)
ローム	87,800	5,930.00	520,654,000	
浜松ホトニクス	141,800	4,420.00	626,756,000	貸付有価証券 1,400株
三井ハイテック	21,800	1,127.00	24,568,600	貸付有価証券 3,200株(200株)
新光電気工業	66,400	1,036.00	68,790,400	貸付有価証券 19,700株
京セラ	278,100	6,408.00	1,782,064,800	貸付有価証券 300株
太陽誘電	87,900	2,861.00	251,481,900	貸付有価証券 9,100株(200株)
村田製作所	580,800	5,472.00	3,178,137,600	
双葉電子工業	31,300	1,053.00	32,958,900	
北陸電気工業	7,900	893.00	7,054,700	
ニチコン	67,000	676.00	45,292,000	貸付有価証券 2,400株
日本ケミコン	15,000	1,189.00	17,835,000	
K O A	29,800	892.00	26,581,600	
市光工業	29,600	481.00	14,237,600	貸付有価証券 13,800株
小糸製作所	118,400	3,655.00	432,752,000	
ミツバ	36,400	420.00	15,288,000	貸付有価証券 100株
S C R E E Nホールディングス	34,300	4,000.00	137,200,000	貸付有価証券 400株
キャノン電子	20,700	1,595.00	33,016,500	貸付有価証券 9,700株
キャノン	1,064,300	2,359.00	2,510,683,700	貸付有価証券 500,100株(60,400株)
リコー	503,000	794.00	399,382,000	貸付有価証券 1,600株
象印マホービン	57,900	1,481.00	85,749,900	貸付有価証券 5,500株(900株)
M U T O Hホールディングス	2,500	1,418.00	3,545,000	
東京エレクトロン	125,400	20,355.00	2,552,517,000	貸付有価証券 200株
トヨタ紡織	57,600	1,287.00	74,131,200	
芦森工業	4,100	876.00	3,591,600	

ユニプレス	38,300	964.00	36,921,200	
豊田自動織機	160,000	5,180.00	828,800,000	
モリタホールディングス	34,600	1,663.00	57,539,800	
三櫻工業	25,100	684.00	17,168,400	
デンソー	435,300	3,491.00	1,519,632,300	
東海理化電機製作所	52,100	1,346.00	70,126,600	貸付有価証券 1,100株
三井E & Sホールディングス	71,400	521.00	37,199,400	貸付有価証券 5,000株
川崎重工業	153,800	1,569.00	241,312,200	
名村造船所	63,600	204.00	12,974,400	貸付有価証券 5,900株
サノヤスホールディングス	24,000	137.00	3,288,000	貸付有価証券 2,400株
日本車輛製造	7,200	2,745.00	19,764,000	貸付有価証券 500株
三菱ロジスネクスト	26,200	874.00	22,898,800	
近畿車輛	3,000	1,059.00	3,177,000	
日産自動車	2,331,700	356.60	831,484,220	貸付有価証券 876,000株（7,100株）
いすゞ自動車	572,900	715.30	409,795,370	
トヨタ自動車	2,206,000	6,501.00	14,341,206,000	
日野自動車	246,900	581.00	143,448,900	貸付有価証券 300株
三菱自動車工業	731,800	306.00	223,930,800	貸付有価証券 1,000株
エフテック	13,800	426.00	5,878,800	貸付有価証券 6,100株
レシップホールディングス	7,700	433.00	3,334,100	貸付有価証券 600株
GMB	3,500	565.00	1,977,500	
ファルテック	3,500	648.00	2,268,000	貸付有価証券 1,500株
武蔵精密工業	44,000	834.00	36,696,000	
日産車体	38,600	939.00	36,245,400	
新明和工業	53,300	1,126.00	60,015,800	貸付有価証券 1,800株
極東開発工業	36,700	1,183.00	43,416,100	
日信工業	40,200	2,204.00	88,600,800	貸付有価証券 2,200株（2,200株）

トピー工業	16,300	1,376.00	22,428,800	
ティラド	7,200	1,242.00	8,942,400	
タチエス	32,400	980.00	31,752,000	貸付有価証券 14,400株
N O K	106,300	1,193.00	126,815,900	
フタバ産業	55,000	457.00	25,135,000	
K Y B	22,100	2,069.00	45,724,900	貸付有価証券 500株
大同メタル工業	37,900	538.00	20,390,200	貸付有価証券 300株
プレス工業	98,000	242.00	23,716,000	
ミクニ	25,100	244.00	6,124,400	
太平洋工業	41,400	941.00	38,957,400	
ケーヒン	45,400	2,525.00	114,635,000	
河西工業	26,700	528.00	14,097,600	貸付有価証券 12,400株
アイシン精機	162,800	2,664.00	433,699,200	
マツダ	581,700	572.00	332,732,400	
今仙電機製作所	18,300	651.00	11,913,300	
本田技研工業	1,556,600	2,430.00	3,782,538,000	
スズキ	391,900	2,584.50	1,012,865,550	
S U B A R U	613,800	2,073.50	1,272,714,300	貸付有価証券 100株
安永	9,500	991.00	9,414,500	貸付有価証券 2,000株（500株）
ヤマハ発動機	257,800	1,307.00	336,944,600	貸付有価証券 120,800株
ショーワ	46,700	2,252.00	105,168,400	
T B K	23,500	467.00	10,974,500	
エクセディ	26,800	1,599.00	42,853,200	
豊田合成	63,800	1,854.00	118,285,200	
愛三工業	30,900	505.00	15,604,500	貸付有価証券 800株
盟和産業	3,000	898.00	2,694,000	
日本プラスト	15,500	437.00	6,773,500	
ヨロズ	18,500	1,056.00	19,536,000	
エフ・シー・シー	32,300	1,579.00	51,001,700	
シマノ	74,000	15,440.00	1,142,560,000	貸付有価証券 11,300株（10,300株）



テイ・エス テック	45,900	2,558.00	117,412,200	
ジャムコ	9,900	701.00	6,939,900	貸付有価証券 2,300株
テルモ	559,400	3,720.00	2,080,968,000	貸付有価証券 500株
クリエートメディック	6,500	1,118.00	7,267,000	貸付有価証券 3,000株
日機装	59,300	806.00	47,795,800	貸付有価証券 27,800株
日本エム・ディ・エム	11,400	1,635.00	18,639,000	
島津製作所	236,300	2,845.00	672,273,500	貸付有価証券 1,600株
J M S	16,700	874.00	14,595,800	
クボテック	5,100	283.00	1,443,300	貸付有価証券 500株
長野計器	14,300	804.00	11,497,200	
ブイ・テクノロジー	9,300	3,130.00	29,109,000	貸付有価証券 1,900株
東京計器	12,600	695.00	8,757,000	
愛知時計電機	2,600	4,090.00	10,634,000	
インターアクション	10,600	2,173.00	23,033,800	貸付有価証券 100株
オーバル	17,700	215.00	3,805,500	貸付有価証券 100株
東京精密	35,800	3,080.00	110,264,000	
マニー	78,700	2,649.00	208,476,300	貸付有価証券 37,000株（2,700株）
ニコン	319,900	998.00	319,260,200	貸付有価証券 900株
トプコン	99,600	802.00	79,879,200	貸付有価証券 1,300株
オリンパス	1,093,900	1,562.00	1,708,671,800	貸付有価証券 600株
理研計器	17,400	2,042.00	35,530,800	
タムロン	15,900	1,813.00	28,826,700	貸付有価証券 7,500株
H O Y A	394,800	9,200.00	3,632,160,000	
シード	8,400	814.00	6,837,600	
ノーリツ鋼機	13,300	928.00	12,342,400	貸付有価証券 200株
エー・アンド・デイ	18,000	641.00	11,538,000	

朝日インテック	167,900	2,672.00	448,628,800	貸付有価証券 78,800株
シチズン時計	231,500	384.00	88,896,000	貸付有価証券 5,800株（300株）
リズム時計工業	6,200	649.00	4,023,800	
大研医器	13,700	657.00	9,000,900	
メニコン	28,000	4,825.00	135,100,000	貸付有価証券 200株
シンシア	2,100	390.00	819,000	
松風	8,900	1,761.00	15,672,900	
セイコーホールディングス	28,000	1,744.00	48,832,000	貸付有価証券 500株
ニプロ	136,800	1,271.00	173,872,800	
中本パックス	5,000	1,292.00	6,460,000	
スノーピーク	10,300	704.00	7,251,200	貸付有価証券 600株
パラマウントベッドホールディングス	20,800	4,475.00	93,080,000	貸付有価証券 100株
トランザクション	12,600	815.00	10,269,000	
粧美堂	5,800	333.00	1,931,400	
ニホンフラッシュ	18,500	950.00	17,575,000	貸付有価証券 3,400株
前田工織	21,800	2,049.00	44,668,200	貸付有価証券 4,900株（3,200株）
永大産業	25,800	276.00	7,120,800	貸付有価証券 100株（100株）
アートネイチャー	21,100	643.00	13,567,300	
バンダイナムコホールディングス	204,400	5,241.00	1,071,260,400	貸付有価証券 300株
アイフィスジャパン	5,000	715.00	3,575,000	貸付有価証券 500株（500株）
共立印刷	33,000	153.00	5,049,000	貸付有価証券 200株
SHOEI	19,000	2,269.00	43,111,000	貸付有価証券 2,200株（1,400株）
フランスベッドホールディングス	28,000	913.00	25,564,000	貸付有価証券 13,000株
パイロットコーポレーション	32,300	3,595.00	116,118,500	貸付有価証券 15,100株
萩原工業	11,000	1,411.00	15,521,000	

トッパン・フォームズ	42,400	963.00	40,831,200	
フジシールインターナショナル	44,300	1,912.00	84,701,600	貸付有価証券 13,900株
タカラトミー	88,700	762.00	67,589,400	貸付有価証券 700株
廣済堂	13,800	709.00	9,784,200	
エステールホールディングス	5,300	612.00	3,243,600	貸付有価証券 2,300株
アーク	75,500	73.00	5,511,500	貸付有価証券 700株
タカノ	7,700	759.00	5,844,300	
プロネクサス	17,000	1,042.00	17,714,000	
ホクシン	12,200	114.00	1,390,800	
ウッドワン	6,600	1,025.00	6,765,000	
大建工業	13,300	1,696.00	22,556,800	
凸版印刷	279,100	1,656.00	462,189,600	
大日本印刷	258,700	2,301.00	595,268,700	貸付有価証券 500株
共同印刷	6,100	2,715.00	16,561,500	
N I S S H A	40,600	718.00	29,150,800	貸付有価証券 900株
光村印刷	1,700	1,401.00	2,381,700	
TAKARA & COMPANY	9,500	1,677.00	15,931,500	
アシックス	163,200	999.00	163,036,800	貸付有価証券 76,600株
ツツミ	6,200	1,729.00	10,719,800	貸付有価証券 2,800株
小松ウオール工業	6,000	1,964.00	11,784,000	貸付有価証券 100株
ヤマハ	117,600	4,215.00	495,684,000	貸付有価証券 500株
河合楽器製作所	6,100	2,418.00	14,749,800	
クリナップ	18,400	535.00	9,844,000	
ビジョン	119,500	4,145.00	495,327,500	貸付有価証券 56,100株（4,800株）
オリバー	4,200	3,235.00	13,587,000	貸付有価証券 500株
兼松サステック	1,300	1,433.00	1,862,900	
キングジム	16,400	833.00	13,661,200	

リンテック	47,000	2,274.00	106,878,000	
イトーキ	42,000	319.00	13,398,000	貸付有価証券 19,700株
任天堂	121,200	41,610.00	5,043,132,000	
三菱鉛筆	32,600	1,421.00	46,324,600	貸付有価証券 15,200株
タカラスタンダード	40,800	1,658.00	67,646,400	
コクヨ	94,800	1,512.00	143,337,600	貸付有価証券 20,100株
ナカバヤシ	19,400	539.00	10,456,600	
グローブライト	8,800	1,871.00	16,464,800	貸付有価証券 300株
オカムラ	69,000	865.00	59,685,000	
美津濃	17,900	1,871.00	33,490,900	
東京電力ホールディングス	1,578,300	377.00	595,019,100	貸付有価証券 725,400株
中部電力	604,900	1,524.50	922,170,050	
関西電力	749,100	1,203.50	901,541,850	
中国電力	285,200	1,508.00	430,081,600	
北陸電力	180,700	757.00	136,789,900	貸付有価証券 10,800株
東北電力	493,900	1,041.00	514,149,900	
四国電力	178,000	854.00	152,012,000	貸付有価証券 200株
九州電力	407,500	869.00	354,117,500	貸付有価証券 800株
北海道電力	185,000	468.00	86,580,000	
沖縄電力	36,600	1,980.00	72,468,000	
電源開発	157,300	2,178.00	342,599,400	
エフオン	10,600	459.00	4,865,400	
イーレックス	28,200	1,231.00	34,714,200	
レノバ	33,000	920.00	30,360,000	貸付有価証券 5,800株
東京瓦斯	380,200	2,556.00	971,791,200	
大阪瓦斯	383,600	2,036.00	781,009,600	
東邦瓦斯	97,200	4,900.00	476,280,000	貸付有価証券 100株
北海道瓦斯	10,600	1,545.00	16,377,000	貸付有価証券 100株

広島ガス	40,700	358.00	14,570,600	
西部瓦斯	22,300	2,611.00	58,225,300	
静岡ガス	56,100	878.00	49,255,800	貸付有価証券 25,900株
メタウォーター	9,500	3,865.00	36,717,500	
S B S ホールディングス	17,100	1,749.00	29,907,900	貸付有価証券 8,000株
東武鉄道	208,500	3,770.00	786,045,000	
相鉄ホールディングス	63,300	2,773.00	175,530,900	貸付有価証券 4,300株
東急	498,600	1,700.00	847,620,000	
京浜急行電鉄	253,900	1,817.00	461,336,300	貸付有価証券 300株
小田急電鉄	294,000	2,372.00	697,368,000	貸付有価証券 700株
京王電鉄	102,600	6,390.00	655,614,000	貸付有価証券 3,400株
京成電鉄	137,600	3,120.00	429,312,000	
富士急行	27,000	2,787.00	75,249,000	貸付有価証券 11,900株
新京成電鉄	5,100	2,184.00	11,138,400	
東日本旅客鉄道	348,000	8,176.00	2,845,248,000	
西日本旅客鉄道	176,200	7,396.00	1,303,175,200	
東海旅客鉄道	164,400	17,320.00	2,847,408,000	
西武ホールディングス	265,300	1,188.00	315,176,400	
鴻池運輸	31,500	1,158.00	36,477,000	
西日本鉄道	54,800	2,657.00	145,603,600	貸付有価証券 6,700株
ハマキョウレックス	15,200	2,632.00	40,006,400	
サカイ引越センター	10,400	5,740.00	59,696,000	
近鉄グループホールディングス	187,300	5,000.00	936,500,000	貸付有価証券 300株
阪急阪神ホールディングス	249,700	3,635.00	907,659,500	
南海電気鉄道	88,800	2,460.00	218,448,000	貸付有価証券 40,900株
京阪ホールディングス	83,400	4,800.00	400,320,000	
神戸電鉄	4,500	3,830.00	17,235,000	貸付有価証券 1,900株
名古屋鉄道	153,900	3,030.00	466,317,000	貸付有価証券

				200株
山陽電気鉄道	13,400	2,008.00	26,907,200	貸付有価証券 5,300株
日本通運	66,200	5,290.00	350,198,000	
ヤマトホールディングス	328,200	1,697.00	556,955,400	
山九	52,000	4,035.00	209,820,000	
丸運	10,700	230.00	2,461,000	貸付有価証券 200株
丸全昭和運輸	15,200	2,389.00	36,312,800	
センコーグループホールディングス	103,200	838.00	86,481,600	貸付有価証券 1,000株
トナミホールディングス	4,500	4,850.00	21,825,000	
ニッコンホールディングス	67,000	2,117.00	141,839,000	
日本石油輸送	2,000	2,664.00	5,328,000	
福山通運	24,000	3,865.00	92,760,000	
セイノーホールディングス	140,200	1,173.00	164,454,600	
エスライン	5,600	851.00	4,765,600	
神奈川中央交通	4,600	3,985.00	18,331,000	貸付有価証券 100株
日立物流	34,300	2,349.00	80,570,700	貸付有価証券 2,300株
丸和運輸機関	19,700	2,445.00	48,166,500	貸付有価証券 2,600株
C & F ロジホールディングス	18,900	1,240.00	23,436,000	
九州旅客鉄道	164,100	3,100.00	508,710,000	
S Gホールディングス	196,500	2,573.00	505,594,500	
日本郵船	156,600	1,286.00	201,387,600	貸付有価証券 800株
商船三井	118,500	1,747.00	207,019,500	
川崎汽船	57,700	812.00	46,852,400	貸付有価証券 26,700株（5,100株）
N S ユナイテッド海運	10,300	1,387.00	14,286,100	貸付有価証券 100株
明治海運	19,900	344.00	6,845,600	
飯野海運	88,600	310.00	27,466,000	
共栄タンカー	3,300	836.00	2,758,800	
乾汽船	10,800	1,245.00	13,446,000	貸付有価証券

				2,000株
日本航空	337,100	1,990.00	670,829,000	
A N Aホールディングス	342,300	2,639.00	903,329,700	貸付有価証券 81,600株(17,500株)
パスコ	3,600	1,494.00	5,378,400	貸付有価証券 200株
トランコム	5,200	7,060.00	36,712,000	
日新	16,200	1,599.00	25,903,800	
三菱倉庫	59,400	2,182.00	129,610,800	貸付有価証券 10,300株(5,400株)
三井倉庫ホールディングス	21,400	1,399.00	29,938,600	貸付有価証券 100株
住友倉庫	68,900	1,183.00	81,508,700	
澁澤倉庫	10,300	2,026.00	20,867,800	
東陽倉庫	33,800	348.00	11,762,400	貸付有価証券 200株
日本トランスシティ	41,200	466.00	19,199,200	
ケイヒン	3,600	1,129.00	4,064,400	
中央倉庫	11,400	1,205.00	13,737,000	
川西倉庫	3,400	918.00	3,121,200	
安田倉庫	15,400	844.00	12,997,600	貸付有価証券 7,100株
ファイズホールディングス	4,000	899.00	3,596,000	貸付有価証券 1,100株
東洋埠頭	5,700	1,301.00	7,415,700	
宇徳	16,000	533.00	8,528,000	
上組	104,500	1,828.00	191,026,000	
サンリツ	4,400	537.00	2,362,800	
キムラユニティー	5,000	971.00	4,855,000	
キューソー流通システム	4,700	1,597.00	7,505,900	
近鉄エクスプレス	39,800	1,587.00	63,162,600	
東海運	10,700	251.00	2,685,700	貸付有価証券 4,900株
エーアイティー	13,200	730.00	9,636,000	
内外トランスライン	6,600	1,162.00	7,669,200	
日本コンセプト	6,000	1,366.00	8,196,000	
N E C ネットズエスアイ	18,300	4,400.00	80,520,000	
クロスキャット	5,100	768.00	3,916,800	
システナ	69,200	1,466.00	101,447,200	貸付有価証券

				500株
デジタルアーツ	9,500	4,670.00	44,365,000	
日鉄ソリューションズ	29,100	2,632.00	76,591,200	
キューブシステム	10,300	592.00	6,097,600	
エイジア	3,500	1,178.00	4,123,000	
コア	8,200	1,186.00	9,725,200	
ソリトンシステムズ	8,500	1,205.00	10,242,500	貸付有価証券 1,200株(200株)
ソフトクリエイティブホールディングス	8,500	1,659.00	14,101,500	
T I S	194,000	1,787.00	346,678,000	貸付有価証券 1,200株
ネオス	7,800	513.00	4,001,400	貸付有価証券 3,500株
電算システム	7,400	2,145.00	15,873,000	
グリー	119,000	417.00	49,623,000	貸付有価証券 55,900株
コーエーテクモホールディングス	39,700	2,785.00	110,564,500	
三菱総合研究所	8,300	3,290.00	27,307,000	
ボルテージ	4,500	316.00	1,422,000	貸付有価証券 1,700株(1,600株)
電算	2,100	2,007.00	4,214,700	貸付有価証券 900株
A G S	11,000	801.00	8,811,000	
ファインデックス	16,300	679.00	11,067,700	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
ブレインパッド	4,900	4,240.00	20,776,000	貸付有価証券 2,000株
K L a b	37,500	678.00	25,425,000	貸付有価証券 14,100株(2,400株)
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	23,400	773.00	18,088,200	貸付有価証券 10,900株
イーブックイニシアティブジャパン	2,800	1,216.00	3,404,800	貸付有価証券 200株(100株)
ネクソン	540,900	1,765.00	954,688,500	貸付有価証券 251,400株
アイスタイル	54,300	207.00	11,240,100	貸付有価証券 19,100株(900株)
エムアップ	5,600	2,125.00	11,900,000	貸付有価証券 1,900株(1,600株)



エイチーム	13,300	601.00	7,993,300	
エニグモ	13,700	827.00	11,329,900	貸付有価証券 6,300株（5,800株）
テクノスジャパン	15,000	340.00	5,100,000	
e n i s h	8,700	398.00	3,462,600	貸付有価証券 3,600株（800株）
コロブラ	63,600	796.00	50,625,600	貸付有価証券 18,800株（2,200株）
オルトプラス	14,400	514.00	7,401,600	貸付有価証券 6,600株（100株）
ブロードリーフ	96,100	470.00	45,167,000	貸付有価証券 45,600株
クロス・マーケティング グループ	8,600	267.00	2,296,200	貸付有価証券 100株
デジタルハーツホール ディングス	10,300	731.00	7,529,300	
システム情報	9,800	605.00	5,929,000	貸付有価証券 1,100株
メディアドゥホールディ ングス	6,100	3,025.00	18,452,500	貸付有価証券 2,800株
じげん	48,000	264.00	12,672,000	貸付有価証券 200株
ブイキューブ	11,900	1,191.00	14,172,900	貸付有価証券 5,500株（1,700株）
エンカレッジ・テクノロ ジ	3,200	622.00	1,990,400	
サイバーリンクス	3,000	917.00	2,751,000	
ディー・エル・イー	15,600	113.00	1,762,800	貸付有価証券 6,000株（3,200株）
フィックスターズ	20,600	1,023.00	21,073,800	貸付有価証券 2,400株
C A R T A H O L D I N G S	9,400	820.00	7,708,000	
オブティム	10,100	2,003.00	20,230,300	貸付有価証券 4,600株（1,200株）
セレス	6,300	685.00	4,315,500	貸付有価証券 800株
S H I F T	5,100	7,020.00	35,802,000	貸付有価証券 2,100株
ティーガイア	17,200	2,048.00	35,225,600	
セック	2,800	2,715.00	7,602,000	

日本アジアグループ	20,500	246.00	5,043,000	貸付有価証券 800株
豆蔵ホールディングス	2,400	1,870.00	4,488,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
テクマトリックス	13,700	2,209.00	30,263,300	
プロシップ	5,600	1,070.00	5,992,000	
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	46,800	1,512.00	70,761,600	貸付有価証券 21,200株
GMOペイメントゲート ウェイ	31,900	7,580.00	241,802,000	貸付有価証券 14,800株(3,800株)
ザッパラス	8,400	304.00	2,553,600	
システムリサーチ	5,100	1,387.00	7,073,700	
インターネットイニシア ティブ	28,700	3,545.00	101,741,500	
さくらインターネット	20,800	466.00	9,692,800	貸付有価証券 1,400株
ヴィンクス	5,400	696.00	3,758,400	貸付有価証券 500株(100株)
GMOクラウド	3,600	1,666.00	5,997,600	貸付有価証券 600株
SRAホールディングス	10,300	2,137.00	22,011,100	
システムインテグレータ	6,100	605.00	3,690,500	
朝日ネット	13,700	715.00	9,795,500	
eBASE	23,200	735.00	17,052,000	貸付有価証券 200株
アバント	13,800	769.00	10,612,200	貸付有価証券 3,500株
アドソル日進	6,800	2,163.00	14,708,400	
フリービット	10,100	645.00	6,514,500	貸付有価証券 4,600株(3,600株)
コムチュア	21,800	2,200.00	47,960,000	貸付有価証券 300株
サイバーコム	3,400	1,685.00	5,729,000	貸付有価証券 1,500株
アステリア	11,800	314.00	3,705,200	貸付有価証券 100株
アイル	6,900	1,285.00	8,866,500	貸付有価証券 3,100株(2,200株)
マークラインズ	9,700	1,621.00	15,723,700	
メディカル・データ・ピ ジョン	14,700	657.00	9,657,900	貸付有価証券 3,700株

g u m i	24,800	605.00	15,004,000	
ショーケース	4,600	427.00	1,964,200	
モバイルファクトリー	4,300	1,058.00	4,549,400	貸付有価証券 1,500株（200株）
テラスカイ	7,000	2,558.00	17,906,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,600	1,256.00	9,545,600	貸付有価証券 500株
P C Iホールディングス	7,800	897.00	6,996,600	
パイブドHD	2,500	1,138.00	2,845,000	貸付有価証券 1,100株（700株）
アイビーシー	3,500	780.00	2,730,000	
ネオジャパン	3,600	1,030.00	3,708,000	
P R T I M E S	1,700	1,647.00	2,799,900	
ランドコンピュータ	2,900	970.00	2,813,000	
ダブルスタンダード	2,500	4,085.00	10,212,500	貸付有価証券 800株
オープンドア	9,600	738.00	7,084,800	貸付有価証券 4,400株
マイネット	6,200	641.00	3,974,200	
アカツキ	6,900	3,615.00	24,943,500	貸付有価証券 1,200株
ベネフィットジャパン	1,400	1,221.00	1,709,400	貸付有価証券 600株
U b i c o mホールディングス	4,300	1,390.00	5,977,000	貸付有価証券 1,900株（1,300株）
L I N E	44,400	5,210.00	231,324,000	貸付有価証券 10,300株（7,500株）
カナミックネットワーク	11,800	523.00	6,171,400	
ノムラシステムコーポレーション	4,200	344.00	1,444,800	
チェンジ	3,900	2,763.00	10,775,700	貸付有価証券 1,700株（1,700株）
シンクロ・フード	8,300	203.00	1,684,900	貸付有価証券 500株（500株）
オークネット	11,900	1,318.00	15,684,200	
セグエグループ	3,200	785.00	2,512,000	
エイトレッド	2,400	1,237.00	2,968,800	貸付有価証券 300株（200株）
A O I T Y O H o l d i n g s	19,600	432.00	8,467,200	貸付有価証券 100株

マクロミル	39,600	623.00	24,670,800	
ビーグリー	3,800	1,367.00	5,194,600	
オロ	5,100	2,642.00	13,474,200	貸付有価証券 200株(200株)
ユーザーローカル	1,400	2,372.00	3,320,800	
テモナ	2,600	561.00	1,458,600	
ニーズウェル	2,300	521.00	1,198,300	
サインポスト	3,000	1,248.00	3,744,000	貸付有価証券 1,100株(800株)
ソルクシーズ	8,200	540.00	4,428,000	
フェイス	6,800	582.00	3,957,600	
プロトコーポレーション	17,400	857.00	14,911,800	
ハイマックス	2,300	1,895.00	4,358,500	貸付有価証券 1,000株
野村総合研究所	275,000	2,288.00	629,200,000	
サイバネットシステム	13,800	560.00	7,728,000	貸付有価証券 1,400株(400株)
C Eホールディングス	11,100	424.00	4,706,400	
日本システム技術	3,100	1,010.00	3,131,000	
インテージホールディングス	24,200	802.00	19,408,400	貸付有価証券 11,300株
東邦システムサイエンス	5,100	910.00	4,641,000	
ソースネクスト	92,000	292.00	26,864,000	貸付有価証券 42,700株(17,000株)
インフォコム	21,200	2,467.00	52,300,400	
HEROZ	2,100	2,710.00	5,691,000	貸付有価証券 900株
ラクスル	10,300	2,350.00	24,205,000	貸付有価証券 1,900株
F I G	21,000	230.00	4,830,000	貸付有価証券 1,100株
システムサポート	1,600	2,322.00	3,715,200	貸付有価証券 600株
イーソル	6,900	974.00	6,720,600	貸付有価証券 400株
アルテリア・ネットワークス	21,500	1,834.00	39,431,000	
東海ソフト	1,300	1,160.00	1,508,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	4,400	923.00	4,061,200	

フォーカスシステムズ	12,000	676.00	8,112,000	貸付有価証券 400株
クレスコ	11,800	1,424.00	16,803,200	
フジ・メディア・ホールディングス	186,900	1,077.00	201,291,300	
オービック	67,200	14,160.00	951,552,000	
ジャストシステム	31,500	4,915.00	154,822,500	
TDCソフト	17,000	795.00	13,515,000	
Zホールディングス	2,664,100	348.00	927,106,800	
トレンドマイクロ	86,300	5,340.00	460,842,000	貸付有価証券 40,500株（3,500株）
IDホールディングス	7,400	1,399.00	10,352,600	
日本オラクル	39,300	9,440.00	370,992,000	貸付有価証券 300株
アルファシステムズ	6,000	2,885.00	17,310,000	
フューチャー	23,400	1,397.00	32,689,800	貸付有価証券 11,000株
CAC Holdings	12,600	978.00	12,322,800	貸付有価証券 5,900株
SBテクノロジー	7,000	2,130.00	14,910,000	貸付有価証券 1,500株
トーセ	5,200	719.00	3,738,800	
オービックビジネスコンサルタント	19,800	4,380.00	86,724,000	貸付有価証券 8,500株
伊藤忠テクノソリューションズ	88,400	3,085.00	272,714,000	貸付有価証券 900株
アイティフォー	23,500	566.00	13,301,000	
東計電算	2,900	3,765.00	10,918,500	
エクスネット	3,000	907.00	2,721,000	
大塚商会	105,000	4,620.00	485,100,000	貸付有価証券 48,600株（5,100株）
サイボウズ	22,700	1,907.00	43,288,900	貸付有価証券 9,400株
ソフトブレーン	11,400	377.00	4,297,800	貸付有価証券 600株
電通国際情報サービス	12,000	3,925.00	47,100,000	貸付有価証券 5,600株
ACCESS	18,100	890.00	16,109,000	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
デジタルガレージ	34,900	3,455.00	120,579,500	貸付有価証券

				200株
E Mシステムズ	27,200	902.00	24,534,400	貸付有価証券 3,100株（2,400株）
ウェザーニューズ	6,500	3,535.00	22,977,500	
C I J	13,200	747.00	9,860,400	貸付有価証券 6,200株
ビジネスエンジニアリング	2,200	2,372.00	5,218,400	
日本エンタープライズ	19,700	205.00	4,038,500	貸付有価証券 500株
WOWOW	9,300	2,400.00	22,320,000	貸付有価証券 400株
スカラ	12,900	422.00	5,443,800	
インテリジェント ウェイブ	8,500	496.00	4,216,000	
I M A G I C A G R O U P	16,500	353.00	5,824,500	貸付有価証券 600株
ネットワンシステムズ	73,900	2,248.00	166,127,200	貸付有価証券 2,200株
システムソフト	45,900	66.00	3,029,400	貸付有価証券 200株
アルゴグラフィックス	16,500	3,545.00	58,492,500	
マーベラス	29,600	534.00	15,806,400	
エイベックス	33,300	851.00	28,338,300	
日本ユニシス	60,600	2,893.00	175,315,800	
兼松エレクトロニクス	10,500	3,400.00	35,700,000	
東京放送ホールディングス	118,000	1,504.00	177,472,000	貸付有価証券 54,800株（2,700株）
日本テレビホールディングス	161,900	1,205.00	195,089,500	
朝日放送グループホールディングス	19,300	691.00	13,336,300	貸付有価証券 100株
テレビ朝日ホールディングス	53,300	1,632.00	86,985,600	貸付有価証券 23,800株
スカパーJ S A Tホールディングス	127,600	384.00	48,998,400	貸付有価証券 200株
テレビ東京ホールディングス	15,900	2,404.00	38,223,600	
日本BS放送	6,600	1,015.00	6,699,000	
ビジョン	18,100	669.00	12,108,900	貸付有価証券 1,800株

スマートバリュー	5,000	837.00	4,185,000	貸付有価証券 300株(300株)
USEN-NEXT HOLDINGS	7,400	1,327.00	9,819,800	貸付有価証券 3,400株(1,600株)
ワイヤレスゲート	9,200	388.00	3,569,600	貸付有価証券 4,100株(800株)
コネクシオ	11,000	1,355.00	14,905,000	
日本通信	151,200	159.00	24,040,800	貸付有価証券 43,800株(31,700株)
ク Robbins	3,500	467.00	1,634,500	
日本電信電話	2,593,300	2,575.50	6,679,044,150	
KDDI	1,445,800	3,190.00	4,612,102,000	貸付有価証券 1,900株
ソフトバンク	1,763,100	1,374.50	2,423,380,950	貸付有価証券 37,000株
光通信	20,000	18,130.00	362,600,000	
NTTドコモ	1,433,100	3,377.00	4,839,578,700	貸付有価証券 100株
エムティーアイ	18,800	546.00	10,264,800	
GMOインターネット	76,500	1,816.00	138,924,000	
ファイバーゲート	4,600	1,012.00	4,655,200	貸付有価証券 2,100株(800株)
アйдママーケティング コミュニケーション	5,800	363.00	2,105,400	
KADOKAWA	52,200	1,363.00	71,148,600	
学研ホールディングス	26,000	1,846.00	47,996,000	貸付有価証券 1,200株
ゼンリン	38,700	1,057.00	40,905,900	貸付有価証券 1,700株
昭文社	8,900	374.00	3,328,600	貸付有価証券 200株
インプレスホールディングス	16,100	129.00	2,076,900	貸付有価証券 200株
アイネット	10,000	1,324.00	13,240,000	貸付有価証券 100株
松竹	12,800	12,120.00	155,136,000	貸付有価証券 5,900株(400株)
東宝	114,500	3,300.00	377,850,000	貸付有価証券 34,300株
東映	7,300	13,560.00	98,988,000	貸付有価証券 2,300株

エヌ・ティ・ティ・データ	516,500	1,040.00	537,160,000	貸付有価証券 900株
ピー・シー・エー	2,500	3,065.00	7,662,500	貸付有価証券 1,100株（700株）
ビジネスブレイン太田昭和	3,300	2,680.00	8,844,000	
D T S	43,300	1,880.00	81,404,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	82,700	4,825.00	399,027,500	
シーイーシー	20,800	1,370.00	28,496,000	貸付有価証券 9,700株（1,100株）
カブコン	91,500	3,390.00	310,185,000	
アイ・エス・ピー	3,800	1,404.00	5,335,200	
ジャステック	12,300	981.00	12,066,300	貸付有価証券 5,700株
S C S K	44,800	4,815.00	215,712,000	
日本システムウエア	6,400	1,739.00	11,129,600	
アイネス	19,100	1,354.00	25,861,400	
T K C	16,400	4,855.00	79,622,000	
富士ソフト	24,800	3,475.00	86,180,000	貸付有価証券 11,600株（200株）
N S D	62,400	1,440.00	89,856,000	貸付有価証券 16,000株
コナミホールディングス	70,500	3,315.00	233,707,500	
福井コンピュータホールディングス	7,600	2,174.00	16,522,400	
J B C Cホールディングス	13,100	1,675.00	21,942,500	貸付有価証券 600株
ミロク情報サービス	17,100	2,381.00	40,715,100	貸付有価証券 1,000株
ソフトバンクグループ	1,539,300	3,788.00	5,830,868,400	貸付有価証券 3,100株
ハウスイ	1,500	714.00	1,071,000	
高千穂交易	7,500	958.00	7,185,000	貸付有価証券 2,900株
伊藤忠食品	4,800	4,365.00	20,952,000	
エレマテック	18,200	769.00	13,995,800	
J A L U X	5,500	1,508.00	8,294,000	貸付有価証券 2,500株
あらた	15,500	4,625.00	71,687,500	貸付有価証券



				100株
トーメンデバイス	2,900	3,245.00	9,410,500	
東京エレクトロン デバイス	7,100	2,251.00	15,982,100	
フィールズ	14,900	284.00	4,231,600	貸付有価証券 2,100株
双日	1,075,500	254.00	273,177,000	
アルフレッサ ホールディングス	216,400	2,014.00	435,829,600	
横浜冷凍	54,600	924.00	50,450,400	
神栄	2,700	558.00	1,506,600	
ラサ商事	10,300	817.00	8,415,100	
ラクーンホールディングス	8,600	510.00	4,386,000	貸付有価証券 2,000株(1,800株)
アルコニックス	20,700	1,079.00	22,335,300	
神戸物産	67,200	4,260.00	286,272,000	貸付有価証券 25,400株
あい ホールディングス	27,800	1,333.00	37,057,400	貸付有価証券 13,000株
ディーブイエックス	6,900	909.00	6,272,100	貸付有価証券 2,100株
ダイワボウホールディングス	16,600	5,190.00	86,154,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	46,400	1,341.00	62,222,400	貸付有価証券 20,600株
ラクト・ジャパン	7,300	3,330.00	24,309,000	貸付有価証券 3,000株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	36,600	1,097.00	40,150,200	
八洲電機	15,000	821.00	12,315,000	
メディアスホールディングス	11,000	836.00	9,196,000	
レスターホールディングス	20,300	1,514.00	30,734,200	
ジューテックホールディングス	4,400	972.00	4,276,800	貸付有価証券 1,200株
大光	8,300	595.00	4,938,500	
OCHIホールディングス	5,600	1,512.00	8,467,200	
TOKAIホールディングス	102,900	937.00	96,417,300	貸付有価証券 1,500株

黒谷	4,400	342.00	1,504,800	
Cominix	3,400	684.00	2,325,600	貸付有価証券 1,500株
三洋貿易	19,600	826.00	16,189,600	
ビューティガレージ	3,100	1,203.00	3,729,300	
ウイン・パートナーズ	14,000	980.00	13,720,000	貸付有価証券 6,300株
ミタチ産業	5,800	540.00	3,132,000	
シップヘルスケアホールディングス	31,200	4,425.00	138,060,000	
明治電機工業	6,100	1,372.00	8,369,200	
デリカフーズホールディングス	6,800	661.00	4,494,800	
スターティアホールディングス	4,400	474.00	2,085,600	貸付有価証券 2,000株
コマダホールディングス	42,400	1,662.00	70,468,800	貸付有価証券 19,900株
ピーバンドットコム	1,500	755.00	1,132,500	貸付有価証券 100株
アセンテック	1,600	2,948.00	4,716,800	貸付有価証券 600株
富士興産	5,900	371.00	2,188,900	
協栄産業	2,200	1,084.00	2,384,800	
小野建	17,400	1,135.00	19,749,000	貸付有価証券 1,900株(1,200株)
南陽	4,300	1,257.00	5,405,100	
佐鳥電機	13,200	887.00	11,708,400	貸付有価証券 6,200株
エコトレーディング	4,400	500.00	2,200,000	貸付有価証券 700株
伯東	11,900	967.00	11,507,300	
コンドーテック	15,100	929.00	14,027,900	
中山福	11,200	467.00	5,230,400	貸付有価証券 100株
ナガイレーベン	28,200	2,653.00	74,814,600	貸付有価証券 100株
三菱食品	21,400	2,779.00	59,470,600	
松田産業	14,200	1,268.00	18,005,600	
第一興商	29,000	2,881.00	83,549,000	
メディパルホールディング	210,100	2,018.00	423,981,800	貸付有価証券

グス				1,100株
S P K	8,300	1,257.00	10,433,100	
萩原電気ホールディング ス	7,200	2,197.00	15,818,400	
アズワン	12,700	9,520.00	120,904,000	貸付有価証券 100株
スズデン	6,700	1,109.00	7,430,300	
尾家産業	5,700	1,490.00	8,493,000	
シモジマ	11,900	1,214.00	14,446,600	
ドウシシャ	18,400	1,280.00	23,552,000	
小津産業	4,300	1,699.00	7,305,700	
高速	11,600	1,213.00	14,070,800	
たけびし	6,800	1,321.00	8,982,800	貸付有価証券 3,100株
リックス	4,400	1,574.00	6,925,600	
丸文	17,200	476.00	8,187,200	
ハビネット	16,200	1,096.00	17,755,200	貸付有価証券 1,200株
橋本総業ホールディング ス	3,900	1,811.00	7,062,900	
日本ライフライン	57,700	1,362.00	78,587,400	
タカショー	9,500	433.00	4,113,500	
マルカ	6,900	1,882.00	12,985,800	貸付有価証券 3,200株
I D O M	52,500	393.00	20,632,500	貸付有価証券 4,700株（3,500株）
進和	11,500	1,736.00	19,964,000	
エスケイジャパン	4,200	276.00	1,159,200	
ダイトロン	8,200	1,486.00	12,185,200	貸付有価証券 3,800株
シークス	24,700	868.00	21,439,600	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
田中商事	6,000	650.00	3,900,000	
オーハシテクニカ	11,000	1,332.00	14,652,000	
白銅	7,000	1,286.00	9,002,000	
伊藤忠商事	1,362,000	2,242.50	3,054,285,000	貸付有価証券 200株
丸紅	2,026,900	539.00	1,092,499,100	
高島	3,100	1,456.00	4,513,600	

長瀬産業	109,500	1,279.00	140,050,500	
蝶理	12,400	1,537.00	19,058,800	
豊田通商	217,300	2,546.00	553,245,800	
三共生興	29,500	493.00	14,543,500	
兼松	72,600	1,109.00	80,513,400	
ツカモトコーポレーション	3,500	1,054.00	3,689,000	
三井物産	1,711,500	1,503.50	2,573,240,250	
日本紙パルプ商事	11,100	3,770.00	41,847,000	
日立ハイテク	67,600	7,980.00	539,448,000	
カメイ	25,400	1,015.00	25,781,000	
東都水産	2,500	2,594.00	6,485,000	
OUGホールディングス	3,100	2,679.00	8,304,900	
スターゼン	7,200	4,440.00	31,968,000	
山善	76,100	901.00	68,566,100	
椿本興業	3,600	3,600.00	12,960,000	
住友商事	1,228,600	1,239.00	1,522,235,400	
内田洋行	8,300	3,525.00	29,257,500	貸付有価証券 3,800株
三菱商事	1,366,400	2,291.50	3,131,105,600	
第一実業	9,500	3,440.00	32,680,000	
キャノンマーケティング ジャパン	55,600	2,144.00	119,206,400	貸付有価証券 26,100株
西華産業	11,000	1,084.00	11,924,000	
佐藤商事	16,100	840.00	13,524,000	
菱洋エレクトロ	19,700	2,059.00	40,562,300	貸付有価証券 9,100株（700株）
東京産業	17,600	487.00	8,571,200	貸付有価証券 300株
ユアサ商事	18,500	2,858.00	52,873,000	
神鋼商事	4,900	1,885.00	9,236,500	
小林産業	11,600	269.00	3,120,400	
阪和興業	36,400	1,682.00	61,224,800	貸付有価証券 700株
正栄食品工業	12,600	3,960.00	49,896,000	貸付有価証券 2,400株（400株）
カナデン	15,800	1,252.00	19,781,600	貸付有価証券 7,300株

菱電商事	14,000	1,297.00	18,158,000	
フルサト工業	10,700	1,442.00	15,429,400	
岩谷産業	43,200	3,610.00	155,952,000	
ナイス	8,300	920.00	7,636,000	貸付有価証券 100株
昭光通商	6,200	613.00	3,800,600	
ニチモウ	3,000	1,628.00	4,884,000	
極東貿易	5,600	1,295.00	7,252,000	貸付有価証券 2,400株
イワキ	25,500	431.00	10,990,500	貸付有価証券 11,900株
三愛石油	47,900	1,129.00	54,079,100	
稲畑産業	42,900	1,180.00	50,622,000	貸付有価証券 2,900株
G S Iクレオス	4,800	992.00	4,761,600	
明和産業	18,000	498.00	8,964,000	貸付有価証券 8,300株(4,100株)
クワザワ	6,900	473.00	3,263,700	貸付有価証券 1,300株
ワキタ	41,500	988.00	41,002,000	貸付有価証券 19,200株
東邦ホールディングス	62,500	2,267.00	141,687,500	貸付有価証券 200株
サンゲツ	53,100	1,605.00	85,225,500	
ミツウロコグループホールディングス	28,700	1,136.00	32,603,200	
シナネンホールディングス	8,000	2,618.00	20,944,000	
伊藤忠エネクス	43,000	844.00	36,292,000	
サンリオ	54,700	1,437.00	78,603,900	貸付有価証券 25,400株(400株)
サンワテクノス	13,800	815.00	11,247,000	
リョーサン	21,500	2,389.00	51,363,500	
新光商事	30,500	890.00	27,145,000	
トーヨー	8,800	1,681.00	14,792,800	貸付有価証券 3,800株
三信電気	10,400	1,395.00	14,508,000	
東陽テクニカ	22,400	971.00	21,750,400	貸付有価証券 400株
モスフードサービス	25,500	2,506.00	63,903,000	貸付有価証券

				11,800株(100株)
加賀電子	19,400	1,702.00	33,018,800	
ソーダニッカ	20,100	595.00	11,959,500	
立花エレテック	14,400	1,448.00	20,851,200	貸付有価証券 6,500株
フォーバル	8,500	1,133.00	9,630,500	
PALTAC	31,200	5,390.00	168,168,000	
三谷産業	25,600	318.00	8,140,800	
太平洋興発	7,600	650.00	4,940,000	
西本Wismettac ホールディングス	3,500	2,014.00	7,049,000	
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,700	1,759.00	2,990,300	
国際紙パルプ商事	46,100	255.00	11,755,500	
ヤマタネ	9,700	1,108.00	10,747,600	
丸紅建材リース	1,900	1,493.00	2,836,700	
日鉄物産	13,900	3,650.00	50,735,000	貸付有価証券 200株
泉州電業	6,000	2,418.00	14,508,000	
トラスコ中山	40,500	2,342.00	94,851,000	貸付有価証券 19,000株
オートボックスセブン	72,200	1,246.00	89,961,200	貸付有価証券 200株
モリト	14,200	737.00	10,465,400	
加藤産業	30,400	3,405.00	103,512,000	
北恵	3,700	715.00	2,645,500	
イノテック	11,600	860.00	9,976,000	
イエローハット	36,800	1,503.00	55,310,400	貸付有価証券 500株
J Kホールディングス	17,600	689.00	12,126,400	貸付有価証券 8,100株
日伝	17,600	2,125.00	37,400,000	
北沢産業	14,600	281.00	4,102,600	貸付有価証券 200株
杉本商事	10,500	1,769.00	18,574,500	
因幡電機産業	55,400	2,302.00	127,530,800	
東テク	6,400	1,875.00	12,000,000	
ミスミグループ本社	244,100	2,355.00	574,855,500	
アルテック	15,400	183.00	2,818,200	

タキヒヨー	5,900	1,539.00	9,080,100	貸付有価証券 200株
蔵王産業	3,800	1,362.00	5,175,600	
スズケン	82,500	3,935.00	324,637,500	貸付有価証券 1,000株
ジェコス	13,400	784.00	10,505,600	
グローセル	19,500	385.00	7,507,500	貸付有価証券 8,900株
ローソン	49,300	5,930.00	292,349,000	貸付有価証券 22,500株（1,500株）
サンエー	16,200	4,505.00	72,981,000	貸付有価証券 5,500株
カワチ薬品	15,100	2,372.00	35,817,200	貸付有価証券 7,000株
エービーシー・マート	30,400	5,410.00	164,464,000	貸付有価証券 14,200株（1,000株）
ハードオフコーポレーション	7,700	642.00	4,943,400	
アスクル	20,400	3,200.00	65,280,000	貸付有価証券 400株
ゲオホールディングス	35,100	1,308.00	45,910,800	貸付有価証券 1,800株
アダストリア	27,000	1,224.00	33,048,000	貸付有価証券 12,500株（1,700株）
ジーフット	11,800	436.00	5,144,800	貸付有価証券 2,000株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,800	435.00	1,218,000	
くら寿司	10,200	4,030.00	41,106,000	貸付有価証券 4,700株
キャンドゥ	9,300	1,680.00	15,624,000	貸付有価証券 200株（200株）
パルグループホールディングス	19,900	1,315.00	26,168,500	貸付有価証券 9,300株（1,600株）
エディオン	89,400	893.00	79,834,200	貸付有価証券 35,800株
サーラコーポレーション	39,500	557.00	22,001,500	
ワッツ	8,600	589.00	5,065,400	
ハローズ	7,300	2,727.00	19,907,100	貸付有価証券 700株
フジオフードシステム	16,400	1,346.00	22,074,400	貸付有価証券 100株

あみやき亭	4,200	2,984.00	12,532,800	貸付有価証券 1,900株
ひらまつ	35,800	159.00	5,692,200	貸付有価証券 200株(200株)
大黒天物産	4,700	3,060.00	14,382,000	貸付有価証券 2,100株
ハニーズホールディングス	17,100	1,084.00	18,536,400	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
ファーマライズホールディングス	4,700	672.00	3,158,400	
アルペン	14,900	1,605.00	23,914,500	
ハブ	5,500	620.00	3,410,000	
クオールホールディングス	28,700	1,325.00	38,027,500	貸付有価証券 12,800株
ジンズホールディングス	10,300	5,930.00	61,079,000	貸付有価証券 1,200株(600株)
ビックカメラ	115,500	875.00	101,062,500	貸付有価証券 46,400株(12,400株)
DCMホールディングス	107,900	997.00	107,576,300	貸付有価証券 48,000株(12,600株)
Monotaro	138,500	2,868.00	397,218,000	貸付有価証券 57,700株(16,800株)
東京一番フーズ	4,900	483.00	2,366,700	貸付有価証券 1,500株
DDホールディングス	7,700	798.00	6,144,600	貸付有価証券 400株
きちりホールディングス	5,200	521.00	2,709,200	
アークランドサービスホールディングス	14,200	1,447.00	20,547,400	
J.フロントリテイリング	232,500	898.00	208,785,000	貸付有価証券 109,200株(90,100株)
ドトール・日レスホールディングス	31,100	1,639.00	50,972,900	貸付有価証券 14,500株(100株)
マツモトキヨシホールディングス	80,500	3,930.00	316,365,000	貸付有価証券 400株
ブロンコビリー	10,200	2,177.00	22,205,400	貸付有価証券 300株
ZOZO	133,900	1,451.00	194,288,900	貸付有価証券 1,300株
トレジャー・ファクトリー	5,700	602.00	3,431,400	貸付有価証券 2,200株



物語コーポレーション	5,200	6,230.00	32,396,000	貸付有価証券 100株
ココカラファイン	20,300	5,610.00	113,883,000	貸付有価証券 800株
三越伊勢丹ホールディングス	340,300	630.00	214,389,000	貸付有価証券 10,900株
H a m e e	6,900	1,007.00	6,948,300	貸付有価証券 1,400株
ウエルシアホールディングス	57,900	7,550.00	437,145,000	貸付有価証券 12,500株（100株）
クリエイトSDホールディングス	32,800	2,706.00	88,756,800	貸付有価証券 900株
丸善CHIホールディングス	22,700	370.00	8,399,000	
ミサワ	3,900	401.00	1,563,900	貸付有価証券 1,800株
ティーライフ	2,600	894.00	2,324,400	
エー・ピーカンパニー	3,600	423.00	1,522,800	貸付有価証券 500株
チムニー	5,900	1,633.00	9,634,700	貸付有価証券 2,700株
シュッピン	13,200	635.00	8,382,000	貸付有価証券 2,600株
ネクステージ	27,800	707.00	19,654,600	貸付有価証券 12,900株
ジョイフル本田	57,000	1,246.00	71,022,000	貸付有価証券 26,700株
鳥貴族	6,400	1,618.00	10,355,200	貸付有価証券 2,200株
キリン堂ホールディングス	7,700	1,731.00	13,328,700	貸付有価証券 3,600株
ホットランド	13,000	944.00	12,272,000	貸付有価証券 1,900株
すかいらーくホールディングス	218,200	1,602.00	349,556,400	貸付有価証券 88,300株
SFPホールディングス	8,300	1,384.00	11,487,200	貸付有価証券 300株
綿半ホールディングス	7,300	1,588.00	11,592,400	
ヨシックス	3,200	1,829.00	5,852,800	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	56,600	961.00	54,392,600	貸付有価証券 26,500株

ゴルフダイジェスト・オンライン	9,000	463.00	4,167,000	
B E E N O S	7,300	801.00	5,847,300	貸付有価証券 1,000株
あさひ	14,500	1,122.00	16,269,000	貸付有価証券 5,600株(300株)
日本調剤	11,800	1,655.00	19,529,000	貸付有価証券 200株
コスモス薬品	8,600	25,780.00	221,708,000	貸付有価証券 4,100株
トーエル	9,400	801.00	7,529,400	
オンリー	3,300	608.00	2,006,400	
セブン & アイ・ホールディングス	761,800	3,576.00	2,724,196,800	貸付有価証券 357,900株(47,300株)
クリエイト・レストランツ・ホールディング	104,700	631.00	66,065,700	貸付有価証券 4,600株
ツルハホールディングス	42,300	14,260.00	603,198,000	貸付有価証券 4,600株(4,500株)
サンマルクホールディングス	15,400	1,732.00	26,672,800	
フェリシモ	4,300	953.00	4,097,900	
トリドールホールディングス	48,100	1,157.00	55,651,700	貸付有価証券 22,200株
T O K Y O B A S E	17,500	233.00	4,077,500	
ウイルプラスホールディングス	2,400	510.00	1,224,000	
J Mホールディングス	9,800	2,205.00	21,609,000	貸付有価証券 500株
サツドラホールディングス	2,900	1,908.00	5,533,200	貸付有価証券 200株
アレンザホールディングス	9,700	713.00	6,916,100	貸付有価証券 100株
串カツ田中ホールディングス	3,000	1,128.00	3,384,000	貸付有価証券 1,400株
パロックジャパンリミテッド	13,500	627.00	8,464,500	貸付有価証券 1,700株(1,300株)
クスリのアオキホールディングス	17,400	8,980.00	156,252,000	貸付有価証券 7,800株(1,400株)
力の源ホールディングス	8,800	608.00	5,350,400	貸付有価証券 500株
スシローグローバルホー	85,500	1,591.00	136,030,500	貸付有価証券

ルディングス				2,400株
LIXILピバ	19,200	1,836.00	35,251,200	
メディカルシステムネットワーク	18,800	430.00	8,084,000	貸付有価証券 7,300株
はるやまホールディングス	9,100	741.00	6,743,100	貸付有価証券 4,200株
ノジマ	34,600	1,783.00	61,691,800	
カップ・クリエイト	27,300	1,334.00	36,418,200	貸付有価証券 12,600株(200株)
ライトオン	14,600	505.00	7,373,000	貸付有価証券 7,200株
ジーンズメイト	5,900	228.00	1,345,200	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
良品計画	258,500	1,214.00	313,819,000	貸付有価証券 71,600株
三城ホールディングス	20,600	248.00	5,108,800	貸付有価証券 600株
アドヴァン	29,700	1,089.00	32,343,300	
アルビス	7,400	2,065.00	15,281,000	
コナカ	22,900	293.00	6,709,700	
ハウス オブ ローゼ	2,400	1,608.00	3,859,200	貸付有価証券 1,100株(200株)
G-7ホールディングス	11,500	2,320.00	26,680,000	
イオン北海道	25,700	738.00	18,966,600	
コジマ	33,500	341.00	11,423,500	貸付有価証券 200株
ヒマラヤ	6,800	729.00	4,957,200	
コーナン商事	27,700	2,188.00	60,607,600	貸付有価証券 13,000株
エコス	7,200	1,664.00	11,980,800	
ワタミ	23,000	932.00	21,436,000	貸付有価証券 10,700株
マルシェ	5,100	535.00	2,728,500	貸付有価証券 1,200株
パン・パシフィック・インターナショナルホ	428,000	2,049.00	876,972,000	貸付有価証券 199,700株
西松屋チェーン	42,700	746.00	31,854,200	貸付有価証券 18,800株
ゼンショーホールディングス	93,300	2,061.00	192,291,300	貸付有価証券 43,300株
幸楽苑ホールディングス	12,400	1,364.00	16,913,600	貸付有価証券

				5,700株
ハークスレイ	4,100	1,089.00	4,464,900	貸付有価証券 100株
サイゼリヤ	32,100	2,049.00	65,772,900	貸付有価証券 15,000株
V Tホールディングス	80,600	293.00	23,615,800	貸付有価証券 900株
魚力	5,400	1,509.00	8,148,600	
ポブラ	5,100	460.00	2,346,000	貸付有価証券 2,200株
フジ・コーポレーション	5,100	1,868.00	9,526,800	
ユナイテッドアローズ	20,400	1,625.00	33,150,000	貸付有価証券 1,100株
ハイデイ日高	28,100	1,521.00	42,740,100	貸付有価証券 13,200株
京都きもの友禅	12,400	245.00	3,038,000	
コロワイド	64,700	1,635.00	105,784,500	貸付有価証券 30,000株(400株)
ピーシーデポコーポレーション	25,800	429.00	11,068,200	貸付有価証券 400株
壱番屋	13,700	4,475.00	61,307,500	貸付有価証券 6,400株
トップカルチャー	7,000	323.00	2,261,000	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
P L A N T	5,000	459.00	2,295,000	
スギホールディングス	38,900	5,770.00	224,453,000	貸付有価証券 18,200株
薬王堂ホールディングス	8,500	2,416.00	20,536,000	貸付有価証券 1,800株
ヴィア・ホールディングス	23,800	493.00	11,733,400	貸付有価証券 1,700株
スクロール	29,900	289.00	8,641,100	貸付有価証券 500株
ヨンドシーホールディングス	19,800	1,943.00	38,471,400	貸付有価証券 9,100株
ファミリーマート	155,600	1,938.00	301,552,800	貸付有価証券 73,100株(2,500株)
木曽路	25,500	2,400.00	61,200,000	貸付有価証券 11,800株
S R Sホールディングス	22,900	903.00	20,678,700	貸付有価証券 10,600株
千趣会	35,100	358.00	12,565,800	貸付有価証券

				6,700株
タカキュー	15,000	135.00	2,025,000	貸付有価証券 500株（300株）
ケーヨー	40,000	494.00	19,760,000	貸付有価証券 800株
上新電機	22,900	2,078.00	47,586,200	
日本瓦斯	30,800	3,575.00	110,110,000	
ロイヤルホールディングス	34,000	1,759.00	59,806,000	貸付有価証券 600株（300株）
東天紅	1,400	826.00	1,156,400	
いなげや	24,100	1,583.00	38,150,300	
島忠	36,600	2,662.00	97,429,200	貸付有価証券 17,100株（7,900株）
チヨダ	20,400	1,164.00	23,745,600	貸付有価証券 9,500株
ライフコーポレーション	14,800	2,983.00	44,148,400	貸付有価証券 6,900株
リンガーハット	24,000	2,066.00	49,584,000	貸付有価証券 3,100株（100株）
MrMaxHD	26,700	337.00	8,997,900	貸付有価証券 100株
テンアライド	17,900	387.00	6,927,300	貸付有価証券 8,300株
AOKIホールディングス	38,900	726.00	28,241,400	貸付有価証券 2,700株
オークワ	30,500	1,736.00	52,948,000	貸付有価証券 8,400株
コメリ	30,100	1,936.00	58,273,600	
青山商事	40,200	928.00	37,305,600	貸付有価証券 700株
しまむら	22,700	6,520.00	148,004,000	貸付有価証券 10,100株（900株）
はせがわ	10,300	411.00	4,233,300	
高島屋	141,800	973.00	137,971,400	貸付有価証券 66,600株（26,600株）
松屋	39,300	613.00	24,090,900	貸付有価証券 16,100株
エイチ・ツー・オー テイリング	92,200	791.00	72,930,200	
近鉄百貨店	7,400	2,514.00	18,603,600	貸付有価証券 200株

丸井グループ	178,500	1,815.00	323,977,500	貸付有価証券 200株
アクシアル リテイリン グ	16,200	3,980.00	64,476,000	
井筒屋	10,600	154.00	1,632,400	貸付有価証券 200株
イオン	749,300	2,399.00	1,797,570,700	貸付有価証券 349,800株（45,800 株）
イズミ	39,600	2,980.00	118,008,000	貸付有価証券 18,600株
平和堂	39,500	1,904.00	75,208,000	貸付有価証券 17,800株
フジ	23,500	1,798.00	42,253,000	貸付有価証券 11,000株
ヤオコー	22,100	6,670.00	147,407,000	貸付有価証券 2,900株
ゼビオホールディングス	23,500	892.00	20,962,000	
ケーズホールディングス	187,900	1,023.00	192,221,700	貸付有価証券 1,000株
O l y m p i cグループ	10,000	620.00	6,200,000	
日産東京販売ホールディ ングス	28,600	215.00	6,149,000	貸付有価証券 13,300株
シルバーライフ	2,000	1,981.00	3,962,000	貸付有価証券 800株（800株）
Genky Drug S tores	8,600	2,065.00	17,759,000	貸付有価証券 300株
ナルミヤ・インターナ ショナル	3,300	554.00	1,828,200	
総合メディカルホール ディングス	16,900	2,537.00	42,875,300	貸付有価証券 1,300株（800株）
ブックオフグループホー ルディングス	11,400	803.00	9,154,200	貸付有価証券 5,200株（400株）
アインホールディングス	23,900	6,350.00	151,765,000	貸付有価証券 11,100株
元気寿司	4,900	2,218.00	10,868,200	貸付有価証券 2,500株
ヤマダ電機	593,200	431.00	255,669,200	貸付有価証券 1,300株
アークランドサカモト	30,500	975.00	29,737,500	貸付有価証券 14,300株
ニトリホールディングス	84,300	14,580.00	1,229,094,000	貸付有価証券

				39,000株
グルメ杵屋	13,900	979.00	13,608,100	貸付有価証券 6,400株
愛眼	15,500	211.00	3,270,500	貸付有価証券 800株
ケーユーホールディングス	10,200	850.00	8,670,000	
吉野家ホールディングス	64,000	2,081.00	133,184,000	貸付有価証券 10,600株(9,000株)
松屋フーズホールディングス	9,400	3,945.00	37,083,000	貸付有価証券 4,100株
サガミホールディングス	26,000	1,210.00	31,460,000	貸付有価証券 12,000株
関西スーパーマーケット	16,200	1,020.00	16,524,000	貸付有価証券 2,700株
王将フードサービス	14,300	5,780.00	82,654,000	
プレナス	21,800	1,844.00	40,199,200	貸付有価証券 9,200株
ミニストップ	14,400	1,456.00	20,966,400	貸付有価証券 1,000株
アークス	39,800	1,948.00	77,530,400	貸付有価証券 18,700株
バローホールディングス	43,100	1,923.00	82,881,300	貸付有価証券 1,500株
藤久	1,500	629.00	943,500	貸付有価証券 100株
ベルク	9,600	5,740.00	55,104,000	貸付有価証券 4,500株
大庄	10,400	1,080.00	11,232,000	
ファーストリテイリング	26,000	44,190.00	1,148,940,000	貸付有価証券 12,200株(1,600株)
サンドラッグ	73,200	3,460.00	253,272,000	
サックスパーホールディングス	16,500	613.00	10,114,500	貸付有価証券 200株
ヤマザワ	4,500	1,578.00	7,101,000	
やまや	4,000	2,013.00	8,052,000	貸付有価証券 1,800株
ペルーナ	41,800	481.00	20,105,800	
島根銀行	3,900	444.00	1,731,600	
じもとホールディングス	131,800	91.00	11,993,800	貸付有価証券 200株

めぶきフィナンシャルグループ	1,013,200	220.00	222,904,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	26,300	1,141.00	30,008,300	
九州フィナンシャルグループ	320,000	413.00	132,160,000	貸付有価証券 800株
ゆうちょ銀行	552,400	997.00	550,742,800	貸付有価証券 183,200株
富山第一銀行	46,500	294.00	13,671,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,146,900	315.00	361,273,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	132,900	610.00	81,069,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	114,400	389.00	44,501,600	貸付有価証券 200株
三十三フィナンシャルグループ	18,100	1,492.00	27,005,200	
第四北越フィナンシャルグループ	33,800	2,363.00	79,869,400	
新生銀行	143,100	1,442.00	206,350,200	貸付有価証券 500株
あおぞら銀行	116,200	2,062.00	239,604,400	貸付有価証券 400株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	13,339,000	403.00	5,375,617,000	
りそなホールディングス	2,139,900	325.20	695,895,480	貸付有価証券 5,700株
三井住友トラスト・ホールディングス	368,600	3,124.00	1,151,506,400	
三井住友フィナンシャルグループ	1,348,600	2,623.00	3,537,377,800	
千葉銀行	650,800	473.00	307,828,400	貸付有価証券 500株
群馬銀行	383,200	328.00	125,689,600	
武蔵野銀行	29,100	1,376.00	40,041,600	
千葉興業銀行	53,500	253.00	13,535,500	
筑波銀行	81,100	170.00	13,787,000	
七十七銀行	65,900	1,399.00	92,194,100	
青森銀行	15,100	2,616.00	39,501,600	
秋田銀行	12,500	1,554.00	19,425,000	
山形銀行	21,900	1,339.00	29,324,100	



岩手銀行	12,800	2,678.00	34,278,400	
東邦銀行	174,400	270.00	47,088,000	貸付有価証券 100株
東北銀行	9,300	873.00	8,118,900	
みちのく銀行	12,500	1,193.00	14,912,500	
ふくおかフィナンシャル グループ	164,300	1,431.00	235,113,300	
静岡銀行	482,900	657.00	317,265,300	貸付有価証券 300株
十六銀行	24,400	1,885.00	45,994,000	
スルガ銀行	199,500	354.00	70,623,000	貸付有価証券 23,500株
八十二銀行	470,600	391.00	184,004,600	貸付有価証券 200株
山梨中央銀行	22,600	736.00	16,633,600	
大垣共立銀行	38,500	2,175.00	83,737,500	
福井銀行	16,700	1,516.00	25,317,200	
北國銀行	20,100	3,370.00	67,737,000	
清水銀行	8,000	1,847.00	14,776,000	
富山銀行	3,800	1,861.00	7,071,800	
滋賀銀行	39,100	2,568.00	100,408,800	貸付有価証券 6,500株（6,300株）
南都銀行	32,400	2,230.00	72,252,000	
百五銀行	175,500	302.00	53,001,000	
京都銀行	69,800	3,440.00	240,112,000	
紀陽銀行	69,000	1,596.00	110,124,000	
ほくほくフィナンシャル グループ	129,800	968.00	125,646,400	
広島銀行	287,800	451.00	129,797,800	
山陰合同銀行	115,600	547.00	63,233,200	
中国銀行	167,800	963.00	161,591,400	
鳥取銀行	6,600	1,121.00	7,398,600	
伊予銀行	278,200	547.00	152,175,400	貸付有価証券 600株
百十四銀行	20,700	1,961.00	40,592,700	貸付有価証券 200株
四国銀行	29,600	853.00	25,248,800	貸付有価証券 13,200株
阿波銀行	31,800	2,282.00	72,567,600	貸付有価証券

				800株
大分銀行	11,200	1,907.00	21,358,400	
宮崎銀行	13,000	2,385.00	31,005,000	
佐賀銀行	11,800	1,148.00	13,546,400	
沖縄銀行	17,900	3,155.00	56,474,500	
琉球銀行	45,000	1,060.00	47,700,000	
セブン銀行	651,400	279.00	181,740,600	
みずほフィナンシャルグループ	26,496,800	123.60	3,275,004,480	
高知銀行	7,100	634.00	4,501,400	
山口フィナンシャルグループ	243,400	612.00	148,960,800	
長野銀行	6,400	1,124.00	7,193,600	
名古屋銀行	15,800	2,614.00	41,301,200	
北洋銀行	293,900	204.00	59,955,600	
愛知銀行	7,100	3,175.00	22,542,500	
中京銀行	8,000	2,169.00	17,352,000	
大光銀行	6,700	1,447.00	9,694,900	
愛媛銀行	27,200	1,173.00	31,905,600	
トマト銀行	7,500	1,046.00	7,845,000	
京葉銀行	83,100	534.00	44,375,400	
栃木銀行	94,200	155.00	14,601,000	
北日本銀行	6,100	1,966.00	11,992,600	貸付有価証券 500株
東和銀行	34,200	629.00	21,511,800	
福島銀行	18,400	159.00	2,925,600	貸付有価証券 5,600株（1,900株）
大東銀行	10,100	569.00	5,746,900	
トモニホールディングス	150,700	359.00	54,101,300	
フィデアホールディングス	189,300	102.00	19,308,600	貸付有価証券 600株
池田泉州ホールディングス	224,200	163.00	36,544,600	
F P G	60,100	546.00	32,814,600	貸付有価証券 27,900株
マーキュリアインベストメント	8,600	541.00	4,652,600	
S B Iホールディングス	217,800	1,578.00	343,688,400	貸付有価証券 10,300株

日本アジア投資	16,500	177.00	2,920,500	貸付有価証券 4,900株(600株)
ジャフコ	30,000	2,816.00	84,480,000	貸付有価証券 100株
大和証券グループ本社	1,564,700	419.20	655,922,240	
野村ホールディングス	3,431,100	457.80	1,570,757,580	貸付有価証券 800株
岡三証券グループ	166,100	342.00	56,806,200	貸付有価証券 100株
丸三証券	57,900	453.00	26,228,700	貸付有価証券 5,100株
東洋証券	69,700	132.00	9,200,400	貸付有価証券 2,500株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	223,900	246.00	55,079,400	
光世証券	4,700	524.00	2,462,800	貸付有価証券 800株
水戸証券	56,400	190.00	10,716,000	貸付有価証券 200株
いちよし証券	36,500	446.00	16,279,000	
松井証券	111,400	793.00	88,340,200	貸付有価証券 4,300株
だいこう証券ビジネス	9,400	544.00	5,113,600	貸付有価証券 200株
マネックスグループ	147,100	171.00	25,154,100	貸付有価証券 54,900株(37,600株)
極東証券	26,200	582.00	15,248,400	
岩井コスモホールディングス	18,400	941.00	17,314,400	
藍澤證券	35,000	754.00	26,390,000	
マネーパートナーズグループ	20,700	186.00	3,850,200	貸付有価証券 4,200株
スパークス・グループ	67,500	166.00	11,205,000	
小林洋行	5,600	225.00	1,260,000	貸付有価証券 2,500株
かんぽ生命保険	69,100	1,341.00	92,663,100	貸付有価証券 6,100株
SOMPOホールディングス	366,700	3,343.00	1,225,878,100	貸付有価証券 100株
アニコムホールディングス	16,100	3,585.00	57,718,500	貸付有価証券 5,000株

MS & A Dインシュアランスグループホール	509,800	3,025.00	1,542,145,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	160,200	1,827.00	292,685,400	
第一生命ホールディングス	1,103,400	1,295.50	1,429,454,700	
東京海上ホールディングス	697,300	4,950.00	3,451,635,000	
T & Dホールディングス	582,800	884.00	515,195,200	
アドバンスクリエイト	4,600	1,680.00	7,728,000	貸付有価証券 600株
全国保証	55,000	3,395.00	186,725,000	貸付有価証券 2,100株
ジェイリース	5,400	233.00	1,258,200	貸付有価証券 2,400株
イントラスト	6,800	530.00	3,604,000	貸付有価証券 1,100株
日本モーゲージサービス	3,900	1,750.00	6,825,000	貸付有価証券 1,800株
C a s a	6,800	920.00	6,256,000	
アルヒ	31,000	1,225.00	37,975,000	貸付有価証券 5,800株（5,800株）
プレミアグループ	10,600	1,621.00	17,182,600	貸付有価証券 2,500株
クレディセゾン	136,600	1,256.00	171,569,600	貸付有価証券 200株
芙蓉総合リース	20,500	5,480.00	112,340,000	
みずほリース	30,100	2,107.00	63,420,700	
東京センチュリー	39,300	3,385.00	133,030,500	
日本証券金融	85,900	493.00	42,348,700	
アイフル	297,500	242.00	71,995,000	貸付有価証券 76,300株
リコーリース	15,300	2,843.00	43,497,900	貸付有価証券 7,100株
イオンフィナンシャルサービス	119,300	1,158.00	138,149,400	貸付有価証券 27,000株
アコム	391,900	439.00	172,044,100	
ジャックス	21,500	1,834.00	39,431,000	
オリエントコーポレーション	527,400	121.00	63,815,400	
日立キャピタル	46,000	2,037.00	93,702,000	

アプラスフィナンシャル	93,600	60.00	5,616,000	貸付有価証券 15,800株
オリックス	1,219,600	1,300.50	1,586,089,800	
三菱UFJリース	494,900	532.00	263,286,800	
九州リースサービス	9,600	444.00	4,262,400	貸付有価証券 4,400株
日本取引所グループ	559,700	1,906.00	1,066,788,200	貸付有価証券 4,800株
イー・ギャランティ	20,900	1,581.00	33,042,900	貸付有価証券 8,500株
アサックス	10,100	585.00	5,908,500	貸付有価証券 4,700株
NECキャピタルソ リューション	7,900	1,840.00	14,536,000	貸付有価証券 1,300株
いちご	248,200	250.00	62,050,000	貸付有価証券 115,900株
日本駐車場開発	213,900	135.00	28,876,500	貸付有価証券 100,500株
スター・マイカ・ホール ディングス	10,100	1,471.00	14,857,100	貸付有価証券 2,100株
ヒューリック	416,400	1,098.00	457,207,200	貸付有価証券 141,300株（9,400株）
三栄建築設計	7,800	1,189.00	9,274,200	
野村不動産ホールディン グス	118,300	1,755.00	207,616,500	貸付有価証券 1,300株
三重交通グループホール ディングス	39,500	509.00	20,105,500	貸付有価証券 18,300株
サムティ	27,600	1,203.00	33,202,800	貸付有価証券 4,600株
ディア・ライフ	25,000	388.00	9,700,000	
コーセーアールイー	5,700	461.00	2,627,700	貸付有価証券 2,200株
エー・ディー・ワークス	357,900	20.00	7,158,000	
日本商業開発	12,300	1,338.00	16,457,400	貸付有価証券 5,800株
プレサンスコーポレー ション	32,000	953.00	30,496,000	貸付有価証券 6,800株（400株）
ユニゾホールディングス	29,400	5,970.00	175,518,000	貸付有価証券 1,300株
THEグローバル社	9,200	302.00	2,778,400	貸付有価証券 4,200株

ハウスコム	2,500	1,186.00	2,965,000	
日本管理センター	12,800	1,065.00	13,632,000	貸付有価証券 6,000株
サンセイランディック	5,700	642.00	3,659,400	
エストラスト	2,600	540.00	1,404,000	貸付有価証券 1,200株
フージャースホールディングス	38,900	597.00	23,223,300	貸付有価証券 100株
オープンハウス	56,600	2,225.00	125,935,000	貸付有価証券 100株
東急不動産ホールディングス	530,200	518.00	274,643,600	貸付有価証券 1,900株
飯田グループホールディングス	162,700	1,497.00	243,561,900	
イーグランド	3,100	615.00	1,906,500	
ムゲンエステート	13,500	420.00	5,670,000	
ビーロット	9,100	616.00	5,605,600	貸付有価証券 4,000株
ファーストブラザーズ	4,400	707.00	3,110,800	
ハウズドゥ	9,600	705.00	6,768,000	
シーアールイー	4,800	1,075.00	5,160,000	
プロパティエージェント	3,100	813.00	2,520,300	
ケイアイスター不動産	6,100	1,127.00	6,874,700	
アグレ都市デザイン	3,100	426.00	1,320,600	貸付有価証券 1,400株
グッドコムアセット	4,500	1,247.00	5,611,500	貸付有価証券 400株
ジェイ・エス・ビー	2,100	4,330.00	9,093,000	
テンポイノベーション	4,400	654.00	2,877,600	貸付有価証券 2,000株（100株）
グローバル・リンク・マネジメント	3,300	572.00	1,887,600	貸付有価証券 1,500株
パーク24	104,700	1,591.00	166,577,700	貸付有価証券 47,400株（2,600株）
パラカ	5,000	1,673.00	8,365,000	
三井不動産	961,700	1,870.50	1,798,859,850	
三菱地所	1,366,300	1,595.00	2,179,248,500	
平和不動産	35,800	2,799.00	100,204,200	貸付有価証券 900株
東京建物	205,400	1,147.00	235,593,800	貸付有価証券

				96,400株(7,200株)
ダイビル	50,200	892.00	44,778,400	
京阪神ビルディング	31,600	1,336.00	42,217,600	
住友不動産	438,300	2,635.00	1,154,920,500	
テーオーシー	38,300	587.00	22,482,100	
東京楽天地	3,200	4,070.00	13,024,000	
レオパレス21	255,500	266.00	67,963,000	貸付有価証券 117,200株(67,700 株)
スターツコーポレーショ ン	26,500	2,005.00	53,132,500	
フジ住宅	22,600	514.00	11,616,400	貸付有価証券 700株
空港施設	19,500	402.00	7,839,000	
明和地所	10,700	479.00	5,125,300	
ゴールドクレスト	15,400	1,624.00	25,009,600	貸付有価証券 4,900株
エスリード	7,600	1,396.00	10,609,600	貸付有価証券 3,500株
日神グループホールディ ングス	28,800	395.00	11,376,000	
日本エスコ	35,300	596.00	21,038,800	貸付有価証券 9,300株(8,200株)
タカラレーベン	89,100	349.00	31,095,900	
A V A N T I A	11,000	588.00	6,468,000	
イオンモール	97,800	1,363.00	133,301,400	貸付有価証券 23,200株
毎日コムネット	5,000	785.00	3,925,000	
ファースト住建	8,300	988.00	8,200,400	
カチタス	48,300	1,735.00	83,800,500	貸付有価証券 22,400株
トーセイ	26,900	931.00	25,043,900	貸付有価証券 12,600株
穴吹興産	4,200	1,374.00	5,770,800	
サンフロンティア不動産	26,900	820.00	22,058,000	貸付有価証券 500株
エフ・ジェー・ネクスト	17,000	818.00	13,906,000	貸付有価証券 7,800株
インテリックス	5,500	490.00	2,695,000	
ランドビジネス	8,200	254.00	2,082,800	

日本社宅サービス	4,500	882.00	3,969,000	
グランディハウス	15,100	359.00	5,420,900	貸付有価証券 200株(200株)
日本空港ビルデング	62,200	4,175.00	259,685,000	貸付有価証券 24,100株(100株)
日本工営	12,700	2,938.00	37,312,600	貸付有価証券 5,900株
L I F U L L	65,900	304.00	20,033,600	
ジェイエシーリクルー トメント	12,700	1,016.00	12,903,200	貸付有価証券 2,300株(2,100株)
日本M&Aセンター	142,700	2,955.00	421,678,500	
メンバーズ	5,600	1,352.00	7,571,200	
中広	1,900	430.00	817,000	
UTグループ	22,300	1,110.00	24,753,000	貸付有価証券 7,800株(4,800株)
アイティメディア	5,700	750.00	4,275,000	貸付有価証券 2,600株(1,100株)
タケエイ	18,100	779.00	14,099,900	貸付有価証券 400株
E・Jホールディングス	3,300	1,296.00	4,276,800	
ビーネックスグループ	23,600	511.00	12,059,600	貸付有価証券 11,000株
コシダカホールディング ス	45,500	367.00	16,698,500	貸付有価証券 20,200株
アルトナー	4,600	627.00	2,884,200	
パソナグループ	20,500	860.00	17,630,000	
C D S	4,700	1,135.00	5,334,500	
リンクアンドモチベー ション	41,600	306.00	12,729,600	貸付有価証券 15,500株(1,300株)
G C A	22,800	563.00	12,836,400	貸付有価証券 10,600株
エス・エム・エス	58,800	2,093.00	123,068,400	貸付有価証券 4,000株
サニーサイドアップグ ループ	4,900	577.00	2,827,300	
パーソルホールディング ス	188,900	1,086.00	205,145,400	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
リニカル	9,100	817.00	7,434,700	貸付有価証券 2,100株
クックパッド	65,900	300.00	19,770,000	貸付有価証券 100株(100株)



エスクリ	5,900	368.00	2,171,200	貸付有価証券 400株
アイ・ケイ・ケイ	9,200	624.00	5,740,800	貸付有価証券 4,200株
学情	6,700	1,296.00	8,683,200	貸付有価証券 2,200株
スタジオアリス	9,500	1,476.00	14,022,000	貸付有価証券 4,400株
シミックホールディングス	10,500	1,437.00	15,088,500	
エプコ	3,000	827.00	2,481,000	
N J S	4,200	1,645.00	6,909,000	貸付有価証券 1,800株
総合警備保障	75,200	5,260.00	395,552,000	
カカクコム	139,600	1,985.00	277,106,000	
セントケア・ホールディング	12,200	379.00	4,623,800	貸付有価証券 6,600株
サイネックス	3,200	591.00	1,891,200	
ルネサンス	10,500	1,007.00	10,573,500	貸付有価証券 4,800株
ディップ	26,600	1,738.00	46,230,800	貸付有価証券 12,500株（5,900株）
オプトホールディング	10,200	1,377.00	14,045,400	貸付有価証券 2,300株
新日本科学	20,400	528.00	10,771,200	貸付有価証券 6,300株
ツクイ	44,500	413.00	18,378,500	
キャリアデザインセンター	4,800	761.00	3,652,800	
ベネフィット・ワン	51,600	1,410.00	72,756,000	
エムスリー	416,600	3,195.00	1,331,037,000	貸付有価証券 500株
ツカダ・グローバルホールディング	12,000	340.00	4,080,000	
プラス	2,100	418.00	877,800	
アウトソーシング	108,100	470.00	50,807,000	貸付有価証券 50,700株
ウェルネット	19,100	472.00	9,015,200	
ワールドホールディングス	6,200	1,229.00	7,619,800	貸付有価証券 2,900株（600株）
ディー・エヌ・エー	92,600	1,182.00	109,453,200	貸付有価証券

				400株
博報堂D Yホールディングス	262,800	1,090.00	286,452,000	
ぐるなび	32,900	555.00	18,259,500	貸付有価証券 100株
タカミヤ	20,000	421.00	8,420,000	
ジャパンベストレスキューシステム	12,800	610.00	7,808,000	貸付有価証券 6,100株
ファンコミュニケーションズ	51,900	415.00	21,538,500	貸付有価証券 23,900株
ライク	6,200	1,403.00	8,698,600	貸付有価証券 2,800株（200株）
ビジネス・ブレイクスルー	7,900	342.00	2,701,800	貸付有価証券 200株
エスプール	36,400	550.00	20,020,000	貸付有価証券 2,900株
WDBホールディングス	8,600	2,107.00	18,120,200	
ティア	11,000	504.00	5,544,000	
CDG	2,000	1,382.00	2,764,000	
パリュウコマース	10,600	1,780.00	18,868,000	貸付有価証券 1,400株（100株）
インフォマート	207,000	711.00	147,177,000	貸付有価証券 93,300株（11,900株）
J Pホールディングス	59,300	259.00	15,358,700	貸付有価証券 900株
E P Sホールディングス	28,400	1,129.00	32,063,600	
レッグス	4,700	846.00	3,976,200	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
プレステージ・インターナショナル	70,700	829.00	58,610,300	貸付有価証券 1,400株
アミューズ	10,300	2,274.00	23,422,200	貸付有価証券 600株
ドリームインキュベータ	5,700	976.00	5,563,200	貸付有価証券 200株
クイック	11,700	984.00	11,512,800	
T A C	11,400	160.00	1,824,000	貸付有価証券 900株
ケネディクス	176,000	410.00	72,160,000	貸付有価証券 82,600株
電通グループ	194,700	2,087.00	406,338,900	貸付有価証券 91,400株

テイクアンドギヴ・ニーズ	7,200	558.00	4,017,600	
ぴあ	5,400	2,230.00	12,042,000	貸付有価証券 2,400株（1,400株）
イオンファンタジー	7,300	1,456.00	10,628,800	貸付有価証券 2,300株（2,000株）
シーティーエス	21,300	548.00	11,672,400	貸付有価証券 200株
ネクシィーズグループ	6,600	976.00	6,441,600	貸付有価証券 3,000株（1,900株）
みらかホールディングス	52,800	2,278.00	120,278,400	貸付有価証券 1,100株
アルプス技研	16,700	1,458.00	24,348,600	貸付有価証券 7,700株
ダイオーズ	3,700	1,030.00	3,811,000	貸付有価証券 2,100株
日本空調サービス	19,800	676.00	13,384,800	貸付有価証券 100株
オリエンタルランド	200,900	13,820.00	2,776,438,000	貸付有価証券 27,900株
ダスキン	48,500	2,841.00	137,788,500	
明光ネットワークジャパン	22,200	762.00	16,916,400	貸付有価証券 10,400株
ファルコホールディングス	10,400	1,771.00	18,418,400	
秀英予備校	4,100	400.00	1,640,000	貸付有価証券 1,800株
田谷	3,400	560.00	1,904,000	貸付有価証券 1,500株
ラウンドワン	52,700	562.00	29,617,400	
リゾートトラスト	86,600	1,056.00	91,449,600	貸付有価証券 28,600株（400株）
ピー・エム・エル	24,300	2,906.00	70,615,800	
ワタベウェディング	3,000	349.00	1,047,000	
りらいあコミュニケーションズ	34,100	1,045.00	35,634,500	
リソー教育	86,300	286.00	24,681,800	貸付有価証券 5,200株
早稲田アカデミー	6,100	912.00	5,563,200	貸付有価証券 100株
ユー・エス・エス	211,500	1,486.00	314,289,000	

東京個別指導学院	6,700	455.00	3,048,500	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
サイバーエージェント	108,600	4,190.00	455,034,000	貸付有価証券 50,500株
楽天	880,600	820.00	722,092,000	貸付有価証券 409,000株(14,700株)
クリーク・アンド・リバー社	9,700	750.00	7,275,000	貸付有価証券 300株
テー・オー・ダブリュー	30,100	271.00	8,157,100	貸付有価証券 14,000株(200株)
山田コンサルティンググループ	9,200	953.00	8,767,600	
セントラルスポーツ	7,000	2,292.00	16,044,000	貸付有価証券 3,100株
フルキャストホールディングス	18,900	1,236.00	23,360,400	貸付有価証券 8,800株(2,600株)
エン・ジャパン	33,600	2,022.00	67,939,200	貸付有価証券 1,800株
リソルホールディングス	2,000	3,375.00	6,750,000	貸付有価証券 900株
テクノプロ・ホールディングス	37,700	5,070.00	191,139,000	貸付有価証券 14,200株(5,000株)
アトラ	4,300	212.00	911,600	
インターワークス	3,600	385.00	1,386,000	
アイ・オールジャパンホールディングス	7,700	5,800.00	44,660,000	
KeePer 技研	6,900	1,416.00	9,770,400	貸付有価証券 500株(500株)
ファーストロジック	4,400	581.00	2,556,400	貸付有価証券 500株(300株)
三機サービス	3,600	984.00	3,542,400	
Gunosy	11,700	865.00	10,120,500	貸付有価証券 4,400株
デザインワン・ジャパン	3,700	173.00	640,100	貸付有価証券 100株
イー・ガーディアン	9,600	1,559.00	14,966,400	
リブセンス	12,100	251.00	3,037,100	貸付有価証券 100株
ジャパンマテリアル	58,100	1,419.00	82,443,900	
ベクトル	23,500	651.00	15,298,500	貸付有価証券 9,000株(100株)

ウチヤマホールディングス	9,300	321.00	2,985,300	貸付有価証券 4,300株
チャーム・ケア・コーポレーション	16,100	764.00	12,300,400	貸付有価証券 7,000株
ライクキッズ	3,200	488.00	1,561,600	
キャリアリンク	6,200	380.00	2,356,000	
I B J	12,900	495.00	6,385,500	
アサンテ	7,600	1,522.00	11,567,200	
N・フィールド	13,000	375.00	4,875,000	
バリューHR	7,500	1,363.00	10,222,500	貸付有価証券 2,000株（1,800株）
M&Aキャピタルパートナーズ	13,400	2,573.00	34,478,200	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,200	1,336.00	9,619,200	貸付有価証券 3,300株
E R Iホールディングス	5,300	610.00	3,233,000	
アピスト	2,900	1,752.00	5,080,800	
シグマクシス	12,900	1,243.00	16,034,700	
ウィルグループ	12,300	566.00	6,961,800	貸付有価証券 5,300株
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	26,100	153.00	3,993,300	
リクルートホールディングス	1,353,300	2,796.00	3,783,826,800	
エラン	11,200	1,445.00	16,184,000	貸付有価証券 2,600株
土木管理総合試験所	8,200	335.00	2,747,000	貸付有価証券 100株
ネットマーケティング	5,400	551.00	2,975,400	貸付有価証券 700株（700株）
日本郵政	1,548,400	845.70	1,309,481,880	貸付有価証券 1,600株
ベルシステム24ホールディングス	31,600	1,127.00	35,613,200	貸付有価証券 14,800株
鎌倉新書	14,200	1,062.00	15,080,400	貸付有価証券 6,300株（100株）
S M N	3,000	589.00	1,767,000	
一蔵	2,000	387.00	774,000	
L I T A L I C O	6,500	2,094.00	13,611,000	貸付有価証券 2,800株
グローバルキッズCOM	2,800	500.00	1,400,000	

P A N Y				
エアトリ	8,400	718.00	6,031,200	貸付有価証券 3,900株
アトラエ	4,900	2,578.00	12,632,200	貸付有価証券 2,200株
ストライク	7,100	3,520.00	24,992,000	貸付有価証券 900株
ソラスト	52,000	1,004.00	52,208,000	
セラク	5,900	676.00	3,988,400	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
インソース	9,200	2,422.00	22,282,400	貸付有価証券 1,200株（300株）
ベイカレント・コンサル ティング	11,400	5,060.00	57,684,000	貸付有価証券 5,300株（100株）
Orchestra H oldings	3,900	762.00	2,971,800	
アイモバイル	5,300	536.00	2,840,800	貸付有価証券 2,700株
キャリアインデックス	7,700	275.00	2,117,500	貸付有価証券 3,300株
MS - J a p a n	6,100	634.00	3,867,400	貸付有価証券 2,800株
船場	3,100	889.00	2,755,900	
グレイステクノロジー	8,600	2,555.00	21,973,000	貸付有価証券 3,600株
ジャパンエレベーター サービスホールディン	19,900	2,482.00	49,391,800	貸付有価証券 7,500株
フルテック	2,600	1,260.00	3,276,000	
グリーンズ	4,700	378.00	1,776,600	
ツナググループ・ホール ディングス	2,300	348.00	800,400	貸付有価証券 100株
GameWith	4,200	447.00	1,877,400	貸付有価証券 1,300株
ソウルドアウト	2,900	1,938.00	5,620,200	貸付有価証券 900株
MS & C o n s u l t i n g	2,600	488.00	1,268,800	
ミダック	1,800	904.00	1,627,200	貸付有価証券 500株
日総工産	12,500	437.00	5,462,500	貸付有価証券 300株（100株）
キュービーネットホール	7,800	1,611.00	12,565,800	貸付有価証券

ディングス				3,600株
RPAホールディングス	10,700	750.00	8,025,000	貸付有価証券 4,900株
スプリックス	6,400	641.00	4,102,400	貸付有価証券 2,400株（2,200株）
マネジメントソリューションズ	6,100	885.00	5,398,500	貸付有価証券 2,700株（300株）
and factory	1,800	1,104.00	1,987,200	
カーブスホールディングス	46,800	513.00	24,008,400	貸付有価証券 18,400株（4,800株）
アドバンテッジリスクマネジメント	9,500	602.00	5,719,000	貸付有価証券 1,300株
リログループ	103,300	2,267.00	234,181,100	貸付有価証券 700株
東祥	11,800	993.00	11,717,400	貸付有価証券 5,100株
エイチ・アイ・エス	29,400	1,413.00	41,542,200	貸付有価証券 11,800株
ラックランド	4,400	1,556.00	6,846,400	
共立メンテナンス	31,300	2,384.00	74,619,200	貸付有価証券 1,600株
イチネンホールディングス	21,200	1,148.00	24,337,600	
建設技術研究所	13,000	1,675.00	21,775,000	貸付有価証券 6,100株
スペース	12,200	1,091.00	13,310,200	貸付有価証券 5,700株
長大	6,900	793.00	5,471,700	貸付有価証券 100株（100株）
燦ホールディングス	8,200	1,193.00	9,782,600	
スバル興業	1,100	7,820.00	8,602,000	
東京テアトル	7,400	1,141.00	8,443,400	貸付有価証券 300株
タナベ経営	3,600	1,240.00	4,464,000	
ナガワ	6,000	6,870.00	41,220,000	貸付有価証券 2,000株
よみうりランド	4,100	3,290.00	13,489,000	貸付有価証券 1,900株
東京都競馬	12,400	2,795.00	34,658,000	貸付有価証券 5,600株
常磐興産	7,600	1,373.00	10,434,800	貸付有価証券

				3,500株
カナモト	30,900	2,103.00	64,982,700	貸付有価証券 14,300株
東京ドーム	76,500	724.00	55,386,000	貸付有価証券 33,500株
西尾レントオール	19,200	2,267.00	43,526,400	貸付有価証券 200株
トランス・コスモス	18,000	1,914.00	34,452,000	貸付有価証券 900株
乃村工藝社	81,000	820.00	66,420,000	貸付有価証券 38,000株
藤田観光	8,200	1,559.00	12,783,800	貸付有価証券 2,700株
KNT - CTホールディングス	11,700	724.00	8,470,800	貸付有価証券 5,400株
日本管財	20,200	1,769.00	35,733,800	貸付有価証券 2,600株
トーカイ	18,300	2,937.00	53,747,100	
白洋舎	2,200	2,682.00	5,900,400	
セコム	200,500	8,974.00	1,799,287,000	貸付有価証券 200株
セントラル警備保障	9,100	3,900.00	35,490,000	貸付有価証券 4,200株
丹青社	35,700	728.00	25,989,600	貸付有価証券 16,700株
メイテック	23,400	4,300.00	100,620,000	貸付有価証券 100株
応用地質	20,300	1,229.00	24,948,700	貸付有価証券 9,500株
船井総研ホールディングス	39,000	2,147.00	83,733,000	貸付有価証券 200株
進学会ホールディングス	7,400	443.00	3,278,200	貸付有価証券 3,400株
オオバ	13,600	507.00	6,895,200	
いであ	3,500	1,371.00	4,798,500	貸付有価証券 200株
学究社	5,500	1,156.00	6,358,000	
ベネッセホールディングス	62,900	2,751.00	173,037,900	
イオンディライト	23,300	3,305.00	77,006,500	貸付有価証券 10,900株
ナック	10,400	788.00	8,195,200	貸付有価証券



					4,800株
	ニチイ学館	26,900	1,034.00	27,814,600	
	ダイセキ	31,700	2,300.00	72,910,000	貸付有価証券 14,800株
	ステップ	6,900	1,435.00	9,901,500	
小計	銘柄数：2,146			390,332,931,970	
	組入時価比率：96.9%			100.0%	
合計				390,332,931,970	

(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(2020年3月31日現在)

(単位：円)

種類	通貨	銘柄	個数	評価額	備考
新株予約権証券	日本円	千葉興業銀行	52,900		0
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.0%	52,900		0 0.0%
合計					0

(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

種類	2020年 3月31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	10,639,620,296	-	10,648,770,000	8,773,999
合計	10,639,620,296	-	10,648,770,000	8,773,999

(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)

(2020年 3月31日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	8,803,379,855
コール・ローン	6,292,884,670
株式	532,708,715,674
投資証券	14,740,901,142
派生商品評価勘定	591,875,350
未収入金	10,866,851
未収配当金	962,507,146
差入委託証拠金	2,383,307,233
流動資産合計	566,494,437,921
資産合計	566,494,437,921
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	33,157,241
未払金	10,186,934,835
未払解約金	245,599,738
未払利息	11,518
その他未払費用	4,918,500
流動負債合計	10,470,621,832
負債合計	10,470,621,832
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	230,777,414,749
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	325,246,401,340
元本等合計	556,023,816,089
純資産合計	556,023,816,089
負債純資産合計	566,494,437,921

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
--------------------	---

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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 3月31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	2.4094円
(10,000口当たり純資産額)	(24,094円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月 2日 至 2020年 3月31日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月31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

2020年 3月31日現在	
期首	2019年 4月 2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	207,721,483,594円
同期中における追加設定元本額	56,924,689,531円
同期中における一部解約元本額	33,868,758,376円
期末元本額	230,777,414,749円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	45,606,729円
バランスセレクト50	144,817,704円
バランスセレクト70	155,428,916円
野村外国株式インデックスファンド	518,274,940円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	4,660,174,843円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	6,135,950,276円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,420,419,039円
野村資産設計ファンド2015	16,224,931円
野村資産設計ファンド2020	18,389,209円
野村資産設計ファンド2025	30,275,301円

野村資産設計ファンド2030	37,195,280円
野村資産設計ファンド2035	28,812,214円
野村資産設計ファンド2040	60,883,618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)	36,321,368,128円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	1,222,162,509円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	8,834,948,702円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	5,764,474,434円
野村資産設計ファンド2045	9,067,287円
野村インデックスファンド・外国株式	5,085,341,526円
マイ・ロード	1,600,015,897円
ネクストコア	15,297,514円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	129,365,827円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	1,570,017,565円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	607,510,683円
野村資産設計ファンド2050	14,984,107円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,900,497円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,203,199円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,775,244円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,124,486円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	223,325,959円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	440,681,091円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,914,635円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,672,056円
インデックス・ブレンド(タイプ)	22,713,083円
インデックス・ブレンド(タイプ)	7,480,531円
インデックス・ブレンド(タイプ)	29,087,179円
野村6資産均等バランス	643,512,929円
野村つみたて外国株投信	4,278,259,185円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	3,653,207,390円
世界6資産分散ファンド	67,538,180円
野村資産設計ファンド2060	4,928,471円
野村スリーゼロ先進国株式投信	415,117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	485,371,313円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	1,246,658,042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)	246,564,408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)	180,296,083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)	1,151,069,845円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,177,660,268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)	2,662,077円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	6,606,701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)	1,595,704円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	3,286,325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)	49,066,901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)	16,933,862円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	14,057,350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)	41,225,030円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	153,679,384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)	2,961,246,485円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	44,016,998円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	30,720,896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)	1,240,519,467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)	16,200,200,467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)	129,074円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	1,982,969円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	11,389,463円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	12,569,368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)	67,352,314,919円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	3,019,550,038円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	10,232,027,680円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	8,902,069,455円
マイバランスDC30	1,099,765,570円
マイバランスDC50	2,046,408,931円
マイバランスDC70	1,584,081,235円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	22,255,621,713円
野村DC運用戦略ファンド	216,326,337円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	15,363,144円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	275,786,534円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	228,702,850円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	174,633,368円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	10,685,299円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	5,768,243円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	23,250,293円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	2,756,083円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	2,088,740円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	2,110,719円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	93,721,552円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	62,582,474円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	26,822,093円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	30,055,352円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	667,236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(2020年3月31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	101,000	10.96	1,106,960.00
		HALLIBURTON CO	128,000	6.37	815,360.00
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	58,000	9.40	545,200.00
		SCHLUMBERGER LTD	214,000	13.28	2,841,920.00
		TECHNIPFMC PLC	61,000	7.05	430,050.00
		APACHE CORPORATION	54,100	4.11	222,351.00
		CABOT OIL & GAS CORP	64,000	17.51	1,120,640.00
		CHENIERE ENERGY INC	36,400	32.54	1,184,456.00
		CHEVRON CORP	296,000	71.95	21,297,200.00
		CONCHO RESOURCES INC	31,000	41.08	1,273,480.00
		CONOCOPHILLIPS	171,000	29.29	5,008,590.00
		CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	13,900	7.71	107,169.00
		DEVON ENERGY CORP	62,400	6.35	396,240.00
		DIAMONDBACK ENERGY INC	23,100	23.59	544,929.00
		EOG RESOURCES INC	90,400	34.98	3,162,192.00
		EXXON MOBIL CORP	662,100	37.50	24,828,750.00
		HESS CORP	43,200	31.93	1,379,376.00
		HOLLYFRONTIER CORP	23,600	26.02	614,072.00
		KINDER MORGAN INC	315,000	13.27	4,180,050.00
		MARATHON OIL CORP	123,000	3.24	398,520.00
		MARATHON PETROLEUM CORP	98,500	24.33	2,396,505.00
		NOBLE ENERGY INC	71,000	5.31	377,010.00
		OCCIDENTAL PETE CORP	142,000	11.01	1,563,420.00
		ONEOK INC	67,000	20.04	1,342,680.00
		PHILLIPS 66	70,300	54.16	3,807,448.00
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	26,100	66.49	1,735,389.00
		TARGA RESOURCES CORP	34,800	6.48	225,504.00
		VALERO ENERGY CORP	62,800	47.19	2,963,532.00
		WILLIAMS COS	191,000	13.82	2,639,620.00
		AIR PRODUCTS	34,700	206.53	7,166,591.00
		ALBEMARLE CORP	16,700	55.60	928,520.00
		AXALTA COATING SYSTEMS LTD	29,200	18.07	527,644.00
CELANESE CORP-SERIES A	19,600	74.10	1,452,360.00		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	35,300	26.62	939,686.00		
CORTEVA INC	115,000	24.09	2,770,350.00		

DOW INC	115,200	28.65	3,300,480.00
DUPONT DE NEMOURS INC	115,000	33.62	3,866,300.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	20,800	47.61	990,288.00
ECOLAB INC	40,100	161.40	6,472,140.00
FMC CORP	19,600	82.64	1,619,744.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	15,500	108.01	1,674,155.00
LINDE PLC	84,200	176.80	14,886,560.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	42,100	49.58	2,087,318.00
MOSAIC CO/THE	56,000	10.00	560,000.00
PPG INDUSTRIES	36,800	85.92	3,161,856.00
RPM INTERNATIONAL INC	21,100	61.10	1,289,210.00
SHERWIN-WILLIAMS	12,930	481.83	6,230,061.90
WESTLAKE CHEMICAL CORP	5,000	37.87	189,350.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	9,700	179.52	1,741,344.00
VULCAN MATERIALS CO	20,800	101.86	2,118,688.00
AMCOR PLC	250,000	8.28	2,070,000.00
AVERY DENNISON CORP	13,400	104.77	1,403,918.00
BALL CORP	47,500	65.99	3,134,525.00
CROWN HOLDINGS INC	21,200	58.52	1,240,624.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	59,800	31.33	1,873,534.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	14,500	90.76	1,316,020.00
SEALED AIR CORP	21,900	25.73	563,487.00
WESTROCK CO	38,700	29.00	1,122,300.00
FREEMONT-MCMORAN INC	225,000	6.24	1,404,000.00
NEWMONT CORP	127,600	46.36	5,915,536.00
NUCOR CORP	46,700	34.92	1,630,764.00
STEEL DYNAMICS	33,400	21.83	729,122.00
ARCONIC INC	57,000	16.40	934,800.00
BOEING CO	83,800	152.28	12,761,064.00
GENERAL DYNAMICS	38,300	133.60	5,116,880.00
HEICO CORP	6,300	76.89	484,407.00
HEICO CORP-CLASS A	12,400	66.01	818,524.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	6,500	189.54	1,232,010.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	34,400	181.96	6,259,424.00
LOCKHEED MARTIN	39,790	348.85	13,880,741.50



NORTHROP GRUMMAN CORP	25,160	313.72	7,893,195.20
RAYTHEON COMPANY	43,300	141.21	6,114,393.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	14,600	24.25	354,050.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,770	295.38	1,704,342.60
TEXTRON INC	33,500	27.67	926,945.00
TRANSDIGM GROUP INC	7,660	342.75	2,625,465.00
UNITED TECHNOLOGIES	128,600	98.49	12,665,814.00
ALLEGION PLC	14,800	95.01	1,406,148.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	21,600	44.51	961,416.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	120,000	26.49	3,178,800.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,100	187.18	954,618.00
MASCO CORP	42,800	35.27	1,509,556.00
OWENS CORNING INC	16,800	39.88	669,984.00
SMITH (A.O.) CORP	21,800	38.60	841,480.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	20,000	77.99	1,559,800.00
ACUITY BRANDS INC	6,200	85.76	531,712.00
AMETEK INC	35,500	73.72	2,617,060.00
EATON CORP PLC	64,500	78.32	5,051,640.00
EMERSON ELEC	93,800	46.63	4,373,894.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	17,800	152.26	2,710,228.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	24,500	29.36	719,320.00
3M CORP	90,200	137.74	12,424,148.00
GENERAL ELEC CO	1,355,000	7.89	10,690,950.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	112,000	131.75	14,756,000.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	35,400	47.00	1,663,800.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	33,300	20.75	690,975.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	16,410	317.46	5,209,518.60
CATERPILLAR INC DEL	86,800	111.71	9,696,428.00
CUMMINS INC	22,600	134.48	3,039,248.00
DEERE & COMPANY	47,100	141.23	6,651,933.00
DOVER CORP	22,900	85.64	1,961,156.00
FLOWSERVE CORP	20,600	22.49	463,294.00
FORTIVE CORP	47,600	52.10	2,479,960.00
IDEX CORP	12,300	136.88	1,683,624.00

ILLINOIS TOOL WORKS INC	50,000	142.35	7,117,500.00
INGERSOLL-RAND INC	52,842	23.75	1,254,997.50
MIDDLEBY CORP	8,700	57.00	495,900.00
PACCAR	53,800	62.27	3,350,126.00
PARKER HANNIFIN CORP	20,100	130.35	2,620,035.00
PENTAIR PLC	23,200	29.63	687,416.00
SNAP-ON INC	8,400	113.03	949,452.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	23,900	100.38	2,399,082.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	37,600	84.30	3,169,680.00
WABCO HOLDINGS INC	8,100	135.12	1,094,472.00
WABTEC CORP	28,800	49.22	1,417,536.00
XYLEM INC	27,800	66.24	1,841,472.00
AERCAP HOLDINGS NV	17,000	22.78	387,260.00
FASTENAL CO	87,400	31.80	2,779,320.00
GRAINGER(W.W.) INC	7,000	255.14	1,785,980.00
HD SUPPLY HOLDINGS INC	26,800	27.64	740,752.00
UNITED RENTALS INC	11,200	95.16	1,065,792.00
CINTAS CORP	13,400	180.45	2,418,030.00
COPART INC	31,900	71.84	2,291,696.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	34,300	76.65	2,629,095.00
ROLLINS INC	23,900	35.84	856,576.00
WASTE CONNECTIONS INC	40,300	77.39	3,118,817.00
WASTE MANAGEMENT INC	66,800	94.60	6,319,280.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	20,100	65.19	1,310,319.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	27,300	66.97	1,828,281.00
FEDEX CORPORATION	39,100	124.31	4,860,521.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	109,900	97.84	10,752,616.00
XPO LOGISTICS INC	14,300	51.43	735,449.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,600	12.25	178,850.00
DELTA AIR LINES INC	25,200	28.67	722,484.00
SOUTHWEST AIRLINES	19,800	35.10	694,980.00
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	9,200	30.16	277,472.00
AMERCO	1,170	295.98	346,296.60
CSX CORP	116,200	58.02	6,741,924.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	13,200	93.56	1,234,992.00

KANSAS CITY SOUTHERN	15,100	129.38	1,953,638.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	20,800	33.29	692,432.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	40,300	148.29	5,976,087.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	15,300	134.67	2,060,451.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	65,500	27.83	1,822,865.00	
UNION PAC CORP	108,800	140.20	15,253,760.00	
APTIV PLC	39,200	49.92	1,956,864.00	
AUTOLIV INC	11,900	46.72	555,968.00	
BORGWARNER INC	29,600	24.58	727,568.00	
LEAR CORP	8,400	88.55	743,820.00	
FORD MOTOR COMPANY	607,000	5.03	3,053,210.00	
GENERAL MOTORS CO	199,000	21.32	4,242,680.00	
HARLEY-DAVIDSON INC	22,400	17.92	401,408.00	
TESLA INC	21,210	502.13	10,650,177.30	
DR HORTON INC	53,800	36.84	1,981,992.00	
GARMIN LTD	20,500	76.69	1,572,145.00	
LEGGETT & PLATT INC	18,900	28.07	530,523.00	
LENNAR CORP-A	43,000	39.96	1,718,280.00	
MOHAWK INDUSTRIES	8,700	80.15	697,305.00	
NEWELL BRANDS INC	66,000	13.64	900,240.00	
NVR INC	559	2,714.31	1,517,299.29	
PULTEGROUP INC	37,900	23.76	900,504.00	
WHIRLPOOL CORP	9,400	87.71	824,474.00	
HASBRO INC	19,600	71.48	1,401,008.00	
POLARIS INC	8,300	47.17	391,511.00	
CAPRI HOLDINGS LTD	19,900	11.25	223,875.00	
HANESBRANDS INC	51,000	8.06	411,060.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	17,200	193.94	3,335,768.00	
NIKE INC-B	195,200	85.38	16,666,176.00	
PVH CORP	11,600	38.22	443,352.00	
RALPH LAUREN CORPORATION	7,800	71.26	555,828.00	
TAPESTRY INC	45,000	13.21	594,450.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	24,000	9.57	229,680.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	25,000	8.41	210,250.00	

V F CORP	52,500	59.75	3,136,875.00
ARAMARK	41,000	21.09	864,690.00
CARNIVAL CORP	62,100	12.80	794,880.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,120	639.97	2,636,676.40
DARDEN RESTAURANTS INC	19,800	56.85	1,125,630.00
DOMINOS PIZZA INC	5,900	346.75	2,045,825.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	41,600	68.68	2,857,088.00
LAS VEGAS SANDS CORP	53,800	43.49	2,339,762.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	43,200	76.16	3,290,112.00
MCDONALD'S CORP	117,900	168.13	19,822,527.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	12.47	423,980.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	79,000	11.53	910,870.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	33,000	10.68	352,440.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	26,600	29.77	791,882.00
STARBUCKS CORP	185,200	67.86	12,567,672.00
VAIL RESORTS INC	6,000	148.96	893,760.00
WYNN RESORTS LTD	15,500	61.10	947,050.00
YUM BRANDS INC	47,100	70.67	3,328,557.00
GENUINE PARTS CO	23,200	66.08	1,533,056.00
LKQ CORP	45,000	21.00	945,000.00
AMAZON.COM INC	65,840	1,963.95	129,306,468.00
BOOKING HOLDINGS INC	6,500	1,308.23	8,503,495.00
EBAY INC	120,000	31.19	3,742,800.00
EXPEDIA GROUP INC	20,700	56.39	1,167,273.00
GRUBHUB INC	14,500	39.55	573,475.00
MERCADOLIBRE INC	6,910	473.29	3,270,433.90
WAYFAIR INC - CLASS A	8,600	52.01	447,286.00
DOLLAR GENERAL CORP	39,700	146.77	5,826,769.00
DOLLAR TREE INC	37,600	79.85	3,002,360.00
KOHL'S CORP	25,300	16.03	405,559.00
NORDSTROM INC	15,000	15.78	236,700.00
TARGET CORP	78,800	96.01	7,565,588.00
ADVANCE AUTO PARTS	10,900	96.50	1,051,850.00
AUTOZONE	3,680	873.99	3,216,283.20
BEST BUY COMPANY INC	36,300	59.75	2,168,925.00
BURLINGTON STORES INC	10,500	162.53	1,706,565.00

CARMAX INC	26,100	55.75	1,455,075.00
GAP INC	31,500	7.42	233,730.00
HOME DEPOT	170,600	196.10	33,454,660.00
LOWES COS INC	120,500	88.71	10,689,555.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	11,970	318.19	3,808,734.30
ROSS STORES INC	56,100	84.87	4,761,207.00
TIFFANY & CO	16,900	128.49	2,171,481.00
TJX COS INC	189,800	47.55	9,024,990.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	17,800	85.55	1,522,790.00
ULTA BEAUTY INC	8,500	179.71	1,527,535.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	69,160	291.12	20,133,859.20
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,000	4.44	199,800.00
KROGER CO	126,900	29.65	3,762,585.00
SYSCO CORP	75,800	46.35	3,513,330.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	118,200	45.16	5,337,912.00
WALMART INC	222,500	115.19	25,629,775.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	47,800	56.63	2,706,914.00
COCA COLA CO	636,800	45.00	28,656,000.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	35,100	36.80	1,291,680.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	25,900	146.44	3,792,796.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	28,400	40.30	1,144,520.00
MONSTER BEVERAGE CORP	63,800	58.00	3,700,400.00
PEPSICO INC	218,200	125.48	27,379,736.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	88,400	35.83	3,167,372.00
BUNGE LIMITED	22,000	39.59	870,980.00
CAMPBELL SOUP CO	24,800	46.53	1,153,944.00
CONAGRA BRANDS INC	76,900	28.23	2,170,887.00
GENERAL MILLS	94,300	54.10	5,101,630.00
HERSHEY CO/THE	23,500	137.78	3,237,830.00
HORMEL FOODS CORP	45,600	46.78	2,133,168.00
INGREDION INC	9,600	77.28	741,888.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	17,400	110.63	1,924,962.00
KELLOGG CO	40,000	60.91	2,436,400.00
KRAFT HEINZ CO/THE	104,100	25.17	2,620,197.00
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,700	57.64	1,250,788.00

MCCORMICK & CO INC.	18,900	143.15	2,705,535.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	225,900	51.13	11,550,267.00
TYSON FOODS INC-CL A	46,900	59.15	2,774,135.00
ALTRIA GROUP INC	293,100	37.31	10,935,561.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	243,700	72.55	17,680,435.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	37,500	64.81	2,430,375.00
CLOROX CO	19,300	174.48	3,367,464.00
COLGATE PALMOLIVE CO.	126,500	66.58	8,422,370.00
KIMBERLY-CLARK CORP	53,300	132.43	7,058,519.00
PROCTER & GAMBLE CO	389,900	115.00	44,838,500.00
COTY INC-CL A	49,000	5.41	265,090.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	34,400	165.23	5,683,912.00
ABBOTT LABORATORIES	276,800	79.34	21,961,312.00
ABIOMED INC	7,200	148.99	1,072,728.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	11,800	179.92	2,123,056.00
BAXTER INTERNATIONAL INC.	75,500	82.19	6,205,345.00
BECTON,DICKINSON	42,000	222.87	9,360,540.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	219,300	31.64	6,938,652.00
DANAHER CORP	98,100	140.82	13,814,442.00
DENTSPLY SIRONA INC	35,200	39.20	1,379,840.00
DEXCOM INC	14,480	278.00	4,025,440.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	32,500	196.06	6,371,950.00
HOLOGIC INC	43,300	35.00	1,515,500.00
IDEXX LABORATORIES INC	13,600	241.02	3,277,872.00
INSULET CORP	9,800	174.58	1,710,884.00
INTUITIVE SURGICAL INC	18,150	504.22	9,151,593.00
MEDTRONIC PLC	209,900	92.05	19,321,295.00
RESMED INC	22,500	154.21	3,469,725.00
STERIS PLC	12,900	139.99	1,805,871.00
STRYKER CORP	52,900	162.96	8,620,584.00
TELEFLEX INC	7,140	288.34	2,058,747.60
THE COOPER COMPANIES, INC.	7,580	280.15	2,123,537.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	14,200	103.72	1,472,824.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	11,800	151.81	1,791,358.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	31,900	98.28	3,135,132.00

AMERISOURCEBERGEN CORP	23,900	88.10	2,105,590.00	
ANTHEM INC	39,400	230.58	9,084,852.00	
CARDINAL HEALTH INC	44,300	48.44	2,145,892.00	
CENTENE CORP	92,100	57.71	5,315,091.00	
CIGNA CORP	58,000	178.26	10,339,080.00	
CVS HEALTH CORP	204,000	59.68	12,174,720.00	
DAVITA INC	14,800	76.41	1,130,868.00	
HCA HEALTHCARE INC	42,400	90.96	3,856,704.00	
HENRY SCHEIN INC	23,100	52.09	1,203,279.00	
HUMANA INC	20,490	311.23	6,377,102.70	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	14,900	131.95	1,966,055.00	
MCKESSON CORP	25,600	138.02	3,533,312.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	20,500	83.06	1,702,730.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	148,200	251.28	37,239,696.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	11,800	100.13	1,181,534.00	
ABBVIE INC	231,600	75.24	17,425,584.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	34,200	87.26	2,984,292.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	17,500	108.83	1,904,525.00	
AMGEN INC	93,000	208.48	19,388,640.00	
BEIGENE, LTD ADR	6,300	125.39	789,957.00	
BIOGEN INC	28,340	316.13	8,959,124.20	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	28,000	82.49	2,309,720.00	
EXACT SCIENCES CORP	22,600	58.43	1,320,518.00	
GILEAD SCIENCES INC	198,200	75.93	15,049,326.00	
INCYTE CORP	28,500	72.17	2,056,845.00	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	21,400	48.21	1,031,694.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,200	91.59	1,300,578.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	12,750	473.00	6,030,750.00	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	11,200	98.52	1,103,424.00	
SEATTLE GENETICS INC	18,700	115.29	2,155,923.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	40,400	231.92	9,369,568.00	
ALLERGAN PLC	51,000	176.31	8,991,810.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	367,000	54.39	19,961,130.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	60,000	22.59	1,355,400.00	
ELI LILLY & CO.	135,300	138.44	18,730,932.00	

JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	9,000	99.60	896,400.00	
JOHNSON & JOHNSON	411,400	133.01	54,720,314.00	
MERCK & CO INC	398,300	76.95	30,649,185.00	
MYLAN NV	77,000	15.07	1,160,390.00	
PERRIGO CO PLC	19,600	48.81	956,676.00	
PFIZER INC	865,800	32.67	28,285,686.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	167,000	8.51	1,421,170.00	
ZOETIS INC	74,000	116.68	8,634,320.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,337,000	22.04	29,467,480.00	
CITIGROUP	342,100	44.08	15,079,768.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	70,000	19.65	1,375,500.00	
COMERICA INC	23,000	31.03	713,690.00	
EAST WEST BANCORP INC	20,700	26.89	556,623.00	
FIFTH THIRD BANCORP	112,000	15.86	1,776,880.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	25,700	86.40	2,220,480.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	154,000	8.37	1,289,750.00	
JPMORGAN CHASE & CO	490,300	93.50	45,843,050.00	
KEYCORP	158,000	10.79	1,704,820.00	
M & T BANK CORP	20,000	106.90	2,138,000.00	
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	71,000	11.51	817,210.00	
PNC FINANCIAL	68,900	100.97	6,956,833.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	150,000	9.50	1,425,000.00	
SIGNATURE BANK	8,900	83.02	738,878.00	
SVB FINANCIAL GROUP	8,100	155.78	1,261,818.00	
TRUIST FINANCIAL CORP	208,500	32.56	6,788,760.00	
US BANCORP	230,500	35.87	8,268,035.00	
WELLS FARGO CO	629,100	29.92	18,822,672.00	
ZIONS BANCORP NA	27,500	27.52	756,800.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	205,500	183.18	37,643,490.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	62,000	15.46	958,520.00	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	43,000	14.00	602,000.00	
VOYA FINANCIAL INC	21,700	41.47	899,899.00	
AFLAC INC	114,700	36.26	4,159,022.00	
ALLEGHANY CORP	2,300	565.60	1,300,880.00	
ALLSTATE CORP	50,600	94.64	4,788,784.00	



AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,500	71.56	894,500.00	
AMERICAN INTL GROUP	137,800	25.71	3,542,838.00	
AON PLC	36,900	171.03	6,311,007.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	63,900	30.54	1,951,506.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	29,700	83.22	2,471,634.00	
ASSURANT INC	9,000	107.33	965,970.00	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,200	26.31	557,772.00	
BROWN & BROWN INC	38,800	37.30	1,447,240.00	
CHUBB LTD	71,200	114.04	8,119,648.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	24,600	79.74	1,961,604.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	3,700	174.34	645,058.00	
EVEREST RE GROUP LTD	6,200	198.49	1,230,638.00	
FNF GROUP	40,500	26.40	1,069,200.00	
GLOBE LIFE INC	15,700	74.22	1,165,254.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	54,500	35.84	1,953,280.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	29,900	27.28	815,672.00	
LOEWS CORP	43,300	35.43	1,534,119.00	
MARKEL CORP	2,130	946.99	2,017,088.70	
MARSH & MCLENNAN COS	79,400	89.55	7,110,270.00	
METLIFE INC	120,600	32.03	3,862,818.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	44,400	33.21	1,474,524.00	
PROGRESSIVE CO	92,000	76.18	7,008,560.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	63,000	53.75	3,386,250.00	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	9,000	86.92	782,280.00	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	6,700	152.11	1,019,137.00	
TRAVELERS COS INC/THE	40,800	102.59	4,185,672.00	
UNUM GROUP	31,200	15.94	497,328.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	20,200	172.95	3,493,590.00	
WR BERKLEY CORP	21,700	54.51	1,182,867.00	
ACCENTURE PLC-CL A	99,500	169.82	16,897,090.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	25,800	94.19	2,430,102.00	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,600	34.30	226,380.00	
AUTOMATIC DATA PROCESS	67,900	137.82	9,357,978.00	
BLACK KNIGHT INC	24,200	58.95	1,426,590.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	22,600	71.28	1,610,928.00	

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	17,900	96.94	1,735,226.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	86,600	47.38	4,103,108.00
DXC TECHNOLOGY CO	37,800	14.44	545,832.00
EPAM SYSTEMS INC	8,400	188.22	1,581,048.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	96,400	125.29	12,077,956.00
FISERV INC	90,800	98.33	8,928,364.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	13,800	194.02	2,677,476.00
GARTNER INC	14,100	107.81	1,520,121.00
GLOBAL PAYMENTS INC	47,300	151.23	7,153,179.00
GODADDY INC - CLASS A	26,900	59.16	1,591,404.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	138,800	112.93	15,674,684.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,700	156.05	1,825,785.00
LEIDOS HOLDINGS INC	21,500	93.43	2,008,745.00
MASTERCARD INC	140,390	253.25	35,553,767.50
MONGODB INC	7,400	136.43	1,009,582.00
OKTA INC	16,500	124.94	2,061,510.00
PAYCHEX INC	50,500	64.42	3,253,210.00
PAYPAL HOLDINGS INC	174,700	97.03	16,951,141.00
SABRE CORP	42,000	6.23	261,660.00
SQUARE INC - A	53,100	55.00	2,920,500.00
TWILIO INC - A	18,600	97.00	1,804,200.00
VERISIGN INC	16,200	188.55	3,054,510.00
VISA INC-CLASS A SHARES	267,800	165.57	44,339,646.00
WESTERN UNION CO	66,000	18.91	1,248,060.00
WIX.COM LTD	7,700	104.48	804,496.00
ADOBE INC	75,760	318.39	24,121,226.40
ANSYS INC	13,400	235.13	3,150,742.00
AUTODESK INC.	34,200	155.91	5,332,122.00
CADENCE DESIGN SYS INC	44,600	66.91	2,984,186.00
CDK GLOBAL INC	20,000	34.15	683,000.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	18,900	99.19	1,874,691.00
CITRIX SYSTEMS INC	19,900	145.91	2,903,609.00
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	5,500	86.76	477,180.00
DOCUSIGN INC	16,600	88.14	1,463,124.00

DROPBOX INC-CLASS A	39,000	18.15	707,850.00	
FORTINET INC	22,800	100.95	2,301,660.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	12,100	83.08	1,005,268.00	
INTUIT INC	40,400	238.05	9,617,220.00	
MICROSOFT CORP	1,132,100	160.23	181,396,383.00	
NORTONLIFELOCK INC	98,000	19.10	1,871,800.00	
ORACLE CORPORATION	359,800	50.36	18,119,528.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	15,200	166.47	2,530,344.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	7,540	213.12	1,606,924.80	
PTC INC	17,000	59.27	1,007,590.00	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	11,900	228.03	2,713,557.00	
SALESFORCE.COM INC	130,400	149.85	19,540,440.00	
SERVICENOW INC	29,630	286.39	8,485,735.70	
SPLUNK INC	23,700	127.22	3,015,114.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	36,700	43.73	1,604,891.00	
SYNOPSYS INC	23,900	129.31	3,090,509.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,100	300.81	1,834,941.00	
VMWARE INC - CLASS A	13,000	120.52	1,566,760.00	
WORKDAY INC-CLASS A	25,400	137.30	3,487,420.00	
ARISTA NETWORKS INC	8,100	205.73	1,666,413.00	
CISCO SYSTEMS	663,800	40.32	26,764,416.00	
F5 NETWORKS INC	9,300	109.81	1,021,233.00	
JUNIPER NETWORKS INC	53,000	20.25	1,073,250.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	26,800	133.37	3,574,316.00	
APPLE INC	694,070	254.81	176,855,976.70	
DELL TECHNOLOGIES-C	26,600	39.80	1,058,680.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	202,000	10.05	2,030,100.00	
HP INC	232,000	17.84	4,138,880.00	
NETAPP INC	35,200	40.72	1,433,344.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	37,300	49.87	1,860,151.00	
WESTERN DIGITAL CORP	47,600	43.51	2,071,076.00	
XEROX HOLDINGS CORP	28,900	17.95	518,755.00	
AMPHENOL CORP-CL A	46,400	75.83	3,518,512.00	
ARROW ELECTRS INC	12,100	53.72	650,012.00	
CDW CORPORATION	22,400	96.91	2,170,784.00	

COGNEX CORP	27,800	45.46	1,263,788.00	
CORNING INC	119,000	21.28	2,532,320.00	
FLEX LTD	76,000	8.40	638,400.00	
FLIR SYSTEMS INC	20,700	32.14	665,298.00	
IPG PHOTONICS CORP	5,900	109.20	644,280.00	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	28,900	85.66	2,475,574.00	
TE CONNECTIVITY LTD	52,400	63.72	3,338,928.00	
TRIMBLE INC	38,800	31.03	1,203,964.00	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	8,400	188.35	1,582,140.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	166,300	47.86	7,959,118.00	
ANALOG DEVICES INC	58,100	90.97	5,285,357.00	
APPLIED MATERIALS	143,600	47.30	6,792,280.00	
BROADCOM INC	62,200	240.11	14,934,842.00	
INTEL CORP	680,200	55.49	37,744,298.00	
KLA CORP	24,400	149.52	3,648,288.00	
LAM RESEARCH	22,400	255.30	5,718,720.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	99,000	22.70	2,247,300.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	42,400	49.91	2,116,184.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	37,300	68.99	2,573,327.00	
MICRON TECHNOLOGY	174,000	44.52	7,746,480.00	
NVIDIA CORP	90,990	265.59	24,166,034.10	
NXP SEMICONDUCTORS NV	43,200	84.93	3,668,976.00	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	59,000	12.97	765,230.00	
QORVO INC	17,600	81.48	1,434,048.00	
QUALCOMM INC	179,100	69.03	12,363,273.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	27,200	90.11	2,450,992.00	
TERADYNE INC	25,000	55.24	1,381,000.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	146,500	102.02	14,945,930.00	
XILINX INC	39,900	79.35	3,166,065.00	
AT & T INC	1,142,400	30.23	34,534,752.00	
CENTURYLINK INC	148,000	9.84	1,456,320.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	646,800	54.77	35,425,236.00	
SPRINT CORP	129,000	8.44	1,088,760.00	
T-MOBILE US INC	53,000	83.12	4,405,360.00	
ALLIANT ENERGY CORP	37,600	50.57	1,901,432.00	

AMERICAN ELECTRIC POWER	77,700	83.71	6,504,267.00	
DUKE ENERGY CORP	113,800	83.46	9,497,748.00	
EDISON INTERNATIONAL	55,500	56.31	3,125,205.00	
ENTERGY CORP	31,300	100.07	3,132,191.00	
EVERGY INC	35,900	59.11	2,122,049.00	
EVERSOURCE ENERGY	50,300	83.65	4,207,595.00	
EXELON CORPORATION	151,500	37.23	5,640,345.00	
FIRSTENERGY CORP	83,400	40.49	3,376,866.00	
NEXTERA ENERGY INC	76,500	246.01	18,819,765.00	
OGE ENERGY CORP	32,500	31.90	1,036,750.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	17,000	78.36	1,332,120.00	
PPL CORPORATION	114,800	25.83	2,965,284.00	
SOUTHERN CO.	164,700	57.99	9,550,953.00	
XCEL ENERGY INC	81,200	62.56	5,079,872.00	
ATMOS ENERGY CORP	18,400	102.82	1,891,888.00	
UGI CORP	30,900	26.91	831,519.00	
AMEREN CORPORATION	39,100	78.17	3,056,447.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	75,400	16.23	1,223,742.00	
CMS ENERGY CORP	43,300	61.94	2,682,002.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	52,500	80.73	4,238,325.00	
DOMINION ENERGY INC	127,800	76.81	9,816,318.00	
DTE ENERGY COMPANY	30,500	99.43	3,032,615.00	
NISOURCE INC	58,200	26.08	1,517,856.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	78,100	44.51	3,476,231.00	
SEMPRA ENERGY	43,600	119.99	5,231,564.00	
WEC ENERGY GROUP INC	49,800	91.89	4,576,122.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,300	126.72	3,586,176.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	34,900	43.05	1,502,445.00	
ALLY FINANCIAL INC	57,400	15.32	879,368.00	
AMERICAN EXPRESS CO	107,900	90.27	9,740,133.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	72,300	53.87	3,894,801.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	49,600	37.59	1,864,464.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	94,000	16.77	1,576,380.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	20,300	109.15	2,215,745.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	127,900	34.00	4,348,600.00	

BLACKROCK INC	18,190	455.35	8,282,816.50
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	104,000	47.28	4,917,120.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	17,900	93.03	1,665,237.00
CME GROUP INC	56,200	173.99	9,778,238.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	35,000	35.31	1,235,850.00
EATON VANCE CORP	16,400	33.78	553,992.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,920	268.07	1,586,974.40
FRANKLIN RESOURCES INC	43,400	17.76	770,784.00
GOLDMAN SACHS GROUP	50,100	159.62	7,996,962.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	87,600	83.81	7,341,756.00
INVESCO LTD	58,000	9.56	554,480.00
KKR & CO INC-A	78,400	24.52	1,922,368.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	5,840	351.32	2,051,708.80
MOODYS CORP	26,800	222.22	5,955,496.00
MORGAN STANLEY	191,000	34.84	6,654,440.00
MSCI INC	13,160	293.72	3,865,355.20
NASDAQ INC	18,400	99.44	1,829,696.00
NORTHERN TRUST CORP	32,100	75.79	2,432,859.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	19,600	64.40	1,262,240.00
S&P GLOBAL INC	38,400	246.99	9,484,416.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	179,700	34.33	6,169,101.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	46.44	887,004.00
STATE STREET CORP	55,900	51.77	2,893,943.00
T ROWE PRICE GROUP INC	36,600	98.83	3,617,178.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	41,200	35.44	1,460,128.00
AES CORP	101,000	13.66	1,379,660.00
NRG ENERGY INC	40,500	28.45	1,152,225.00
VISTRA ENERGY CORP	59,000	16.06	947,540.00
CERNER CORP	49,900	64.24	3,205,576.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	20,700	157.94	3,269,358.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	49,000	72.67	3,560,830.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	3,640	349.11	1,270,760.40
ILLUMINA INC	22,880	276.23	6,320,142.40
IQVIA HOLDINGS INC	25,200	112.98	2,847,096.00
METTLER-TOLEDO INTL	3,880	685.40	2,659,352.00

PERKINELMER INC	17,400	76.51	1,331,274.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	62,800	284.96	17,895,488.00
WATERS CORP	10,300	188.14	1,937,842.00
COSTAR GROUP INC	5,810	599.99	3,485,941.90
EQUIFAX INC	18,500	122.10	2,258,850.00
IHS MARKIT LTD	59,300	61.86	3,668,298.00
MANPOWERGROUP INC	9,600	55.18	529,728.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	54,000	13.09	706,860.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17,100	40.31	689,301.00
TRUNSION	29,000	68.18	1,977,220.00
VERISK ANALYTICS INC	24,200	146.87	3,554,254.00
CBRE GROUP INC	48,300	41.03	1,981,749.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	184,000	3.79	697,360.00
JONES LANG LASALLE INC	7,600	107.44	816,544.00
ALTICE USA INC-A	20,000	22.91	458,200.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	23,590	450.78	10,633,900.20
COMCAST CORP-CL A	710,400	35.49	25,212,096.00
DISCOVERY INC - A	24,500	20.01	490,245.00
DISCOVERY INC - C	57,000	17.95	1,023,150.00
DISH NETWORK CORP-A	37,100	20.73	769,083.00
FOX CORP-CLASS A	52,800	24.31	1,283,568.00
FOX CORP-CLASS B	25,400	23.77	603,758.00
INTERPUBLIC GROUP	58,000	16.20	939,600.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	16,700	114.04	1,904,468.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	64,000	15.70	1,004,800.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	16.69	400,560.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	26,700	30.56	815,952.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	30.26	390,354.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	55,000	8.82	485,100.00
OMNICOM GROUP	34,500	54.92	1,894,740.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	229,000	4.81	1,101,490.00
VIACOMCBS INC-CLASS B	88,000	14.08	1,239,480.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	120,800	58.47	7,063,176.00
DISNEY (WALT) CO	282,000	99.80	28,143,600.00
ELECTRONIC ARTS	46,100	97.69	4,503,509.00

	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	29,300	26.58	778,794.00	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	23,000	45.23	1,040,290.00	
	NETFLIX INC	68,580	370.96	25,440,436.80	
	ROKU INC	14,200	89.61	1,272,462.00	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	18,100	118.51	2,145,031.00	
	ALPHABET INC-CL A	46,840	1,146.31	53,693,160.40	
	ALPHABET INC-CL C	48,330	1,146.82	55,425,810.60	
	FACEBOOK INC-A	376,100	165.95	62,413,795.00	
	IAC/INTERACTIVE CORP	12,600	180.01	2,268,126.00	
	MATCH GROUP INC	8,400	66.67	560,028.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	46,000	15.42	709,320.00	
	SNAP INC-A	117,000	11.85	1,386,450.00	
	TRIPADVISOR INC	14,600	17.87	260,902.00	
	TWITTER INC	114,700	25.59	2,935,173.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	20,200	37.06	748,612.00	
小計	銘柄数：608			3,471,191,602.49	
				(377,769,782,098)	
	組入時価比率：67.9%			70.8%	
カナダドル	CAMECO CORP	56,000	10.44	584,640.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	187,000	15.72	2,939,640.00	
	CENOVUS ENERGY INC	156,000	2.41	375,960.00	
	ENBRIDGE INC	317,800	39.95	12,696,110.00	
	HUSKY ENERGY INC	52,000	3.21	166,920.00	
	IMPERIAL OIL	37,500	14.86	557,250.00	
	INTER PIPELINE LTD	60,000	7.84	470,400.00	
	KEYERA CORP	34,000	11.72	398,480.00	
	OVINTIV INC	41,000	3.44	141,040.00	
	PARKLAND FUEL CORP	21,700	25.05	543,585.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	88,000	23.65	2,081,200.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	31,000	7.06	218,860.00	
	SUNCOR ENERGY INC	244,000	18.97	4,628,680.00	
	TC ENERGY CORP	147,000	58.27	8,565,690.00	
	METHANEX CORP	8,600	17.17	147,662.00	
	NUTRIEN LTD	90,000	45.94	4,134,600.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	24,700	39.54	976,638.00	



AGNICO EAGLE MINES LTD	37,700	56.63	2,134,951.00
BARRICK GOLD	277,000	27.29	7,559,330.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	99,000	6.99	692,010.00
FRANCO-NEVADA CORP	29,300	138.48	4,057,464.00
KINROSS GOLD CORP	198,000	5.76	1,140,480.00
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	44,100	43.28	1,908,648.00
LUNDIN MINING CORP	95,000	5.03	477,850.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	82,000	9.78	801,960.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	71,600	39.47	2,826,052.00
WEST FRASER TIMBER	8,400	26.71	224,364.00
BOMBARDIER B SHEARS	280,000	0.42	119,000.00
CAE INC	41,000	18.08	741,280.00
WSP GLOBAL INC	15,700	75.59	1,186,763.00
AIR CANADA	20,400	16.08	328,032.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	112,400	108.33	12,176,292.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	21,300	307.91	6,558,483.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	45,100	44.98	2,028,598.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	31,800	18.01	572,718.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	43,300	57.02	2,468,966.00
STARS GROUP INC/THE	38,000	25.75	978,500.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	8,600	85.87	738,482.00
DOLLARAMA INC	46,600	40.78	1,900,348.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	134,200	32.88	4,412,496.00
EMPIRE CO LTD A	26,000	27.35	711,100.00
LOBLAW COMPANIES	28,500	69.14	1,970,490.00
METRO INC	39,600	56.83	2,250,468.00
WESTON(GEORGE)LTD	12,300	98.91	1,216,593.00
SAPUTO INC	36,600	33.29	1,218,414.00
AURORA CANNABIS INC	200,000	1.29	258,000.00
BAUSCH HEALTH COS INC	51,000	21.60	1,101,600.00
CANOPY GROWTH CORP	33,000	20.53	677,490.00
CRONOS GROUP INC	25,000	9.02	225,500.00
BANK OF MONTREAL	99,000	67.81	6,713,190.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	189,300	54.81	10,375,533.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF	69,600	79.00	5,498,400.00

COMMERCE				
NATIONAL BANK OF CANADA	52,300	52.03	2,721,169.00	
ROYAL BANK OF CANADA	224,800	84.80	19,063,040.00	
TORONTO DOMINION BANK	284,100	58.46	16,608,486.00	
ONEX CORPORATION	13,200	51.00	673,200.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,140	409.57	1,695,619.80	
GREAT-WEST LIFE CO INC	42,000	23.50	987,000.00	
IA FINANCIAL CORP INC	18,300	42.63	780,129.00	
INTACT FINANCIAL CORP	21,500	115.52	2,483,680.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	303,000	17.00	5,151,000.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	86,950	21.49	1,868,555.50	
SUN LIFE FINANCIAL INC	92,300	44.20	4,079,660.00	
CGI INC	38,400	74.19	2,848,896.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	16,300	611.52	9,967,776.00	
BLACKBERRY LTD	71,000	5.54	393,340.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,200	1,275.90	4,082,880.00	
OPEN TEXT CORP	41,700	48.53	2,023,701.00	
BCE INC	22,700	55.15	1,251,905.00	
TELUS CORP	58,600	21.46	1,257,556.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	55,500	57.20	3,174,600.00	
EMERA INC	37,900	54.00	2,046,600.00	
FORTIS INC	68,200	52.49	3,579,818.00	
HYDRO ONE LTD	49,000	25.24	1,236,760.00	
ALTAGAS LTD	42,000	11.77	494,340.00	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	85,000	17.87	1,518,950.00	
ATCO LTD CL1	13,000	37.51	487,630.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	20,300	33.29	675,787.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	140,200	62.48	8,759,696.00	
CI FINANCIAL CORP	33,600	13.18	442,848.00	
IGM FINANCIAL INC	15,000	23.39	350,850.00	
THOMSON REUTERS CORP	31,700	94.25	2,987,725.00	
QUEBECOR INC-CL B	27,000	31.29	844,830.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	77,000	22.23	1,711,710.00	
小計銘柄数：84			234,126,937.30	
			(17,934,123,397)	

	組入時価比率：3.2%			3.4%
ユーロ	TENARIS SA	71,000	5.53	393,198.00
	ENI SPA	403,000	8.59	3,462,979.00
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	81,000	9.98	808,380.00
	NESTE OYJ	66,800	28.17	1,881,756.00
	OMV AG	21,000	25.13	527,730.00
	REPSOL SA	220,484	7.59	1,673,914.52
	TOTAL SA	376,200	33.57	12,629,034.00
	VOPAK	11,400	46.76	533,064.00
	AIR LIQUIDE SA	73,400	112.60	8,264,840.00
	AKZO NOBEL	32,400	61.80	2,002,320.00
	ARKEMA	9,900	60.26	596,574.00
	BASF SE	144,500	42.45	6,134,747.50
	COVESTRO AG	26,900	27.37	736,253.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	33,000	18.59	613,470.00
	FUCHS PETROLUB SE -PFD	10,500	32.00	336,000.00
	KONINKLIJKE DSM NV	28,500	103.80	2,958,300.00
	LANXESS	12,000	36.38	436,560.00
	SOLVAY SA	11,400	65.36	745,104.00
	SYMRISE AG	19,800	82.16	1,626,768.00
	UMICORE	31,000	30.71	952,010.00
	CRH PLC	125,300	23.36	2,927,008.00
	HEIDELBERGCEMENT AG	22,600	36.93	834,618.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	35,300	24.62	869,086.00
	ARCELORMITTAL	99,000	7.97	789,525.00
	THYSSENKRUPP AG	62,000	4.63	287,370.00
	VOESTALPINE AG	20,000	18.00	360,000.00
	STORA ENSO OYJ-R	85,000	8.79	747,320.00
	UPM-KYMMENE OYJ	83,200	23.34	1,941,888.00
	AIRBUS SE	91,800	60.93	5,593,374.00
	DASSAULT AVIATION SA	330	705.00	232,650.00
	LEONARDO SPA	64,000	5.96	381,696.00
	MTU AERO ENGINES AG	8,400	134.85	1,132,740.00
	SAFRAN SA	50,800	84.90	4,312,920.00
	THALES SA	16,300	73.00	1,189,900.00

COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	79,000	21.44	1,694,155.00
KINGSPAN GROUP PLC	24,500	46.00	1,127,000.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	40,394	16.29	658,018.26
BOUYGUES	34,800	27.53	958,044.00
EIFFAGE SA	12,100	66.00	798,600.00
FERROVIAL SA	77,000	21.44	1,650,880.00
HOCHTIEF AG	3,800	57.60	218,880.00
VINCI	81,000	73.00	5,913,000.00
LEGRAND SA	41,000	57.58	2,360,780.00
PRYSMIAN SPA	37,000	15.31	566,655.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	86,900	79.22	6,884,218.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	38,000	13.50	513,000.00
SIEMENS AG	120,100	75.26	9,038,726.00
ALSTOM	30,300	37.29	1,129,887.00
ANDRITZ AG	11,700	27.42	320,814.00
CNH INDUSTRIAL NV	154,000	5.13	790,636.00
GEA GROUP AG	24,200	18.27	442,255.00
KION GROUP AG	9,900	39.33	389,367.00
KNORR-BREMSE AG	7,100	76.30	541,730.00
KONE OYJ	54,000	50.60	2,732,400.00
METSO OYJ	16,200	20.62	334,044.00
WARTSILA OYJ	63,000	6.45	406,476.00
BRENTAG AG	23,800	32.49	773,262.00
DEUTSCHE POST AG-REG	153,400	24.56	3,767,504.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	42,000	8.68	364,644.00
ADP	4,700	88.60	416,420.00
AENA SME SA	10,700	100.30	1,073,210.00
ATLANTIA SPA	79,000	10.65	841,745.00
FRAPORT AG	6,300	36.91	232,533.00
GETLINK	72,000	10.70	770,400.00
CONTINENTAL AG	17,500	64.03	1,120,525.00
FAURECIA	10,500	26.79	281,295.00
MICHELIN (CGDE)	26,700	76.48	2,042,016.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	21,000	18.74	393,540.00
PIRELLI & C. SPA	53,000	3.34	177,073.00

VALEO SA	37,300	14.50	540,850.00
BAYER MOTOREN WERK	52,100	45.73	2,382,533.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	7,800	37.32	291,096.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	140,300	27.20	3,816,861.50
FERRARI NV	18,900	139.15	2,629,935.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	170,000	6.31	1,072,700.00
PEUGEOT CITROEN	88,000	11.77	1,035,760.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	22,700	37.56	852,612.00
RENAULT SA	28,100	17.20	483,544.80
VOLKSWAGEN AG	5,100	118.70	605,370.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	28,900	105.02	3,035,078.00
SEB SA	3,800	106.80	405,840.00
ADIDAS AG	28,100	206.80	5,811,080.00
ESSILORLUXOTTICA	43,900	99.42	4,364,538.00
HERMES INTERNATIONAL	5,010	639.80	3,205,398.00
KERING SA	11,790	481.50	5,676,885.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	43,540	350.00	15,239,000.00
MONCLER SPA	28,100	34.00	955,400.00
PUMA SE	12,600	54.15	682,290.00
ACCOR SA	26,200	24.96	653,952.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	12,100	73.70	891,770.00
SODEXO	13,200	59.48	785,136.00
DELIVERY HERO SE	17,900	66.70	1,193,930.00
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	17,500	68.20	1,193,500.00
PROSUS NV	76,800	62.48	4,798,464.00
ZALANDO SE	21,500	33.02	709,930.00
INDITEX SA	168,000	22.71	3,815,280.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	95,000	14.21	1,349,950.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	8,300	34.85	289,255.00
COLRUYT SA	8,700	49.10	427,170.00
JERONIMO MARTINS	38,000	16.00	608,000.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	170,600	21.48	3,665,341.00
METRO AG	25,000	7.15	178,950.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	120,100	38.90	4,672,490.50
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	91,000	6.65	605,150.00

HEINEKEN HOLDING NV	17,200	67.35	1,158,420.00
HEINEKEN NV	40,000	73.02	2,920,800.00
PERNOD RICARD SA	33,500	130.75	4,380,125.00
REMY COINTREAU	4,000	102.00	408,000.00
DANONE	97,200	57.12	5,552,064.00
KERRY GROUP PLC-A	24,400	102.80	2,508,320.00
HENKEL AG & CO KGAA	16,300	64.60	1,052,980.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	27,700	71.28	1,974,456.00
BEIERSDORF AG	16,000	93.62	1,497,920.00
LOREAL-ORD	39,400	246.30	9,704,220.00
UNILEVER NV	227,600	43.75	9,957,500.00
BIOMERIEUX	6,900	100.20	691,380.00
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	6,000	88.90	533,400.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	142,600	36.70	5,233,420.00
SARTORIUS AG-VORZUG	5,300	220.00	1,166,000.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,900	35.63	851,676.50
FRESENIUS MEDICAL CARE	33,300	58.58	1,950,714.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	64,200	33.88	2,175,417.00
GALAPAGOS NV	7,000	174.45	1,221,150.00
GRIFOLS SA	46,800	31.03	1,452,204.00
BAYER AG-REG	154,300	52.68	8,128,524.00
IPSEN	5,500	47.22	259,710.00
MERCK KGAA	19,900	89.50	1,781,050.00
ORION OYJ	16,500	36.56	603,240.00
RECORDATI SPA	16,800	39.13	657,384.00
SANOFI	176,700	80.51	14,226,117.00
UCB SA	19,500	75.52	1,472,640.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	70,000	7.34	513,800.00
AIB GROUP PLC	125,000	1.01	126,375.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,056,000	2.92	3,083,520.00
BANCO DE SABADELL SA	801,933	0.45	365,601.25
BANCO SANTANDER SA	2,614,000	2.21	5,788,703.00
BANK OF IRELAND GROUP PLC	133,000	1.79	238,469.00
BANKIA SA	151,000	1.04	157,795.00
BANKINTER S.A.	91,000	3.15	286,741.00

BNP PARIBAS	173,900	28.25	4,912,675.00	
CAIXABANK	530,000	1.67	885,895.00	
COMMERZBANK AG	158,000	3.33	527,404.00	
CREDIT AGRICOLE SA	184,000	6.69	1,232,432.00	
ERSTE GROUP BANK AG	48,000	17.07	819,360.00	
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	91,000	8.42	766,402.00	
ING GROEP NV	617,000	4.99	3,080,372.50	
INTESA SANPAOLO	2,330,000	1.47	3,426,964.00	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00	
KBC GROEP NV	38,200	40.37	1,542,134.00	
MEDIOBANCA S.P.A.	88,000	4.97	437,800.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	20,100	13.74	276,274.50	
SOCIETE GENERALE	127,000	15.43	1,960,372.00	
UNICREDIT SPA	313,000	7.27	2,276,762.00	
EURAZEO SE	5,953	41.12	244,787.36	
EXOR NV	17,200	46.73	803,756.00	
GROUPE BRUXELLES LAM	12,400	70.28	871,472.00	
WENDEL	4,300	73.70	316,910.00	
AEGON NV	293,000	2.33	684,448.00	
AGEAS	28,900	35.07	1,013,523.00	
ALLIANZ SE-REG	65,400	152.84	9,995,736.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	175,000	12.36	2,163,875.00	
AXA	301,000	15.34	4,619,146.00	
CNP ASSURANCES	28,000	8.72	244,160.00	
HANNOVER RUECK SE	9,600	128.90	1,237,440.00	
MAPFRE SA	163,000	1.55	254,198.50	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	22,800	181.40	4,135,920.00	
NN GROUP NV	47,000	24.43	1,148,210.00	
POSTE ITALIANE SPA	77,000	7.91	609,532.00	
SAMPO OYJ-A SHS	68,200	25.75	1,756,150.00	
SCOR SE	23,200	20.06	465,392.00	
ADYEN NV	1,650	783.80	1,293,270.00	
AMADEUS IT GROUP SA	66,700	43.63	2,910,121.00	
ATOS SE	15,300	60.02	918,306.00	
CAPGEMINI SA	24,500	78.00	1,911,000.00	

EDENRED	38,200	38.02	1,452,364.00
WIRECARD AG	18,000	99.94	1,798,920.00
WORLDLINE SA	19,800	54.05	1,070,190.00
DASSAULT SYSTEMES SA	20,900	132.90	2,777,610.00
SAP SE	153,900	102.18	15,725,502.00
NOKIA OYJ	880,000	2.73	2,409,000.00
INGENICO GROUP	9,500	95.04	902,880.00
ASML HOLDING NV	66,670	244.75	16,317,482.50
INFINEON TECHNOLOGIES AG	199,000	13.53	2,693,664.00
STMICROELECTRONICS NV	105,000	19.40	2,037,000.00
CELLNEX TELECOM SA	38,600	42.44	1,638,184.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	518,000	11.98	6,208,748.00
ELISA OYJ	22,100	55.08	1,217,268.00
ILIAD SA	2,400	127.15	305,160.00
KONINKLIJKE KPN NV	560,000	2.14	1,201,200.00
ORANGE SA	312,000	11.21	3,497,520.00
PROXIMUS	26,000	21.64	562,640.00
TELECOM ITALIA SPA	1,550,000	0.36	558,155.00
TELECOM ITALIA-RNC	880,000	0.35	315,744.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	150,000	2.19	329,250.00
TELEFONICA SA	732,000	4.13	3,029,016.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	26.12	438,816.00
ELECTRICITE DE FRANCE	94,000	6.95	653,864.00
ENDESA S.A.	50,000	19.39	969,500.00
ENEL SPA	1,263,000	6.38	8,065,518.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	387,000	3.54	1,371,528.00
FORTUM OYJ	72,000	13.11	943,920.00
IBERDROLA SA	966,000	8.71	8,413,860.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	70,000	16.92	1,184,750.00
TERNA SPA	222,000	5.77	1,281,828.00
VERBUND AG	11,000	32.48	357,280.00
ENAGAS SA	39,000	17.89	697,710.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	49,000	15.78	773,465.00
SNAM SPA	320,000	4.13	1,323,520.00
E.ON SE	355,000	9.54	3,389,185.00



	ENGIE	290,000	9.45	2,740,500.00	
	RWE AG	93,100	23.09	2,149,679.00	
	SUEZ	52,000	9.49	493,792.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	82,000	19.72	1,617,450.00	
	AMUNDI SA	10,000	52.95	529,500.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	314,000	5.82	1,828,736.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG	29,500	125.50	3,702,250.00	
	NATIXIS	158,000	3.11	492,802.00	
	UNIPER SE	31,100	22.93	713,123.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,700	423.00	719,100.00	
	QIAGEN NV	35,400	36.59	1,295,286.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,100	178.60	732,260.00	
	BUREAU VERITAS SA	47,000	17.00	799,000.00	
	RANDSTAD NV	18,400	31.08	571,872.00	
	TELEPERFORMANCE	9,000	179.80	1,618,200.00	
	WOLTERS KLUWER	41,800	62.36	2,606,648.00	
	AROUNDTOWN SA	185,000	4.31	798,275.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	56,200	34.25	1,924,850.00	
	VONOVIA SE	79,500	45.01	3,578,295.00	
	ALTICE EUROPE N.V.	99,000	3.43	340,164.00	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	24,100	9.06	218,490.60	
	JC DECAUX SA	15,000	15.67	235,050.00	
	PUBLICIS GROUPE	32,100	23.33	748,893.00	
	SES FDR	56,000	5.25	294,448.00	
	TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	28.50	190,950.00	
	BOLLORE	138,000	2.41	332,580.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	14,400	68.42	985,248.00	
	VIVENDI SA	130,000	18.18	2,363,400.00	
小計	銘柄数：237			483,916,987.79	
				(57,852,275,890)	
	組入時価比率：10.4%			10.8%	
英債券	BP PLC	3,178,000	3.23	10,284,008.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	656,000	13.25	8,693,312.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	586,000	12.62	7,395,320.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	19,300	42.08	812,144.00	

JOHNSON MATTHEY PLC	30,200	17.87	539,674.00
ANGLO AMERICAN PLC	160,000	13.37	2,140,480.00
ANTOFAGASTA PLC	59,000	7.31	431,762.00
BHP GROUP PLC	329,000	12.18	4,007,878.00
EVRAZ PLC	76,000	2.26	172,292.00
GLENCORE PLC	1,700,000	1.19	2,023,000.00
RIO TINTO PLC-REG	174,900	36.74	6,425,826.00
MONDI PLC	75,000	13.38	1,003,875.00
BAE SYSTEMS PLC	502,000	5.08	2,552,168.00
MEGGITT PLC	111,000	2.69	298,590.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	277,000	3.21	890,001.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	730,000	0.87	638,750.00
DCC PLC	16,000	51.80	828,800.00
SMITHS GROUP PLC	61,000	11.15	680,455.00
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	11,600	81.80	948,880.00
WEIR GROUP PLC	38,000	6.66	253,156.00
ASHTED GROUP PLC	68,700	16.33	1,121,871.00
BUNZLE	50,000	15.54	777,250.00
FERGUSON PLC	34,600	49.30	1,705,780.00
G4S PLC	219,000	0.87	191,493.60
RENTOKIL INTIAL PLC	285,000	3.86	1,100,100.00
EASYJET PLC	21,000	5.52	115,920.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	159,000	4.45	708,345.00
PERSIMMON PLC	48,000	18.24	875,760.00
TAYLOR WIMPEY PLC	500,000	1.17	586,500.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	19,500	36.00	702,000.00
BURBERRY GROUP PLC	66,000	13.10	864,600.00
CARNIVAL PLC	22,900	9.09	208,206.80
COMPASS GROUP PLC	251,000	11.90	2,988,155.00
GVC HOLDINGS PLC	87,000	5.00	435,000.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	25,800	33.94	875,652.00
TUI AG-DI	70,000	3.65	256,060.00
WHITBREAD PLC	21,100	29.68	626,248.00
OCADO GROUP PLC	72,000	12.36	889,920.00
MARKS & SPENCER PLC	310,000	0.98	306,776.00

NEXT PLC	19,800	39.64	784,872.00
JD SPORTS FASHION PLC	76,000	4.58	348,764.00
KINGFISHER PLC	308,000	1.42	439,054.00
MORRISON SUPERMARKETS	370,000	1.82	674,880.00
SAINSBURY	255,000	2.10	536,010.00
TESCO PLC	1,530,000	2.33	3,566,430.00
COCA-COLA HBC AG-DI	29,000	16.46	477,340.00
DIAGEO PLC	368,100	25.74	9,476,734.50
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	54,100	17.43	942,963.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	359,700	26.35	9,478,095.00
IMPERIAL BRANDS PLC	149,000	13.33	1,986,170.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	110,200	62.00	6,832,400.00
UNILEVER PLC	174,200	40.16	6,995,872.00
SMITH & NEPHEW PLC	137,000	14.39	1,972,115.00
NMC HEALTH PLC	13,300	2.34	31,201.80
ASTRAZENECA PLC	205,500	71.03	14,596,665.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	782,000	14.82	11,589,240.00
BARCLAYS PLC	2,740,000	0.94	2,575,600.00
HSBC HOLDINGS PLC	3,181,000	4.62	14,716,896.50
LLOYDS BANKING GROUP PLC	11,050,000	0.33	3,701,750.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	770,000	1.17	903,980.00
STANDARD CHARTERED PLC	414,000	4.55	1,885,770.00
M&G PLC	378,000	1.17	444,150.00
ADMIRAL GROUP PLC	30,800	22.01	677,908.00
AVIVA PLC	604,000	2.67	1,617,512.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	219,000	2.77	606,630.00
LEGAL & GENERAL	940,000	1.92	1,807,150.00
PRUDENTIAL PLC	410,000	10.02	4,110,250.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	162,000	4.18	677,808.00
AVEVA GROUP PLC	11,200	34.60	387,520.00
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	48,116	4.00	192,464.00
SAGE GROUP PLC (THE)	175,000	6.00	1,050,000.00
HALMA PLC	59,000	18.70	1,103,300.00
BT GROUP PLC	1,290,000	1.19	1,540,518.00
VODAFONE GROUP PLC	4,210,000	1.14	4,813,714.00

	SSE PLC	165,000	12.64	2,085,600.00	
	CENTRICA PLC	920,000	0.38	353,096.00	
	NATIONAL GRID PLC	548,000	9.54	5,228,468.00	
	SEVERN TRENT PLC	37,000	23.31	862,470.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	106,000	9.47	1,004,244.00	
	3I GROUP PLC	155,000	7.63	1,183,890.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	52,000	13.63	708,760.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	49,200	73.22	3,602,424.00	
	SCHRODERS PLC	19,700	25.20	496,440.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	81,000	7.54	610,902.00	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	366,000	2.22	815,448.00	
	EXPERIAN PLC	141,100	23.48	3,313,028.00	
	INTERTEK GROUP PLC	25,600	46.33	1,186,048.00	
	RELX PLC	300,000	17.27	5,181,000.00	
	INFORMA PLC	186,000	4.23	786,780.00	
	ITV PLC	500,000	0.62	311,900.00	
	PEARSON	126,000	5.60	706,608.00	
	WPP PLC	200,000	5.15	1,031,600.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	141,000	4.43	625,053.00	
小計	銘柄数：93			209,991,494.20	
				(27,996,066,006)	
	組入時価比率：5.0%			5.3%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	32,000	15.88	508,320.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,220	594.50	725,290.00	
	GIVAUDAN-REG	1,458	2,975.00	4,337,550.00	
	SIKA AG-REG	19,900	157.95	3,143,205.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	77,400	34.25	2,650,950.00	
	GEBERIT AG-REG	5,650	424.10	2,396,165.00	
	ABB LTD	285,000	16.64	4,742,400.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,000	196.60	589,800.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,100	207.70	1,266,970.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	8,400	131.95	1,108,380.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	81,500	52.10	4,246,150.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,700	188.65	886,655.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	37.06	274,244.00	
		6,500	29.93	194,545.00	

	DUFRY AG-REG				
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,949.00	896,540.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	161	7,585.00	1,221,185.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	17	81,800.00	1,390,600.00	
	NESTLE SA-REG	465,200	99.80	46,426,960.00	
	ALCON INC	65,900	48.73	3,211,636.50	
	SONOVA HOLDING AG-REG	8,800	172.50	1,518,000.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,600	706.80	1,130,880.00	
	NOVARTIS AG-REG	336,100	77.80	26,148,580.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	109,870	308.80	33,927,856.00	
	VIFOR PHARMA AG	6,700	127.35	853,245.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	5,800	63.90	370,620.00	
	BALOISE HOLDING AG	7,400	124.70	922,780.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	5,190	323.40	1,678,446.00	
	SWISS RE LTD	46,200	70.30	3,247,860.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	23,510	332.40	7,814,724.00	
	TEMENOS AG-REG	10,400	123.50	1,284,400.00	
	SWISSCOM AG-REG	4,030	536.00	2,160,080.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	396,000	7.99	3,167,208.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	35,800	33.01	1,181,758.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,990	665.80	1,990,742.00	
	UBS GROUP AG	601,000	9.06	5,447,464.00	
	LONZA AG-REG	11,540	393.80	4,544,452.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	24,900	36.78	915,822.00	
	SGS SA-REG	920	2,250.00	2,070,000.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	11,400	93.90	1,070,460.00	
小計	銘柄数：39			181,662,922.50	
				(20,566,059,456)	
	組入時価比率：3.7%			3.9%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	28,800	172.50	4,968,000.00	
	BOLIDEN AB	44,000	170.65	7,508,600.00	
	ASSA ABLOY AB-B	159,000	181.55	28,866,450.00	
	SKANSKA AB-B SHS	51,000	146.95	7,494,450.00	
	ALFA LAVAL AB	51,000	172.05	8,774,550.00	
	ATLAS COPCO AB-A	104,500	331.00	34,589,500.00	

	ATLAS COPCO AB-B	62,700	289.30	18,139,110.00	
	EPIROC AB - A	103,000	98.68	10,164,040.00	
	EPIROC AB - B	58,000	98.94	5,738,520.00	
	SANDVIK AB	178,000	140.60	25,026,800.00	
	SKF AB-B SHARES	58,000	132.45	7,682,100.00	
	VOLVO AB-B SHS	234,000	113.75	26,617,500.00	
	SECURITAS AB-B SHS	45,000	105.25	4,736,250.00	
	ELECTROLUX AB-B	34,000	121.35	4,125,900.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	55,000	49.07	2,698,850.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	127,000	122.26	15,527,020.00	
	ICA GRUPPEN AB	13,800	410.30	5,662,140.00	
	SWEDISH MATCH AB	26,000	536.60	13,951,600.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	92,500	304.90	28,203,250.00	
	NORDEA BANK ABP	515,000	54.45	28,041,750.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	251,000	66.08	16,586,080.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	243,000	79.72	19,371,960.00	
	SWEDBANK AB	137,000	107.90	14,782,300.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	192.70	4,817,500.00	
	INVESTOR AB-B SHS	71,500	448.30	32,053,450.00	
	KINNEVIK AB - B	39,000	161.85	6,312,150.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	12,600	401.40	5,057,640.00	
	ERICSSON LM-B	474,000	78.68	37,294,320.00	
	HEXAGON AB-B SHS	42,300	410.40	17,359,920.00	
	TELIA CO AB	430,000	35.50	15,265,000.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	15,800	278.00	4,392,400.00	
	TELE 2 AB-B SHS	78,000	132.40	10,327,200.00	
小計	銘柄数：32			472,136,300.00	
				(5,103,793,403)	
	組入時価比率：0.9%			1.0%	
ノルウェーク ローネ	AKER AB ASA	18,000	119.50	2,151,000.00	
	EQUINOR ASA	158,000	120.25	18,999,500.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	26,200	324.40	8,499,280.00	
	NORSK HYDRO	218,000	22.22	4,843,960.00	
	MOWI ASA	69,000	155.75	10,746,750.00	

	ORKLA ASA	115,000	92.08	10,589,200.00	
	DNB ASA	145,000	112.85	16,363,250.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,000	173.55	5,380,050.00	
	TELENOR ASA	116,000	152.15	17,649,400.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	185.60	2,394,240.00	
小計	銘柄数：10			97,616,630.00	
				(1,001,546,623)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	16,700	499.90	8,348,330.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	33,700	306.00	10,312,200.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	29,800	544.60	16,229,080.00	
	ISS A/S	21,800	90.54	1,973,772.00	
	DSV PANALPINA A S	32,500	609.40	19,805,500.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	640	5,420.00	3,468,800.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,040	5,818.00	6,050,720.00	
	PANDORA A/S	16,000	214.60	3,433,600.00	
	CARLSBERG B	16,200	753.00	12,198,600.00	
	COLOPLAST-B	18,500	961.80	17,793,300.00	
	DEMANT A/S	16,000	146.40	2,342,400.00	
	GENMAB A/S	10,000	1,350.50	13,505,000.00	
	H LUNDBECK A/S	10,500	192.90	2,025,450.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	277,200	404.85	112,224,420.00	
	DANSKE BANK AS	97,000	73.40	7,119,800.00	
	TRYG A/S	19,900	164.60	3,275,540.00	
	ORSTED A/S	30,000	675.00	20,250,000.00	
小計	銘柄数：17			260,356,512.00	
				(4,168,307,757)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	
豪ドル	WORLEY LTD	47,000	5.96	280,120.00	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	40,000	22.30	892,000.00	
	OIL SEARCH LTD	204,000	2.33	475,320.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	265,000	4.43	1,173,950.00	
	SANTOS LTD.	261,000	3.38	882,180.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	17.60	299,200.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	152,000	17.97	2,731,440.00	

INCITEC PIVOT LTD	233,000	1.96	456,680.00
ORICA LTD	59,000	16.31	962,290.00
BORAL LTD	200,000	2.02	404,000.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	67,000	18.74	1,255,580.00
ALUMINA LTD	350,000	1.57	549,500.00
BHP GROUP LIMITED	458,000	30.20	13,831,600.00
BLUESCOPE STEEL LTD	88,000	9.16	806,080.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	219,000	10.10	2,211,900.00
NEWCREST MINING	117,000	24.51	2,867,670.00
RIO TINTO LTD	57,500	87.54	5,033,550.00
SOUTH32 LTD	780,000	1.86	1,450,800.00
CIMIC GROUP LTD	18,000	22.85	411,300.00
BRAMBLES LTD	251,000	10.61	2,663,110.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	108,000	3.20	345,600.00
AURIZON HOLDINGS LTD	305,000	4.83	1,473,150.00
SYDNEY AIRPORT	168,000	5.95	999,600.00
TRANSURBAN GROUP	434,000	12.15	5,273,100.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	88,000	21.59	1,899,920.00
CROWN RESORTS LTD	55,000	7.20	396,000.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	7,300	9.91	72,343.00
TABCORP HOLDINGS	340,000	2.45	833,000.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	97,117	3.04	295,235.68
WESFARMERS LIMITED	175,000	35.89	6,280,750.00
COLES GROUP LTD	176,000	16.82	2,960,320.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	197,000	38.14	7,513,580.00
COCA-COLA AMATIL LTD	77,000	8.68	668,360.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	111,000	9.83	1,091,130.00
COCHLEAR LTD	8,900	182.81	1,627,009.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	25,000	58.33	1,458,250.00
SONIC HEALTHCARE LTD	69,000	24.48	1,689,120.00
CSL LIMITED	71,200	312.68	22,262,816.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	439,000	16.78	7,366,420.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	92,000	6.44	592,480.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	277,800	63.95	17,765,310.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	456,000	16.31	7,437,360.00



	WESTPAC BANKING CORP	563,000	16.16	9,098,080.00	
	AMP LIMITED	530,000	1.33	707,550.00	
	CHALLENGER LIMITED	80,000	4.02	321,600.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	361,000	6.40	2,310,400.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	450,000	2.82	1,269,000.00	
	QBE INSURANCE	195,000	8.60	1,677,000.00	
	SUNCORP GROUP LTD	190,316	9.10	1,731,875.60	
	COMPUTERSHARE LTD	76,000	9.71	737,960.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,000	15.85	332,850.00	
	TELSTRA CORP LTD	650,000	3.25	2,112,500.00	
	TPG TELECOM LTD	52,000	7.10	369,200.00	
	AUSNET SERVICES	330,000	1.73	572,550.00	
	APA GROUP	180,000	10.41	1,873,800.00	
	AGL ENERGY LTD	105,000	16.98	1,782,900.00	
	ASX LTD	30,700	77.50	2,379,250.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	53,000	85.65	4,539,450.00	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	19,200	42.22	810,624.00	
	SEEK LTD	48,000	14.94	717,120.00	
	REA GROUP LTD	8,800	81.20	714,560.00	
	小計 銘柄数：61			163,997,393.28	
				(10,838,587,721)	
	組入時価比率：1.9%			2.0%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	150,000	3.20	480,000.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	152,000	5.24	796,480.00	
	A2 MILK CO LTD	117,000	16.92	1,979,640.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	86,000	30.35	2,610,100.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	58,000	10.23	593,340.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	307,000	4.08	1,252,560.00	
	MERCURY NZ LTD	100,000	4.24	424,000.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	201,000	4.03	810,030.00	
	小計 銘柄数：8			8,946,150.00	
				(579,352,674)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	425,040	51.45	21,868,308.00	

NWS HOLDINGS LTD	220,500	7.55	1,664,775.00
TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	212,000	48.90	10,366,800.00
MTR CORP	243,000	39.50	9,598,500.00
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	97,000	11.74	1,138,780.00
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	335,000	40.60	13,601,000.00
SANDS CHINA LTD	384,000	28.00	10,752,000.00
SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	6.45	1,741,500.00
WYNN MACAU LTD	228,000	11.88	2,708,640.00
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	216,000	19.98	4,315,680.00
VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	130,000	23.20	3,016,000.00
WH GROUP LIMITED	1,460,000	7.04	10,278,400.00
BANK OF EAST ASIA	220,060	16.24	3,573,774.40
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	569,000	21.10	12,005,900.00
HANG SENG BANK	119,000	131.00	15,589,000.00
AIA GROUP LTD	1,893,000	68.15	129,007,950.00
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	48,000	68.50	3,288,000.00
HKT TRUST AND HKT LTD	599,600	10.44	6,259,824.00
PCCW LTD	750,000	4.18	3,135,000.00
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	107,000	39.65	4,242,550.00
CLP HLDGS	253,000	70.20	17,760,600.00
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	225,000	45.60	10,260,000.00
HONG KONG & CHINA GAS	1,560,348	12.12	18,911,417.76
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	188,700	232.00	43,778,400.00
CK ASSET HOLDINGS LTD	409,040	40.70	16,647,928.00
HANG LUNG PROPERTIES LTD	310,000	14.80	4,588,000.00
HENDERSON LAND	229,443	28.80	6,607,958.40
KERRY PROPERTIES	114,000	19.16	2,184,240.00
NEW WORLD DEVELOPMENT	939,666	8.15	7,658,277.90
SINO LAND CO.LTD	480,000	9.16	4,396,800.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	248,000	99.00	24,552,000.00
SWIRE PACIFIC-A	75,000	48.65	3,648,750.00
SWIRE PROPERTIES LTD	173,000	20.85	3,607,050.00
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	183,000	30.45	5,572,350.00

	WHEELLOCK & COMPANY LTD	134,000	51.75	6,934,500.00	
小計	銘柄数：35			445,260,653.46	
				(6,251,459,574)	
	組入時価比率：1.1%			1.2%	
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	249,000	2.97	739,530.00	
	KEPPEL CORP.	232,000	5.24	1,215,680.00	
	SEBACORP INDUSTRIES	140,040	1.57	219,862.80	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	440,000	0.83	365,200.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,040	5.80	446,832.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	310,000	1.48	458,800.00	
	SATS LTD	115,000	3.20	368,000.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	870,000	0.64	556,800.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	14,000	18.97	265,580.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	289,000	3.07	887,230.00	
	DBS GROUP HLDGS	284,000	18.30	5,197,200.00	
	OCBC-ORD	524,000	8.52	4,464,480.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	200,000	19.21	3,842,000.00	
	VENTURE CORP LTD	45,000	13.20	594,000.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,290,000	2.42	3,121,800.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	129,000	8.92	1,150,680.00	
	CAPITALAND LIMITED	380,000	2.76	1,048,800.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	7.00	490,000.00	
	UOL GROUP LIMITED	65,000	6.41	416,650.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	240,000	1.77	424,800.00	
小計	銘柄数：20			26,273,924.80	
				(2,006,539,636)	
	組入時価比率：0.4%			0.4%	
新シケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	125,000	10.95	1,368,750.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,600	456.00	1,641,600.00	
	BANK HAPOLIM BM	183,000	20.80	3,806,400.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	238,000	19.00	4,522,000.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	172,000	10.19	1,752,680.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	23,000	65.20	1,499,600.00	
	NICE LTD	9,500	541.80	5,147,100.00	

	AZRIELI GROUP	6,500	200.00	1,300,000.00	
小計	銘柄数：8			21,038,130.00	
				(640,821,439)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計				532,708,715,674	
				(532,708,715,674)	

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

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

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

(2)株式以外の有価証券(2020年3月31日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	80,000	934,400.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,900	2,589,235.00	
		AMERICAN TOWER CORP	69,400	16,002,252.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	214,000	1,213,380.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,900	3,330,990.00	
		BOSTON PROPERTIES	24,700	2,296,112.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	14,500	1,208,430.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	64,500	9,549,870.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	40,700	5,690,267.00	
		DUKE REALTY CORP	56,600	1,870,630.00	
		EQUINIX INC	13,250	8,544,527.50	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,500	1,499,900.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	57,700	3,610,866.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,070	2,270,885.70	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	20,700	2,002,725.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,100	832,500.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	75,700	1,843,295.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	109,000	1,244,780.00	
		INVITATION HOMES INC	85,000	1,801,150.00	
		IRON MOUNTAIN INC	43,100	1,071,035.00	
KIMCO REALTY CORP	65,000	656,500.00			
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	83,000	1,459,970.00			

	MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,600	1,885,488.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	27,900	919,026.00	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	32,200	856,198.00	
	PROLOGIS INC	114,500	9,489,760.00	
	PUBLIC STORAGE	24,500	4,939,935.00	
	REALTY INCOME CORP	49,900	2,651,187.00	
	REGENCY CENTERS CORP	26,200	1,046,690.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	17,770	4,951,788.20	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	47,900	2,695,333.00	
	SL GREEN REALTY CORP	12,500	576,000.00	
	SUN COMMUNITIES INC	14,300	1,749,176.00	
	UDR INC	46,300	1,746,436.00	
	VENTAS INC	56,800	1,635,272.00	
	VEREIT INC	160,000	796,800.00	
	VICI PROPERTIES INC	68,000	1,090,720.00	
	VORNADO REALTY TRUST	27,000	1,015,200.00	
	WELLTOWER INC	63,100	2,977,058.00	
	WEYERHAEUSER CO	115,000	1,949,250.00	
	WP CAREY INC	27,400	1,625,094.00	
小計	銘柄数：41	2,153,190	116,120,111.40 (12,637,351,723)	
	組入時価比率：2.3%		85.8%	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,500	481,850.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	16,000	216,320.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	20,000	171,200.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	357,060.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,000	204,270.00	
小計	銘柄数：5	80,500	1,430,700.00 (109,591,620)	
	組入時価比率：0.0%		0.7%	
ユーロ	COVIVIO	6,600	346,170.00	
	GECINA SA	7,100	864,070.00	
	ICADE	5,200	378,560.00	
	KLEPIERRE	32,300	590,444.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21,400	1,049,884.00	

小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.1%	72,600	3,229,128.00 (386,042,252) 2.6%
英ポンド	BRITISH LAND	128,000	416,256.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	111,000	607,170.00
	SEGRO PLC	176,000	1,319,648.00
小計	銘柄数：3 組入時価比率：0.1%	415,000	2,343,074.00 (312,378,625) 2.1%
豪ドル	DEXUS	171,000	1,539,000.00
	GOODMAN GROUP	254,000	3,030,220.00
	GPT GROUP	285,000	1,014,600.00
	LENLEASE GROUP	88,000	902,880.00
	MIRVAC GROUP	660,000	1,320,000.00
	SCENTRE GROUP	870,000	1,283,250.00
	STOCKLAND TRUST GROUP	348,000	803,880.00
	VICINITY CENTRES	470,000	458,250.00
小計	銘柄数：8 組入時価比率：0.1%	3,146,000	10,352,080.00 (684,168,967) 4.6%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	370,000	2,797,200.00
	LINK REIT	330,000	21,285,000.00
小計	銘柄数：2 組入時価比率：0.1%	700,000	24,082,200.00 (338,114,088) 2.3%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	440,800	1,194,568.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	439,972	655,558.28
	CAPITALAND MALL TRUST	390,000	682,500.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	673,400.00
	SUNTEC REIT	300,000	372,000.00
小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.0%	1,940,772	3,578,026.28 (273,253,867) 1.9%
合計			14,740,901,142 (14,740,901,142)

(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	2020年 3月31日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	7,572,209,065	-	8,112,137,886	539,928,821
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	5,943,177,212	-	5,961,966,500	18,789,288
米ドル	4,380,304,535	-	4,399,592,600	19,288,065
カナダドル	217,123,896	-	215,217,900	1,905,996
ユーロ	358,272,000	-	358,620,000	348,000
英ポンド	312,823,087	-	313,278,500	455,413
スイスフラン	276,482,586	-	277,340,000	857,414
スウェーデンクローナ	75,267,455	-	74,304,000	963,455
ノルウェークローネ	7,165,928	-	7,175,000	9,072
デンマーククローネ	56,008,734	-	55,840,000	168,734
豪ドル	53,009,600	-	52,864,000	145,600
ニュージーランドドル	16,250,250	-	16,187,500	62,750
香港ドル	108,668,911	-	109,153,400	484,489
シンガポールドル	57,666,710	-	58,033,600	366,890
新シェケル	24,133,520	-	24,360,000	226,480
合計	-	-	-	558,718,109

(注) 時価の算定方法

### 1 先物取引

外国先物取引について

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

### 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

(2020年 3月31日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	7,695,058,202
国債証券	527,323,313,010
地方債証券	47,906,508,421
特殊債券	61,781,836,848
社債券	29,411,446,150
未収入金	12,514,048,999
未収利息	817,244,426
前払費用	6,327,590
流動資産合計	687,455,783,646
資産合計	687,455,783,646
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	7,740,867,000
未払解約金	399,135,634
未払利息	14,085
流動負債合計	8,140,016,719
負債合計	8,140,016,719
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	509,213,794,132
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	170,101,972,795
元本等合計	679,315,766,927
純資産合計	679,315,766,927
負債純資産合計	687,455,783,646

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券
--------------------	---------------------



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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 3月31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	1,334円
(10,000口当たり純資産額)	(13,340円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月 2日 至 2020年 3月31日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>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

2020年 3月31日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	

国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 3月31日現在	
期首	2019年 4月 2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	497,182,935,056円
同期中における追加設定元本額	104,012,520,565円
同期中における一部解約元本額	91,981,661,489円
期末元本額	509,213,794,132円
期末元本額の内訳*	
野村国内債券インデックスファンド	483,914,892円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	38,983,510,336円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	17,109,516,699円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	2,641,260,585円
野村資産設計ファンド2015	351,022,361円
野村資産設計ファンド2020	342,514,527円
野村資産設計ファンド2025	292,756,304円
野村資産設計ファンド2030	215,710,763円
野村資産設計ファンド2035	107,919,451円
野村資産設計ファンド2040	160,211,143円
野村日本債券インデックスファンド	920,892,277円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	160,368,494,897円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	12,073,809,147円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	8,016,505,398円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	984,807,033円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）	10,839,315,827円
野村資産設計ファンド2045	15,534,158円
野村円債投資インデックスファンド	1,067,284,562円
野村インデックスファンド・国内債券	3,189,347,716円
マイ・ロード	33,364,570,440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	1,152,930,294円
野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）	22,635,963円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）	14,765,789,010円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	2,345,607,364円
野村資産設計ファンド2050	19,585,137円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	18,148,063円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	4,757,299円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	2,943,697円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,749,663円
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）	690,892,970円
のむらっぴ・ファンド（やや積極型）	168,910,140円

インデックス・ブレンド(タイプ )	56,141,374円
インデックス・ブレンド(タイプ )	27,832,844円
インデックス・ブレンド(タイプ )	66,880,676円
インデックス・ブレンド(タイプ )	11,936,780円
インデックス・ブレンド(タイプ )	14,287,203円
野村6資産均等バランス	1,345,129,386円
世界6資産分散ファンド	141,175,357円
野村資産設計ファンド2060	5,077,280円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合運動型上場投信	1,113,405,148円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	15,640,314,512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)	618,769,343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)	150,823,989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)	1,971,676,109円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	1,317,431,245円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	20,427,034円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	10,046,866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)	606,747円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,709,032,787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)	13,745,368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)	102,613,494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)	78,395,499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)	344,856,597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)	321,390,019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)	774,106,571円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	184,357,532円
ノムラ日本債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	337,923,755円
ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券(適格機関投資家専用)	1,379,648,760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)	892,201円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	32,293,764,018円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	37,673,758,573円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	12,797,630,121円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合(確定拠出年金向け)	49,136,459,591円
マイバランスDC30	11,184,287,010円
マイバランスDC50	7,643,341,922円
マイバランスDC70	2,288,811,292円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合	12,585,594,468円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	562,524,876円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,290,038,313円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	535,562,692円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	89,384,761円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	16,084,069円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	13,892,346円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	15,983,446円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	5,496,354円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	2,758,830円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	342,408,379円

マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	158,395,639円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	44,874,790円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	50,283,682円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	686,368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(2020年3月31日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2020年3月31日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付(2年)第402回	1,400,000,000	1,404,200,000	
		国庫債券 利付(2年)第403回	1,500,000,000	1,504,710,000	
		国庫債券 利付(2年)第406回	4,000,000,000	4,014,920,000	
		国庫債券 利付(5年)第129回	7,000,000,000	7,024,220,000	
		国庫債券 利付(5年)第130回	7,500,000,000	7,530,375,000	
		国庫債券 利付(5年)第131回	4,800,000,000	4,822,704,000	
		国庫債券 利付(5年)第132回	3,000,000,000	3,016,350,000	
		国庫債券 利付(5年)第133回	6,200,000,000	6,238,440,000	
		国庫債券 利付(5年)第134回	3,000,000,000	3,020,460,000	
		国庫債券 利付(5年)第135回	3,500,000,000	3,526,075,000	
		国庫債券 利付(5年)第136回	3,300,000,000	3,325,608,000	
		国庫債券 利付(5年)第137回	4,000,000,000	4,032,080,000	
		国庫債券 利付(5年)第138回	5,900,000,000	5,948,498,000	
		国庫債券 利付(5年)第139回	4,400,000,000	4,438,544,000	
		国庫債券 利付(5年)第140回	3,400,000,000	3,431,688,000	
		国庫債券 利付(5年)第141回	4,000,000,000	4,039,520,000	
		国庫債券 利付(40年)第1回	2,360,000,000	3,596,994,000	
		国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,337,904,000	
		国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,351,584,000	
		国庫債券 利付(40年)第4回	1,130,000,000	1,714,063,100	
		国庫債券 利付(40年)第5回	1,200,000,000	1,766,712,000	
		国庫債券 利付(40年)第6回	1,300,000,000	1,889,979,000	
		国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,964,816,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	1,500,000,000	1,972,245,000			
国庫債券 利付(40年)第9回	2,350,000,000	2,328,027,500			
国庫債券 利付(40年)第10回	2,100,000,000	2,434,215,000			

国庫債券 利付(40年)第11回	1,900,000,000	2,143,428,000	
国庫債券 利付(40年)第12回	1,600,000,000	1,637,376,000	
国庫債券 利付(10年)第317回	1,800,000,000	1,832,634,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	3,200,000,000	3,253,280,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,889,238,500	
国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,568,180,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,271,616,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,448,984,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	1,700,000,000	1,739,355,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	3,200,000,000	3,266,944,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	4,400,000,000	4,503,092,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,148,153,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,100,000,000	3,179,577,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,000,000,000	5,110,200,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	5,300,000,000	5,459,318,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	3,923,196,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,948,355,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	5,400,000,000	5,545,260,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	4,200,000,000	4,320,498,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	6,600,000,000	6,802,950,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	5,200,000,000	5,347,316,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	1,700,000,000	1,750,864,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	3,700,000,000	3,774,666,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	3,700,000,000	3,797,088,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	3,000,000,000	3,083,550,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	4,200,000,000	4,322,640,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	6,000,000,000	6,148,680,000	

国庫債券 利付(10年)第342回	2,750,000,000	2,787,180,000
国庫債券 利付(10年)第343回	5,400,000,000	5,476,140,000
国庫債券 利付(10年)第344回	5,800,000,000	5,887,058,000
国庫債券 利付(10年)第345回	5,000,000,000	5,079,650,000
国庫債券 利付(10年)第346回	4,900,000,000	4,982,712,000
国庫債券 利付(10年)第347回	3,400,000,000	3,460,758,000
国庫債券 利付(10年)第348回	4,600,000,000	4,683,352,000
国庫債券 利付(10年)第349回	4,000,000,000	4,070,160,000
国庫債券 利付(10年)第350回	5,850,000,000	5,946,349,500
国庫債券 利付(10年)第351回	5,600,000,000	5,688,088,000
国庫債券 利付(10年)第352回	4,800,000,000	4,871,568,000
国庫債券 利付(10年)第353回	5,100,000,000	5,171,502,000
国庫債券 利付(10年)第354回	4,350,000,000	4,404,766,500
国庫債券 利付(10年)第355回	5,100,000,000	5,158,905,000
国庫債券 利付(10年)第356回	4,400,000,000	4,443,736,000
国庫債券 利付(10年)第357回	1,200,000,000	1,210,476,000
国庫債券 利付(30年)第1回	500,000,000	632,295,000
国庫債券 利付(30年)第2回	200,000,000	246,984,000
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	196,595,200
国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,169,568,000
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	184,890,000
国庫債券 利付(30年)第6回	700,000,000	883,183,000
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	754,632,000
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	120,250,000
国庫債券 利付(30年)第9回	265,000,000	305,393,950
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	278,790,000
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	191,153,600
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	275,011,000
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	359,466,600
国庫債券 利付(30年)第14回	800,000,000	1,037,728,000
国庫債券 利付(30年)第15回	900,000,000	1,182,924,000
国庫債券 利付(30年)第16回	915,000,000	1,206,729,450
国庫債券 利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,570,764,000

国庫債券	利付(30年)第18回	1,500,000,000	1,947,840,000
国庫債券	利付(30年)第19回	1,600,000,000	2,083,936,000
国庫債券	利付(30年)第20回	1,400,000,000	1,870,582,000
国庫債券	利付(30年)第21回	1,400,000,000	1,834,112,000
国庫債券	利付(30年)第22回	600,000,000	807,276,000
国庫債券	利付(30年)第23回	840,000,000	1,134,596,400
国庫債券	利付(30年)第24回	700,000,000	948,409,000
国庫債券	利付(30年)第25回	500,000,000	663,440,000
国庫債券	利付(30年)第26回	850,000,000	1,145,587,500
国庫債券	利付(30年)第27回	1,550,000,000	2,128,460,000
国庫債券	利付(30年)第28回	1,200,000,000	1,659,972,000
国庫債券	利付(30年)第29回	1,500,000,000	2,062,110,000
国庫債券	利付(30年)第30回	1,700,000,000	2,320,568,000
国庫債券	利付(30年)第31回	1,600,000,000	2,171,232,000
国庫債券	利付(30年)第32回	1,900,000,000	2,628,232,000
国庫債券	利付(30年)第33回	2,400,000,000	3,196,128,000
国庫債券	利付(30年)第34回	2,100,000,000	2,895,627,000
国庫債券	利付(30年)第35回	2,300,000,000	3,091,821,000
国庫債券	利付(30年)第36回	2,300,000,000	3,105,805,000
国庫債券	利付(30年)第37回	2,300,000,000	3,071,466,000
国庫債券	利付(30年)第38回	1,600,000,000	2,111,136,000
国庫債券	利付(30年)第39回	1,600,000,000	2,151,024,000
国庫債券	利付(30年)第40回	1,100,000,000	1,457,005,000
国庫債券	利付(30年)第41回	1,500,000,000	1,956,360,000
国庫債券	利付(30年)第42回	1,600,000,000	2,089,168,000
国庫債券	利付(30年)第43回	1,300,000,000	1,701,323,000
国庫債券	利付(30年)第44回	1,400,000,000	1,834,280,000
国庫債券	利付(30年)第45回	1,700,000,000	2,152,132,000
国庫債券	利付(30年)第46回	1,800,000,000	2,280,510,000
国庫債券	利付(30年)第47回	1,700,000,000	2,197,522,000
国庫債券	利付(30年)第48回	1,900,000,000	2,366,545,000
国庫債券	利付(30年)第49回	1,900,000,000	2,367,951,000
国庫債券	利付(30年)第50回	1,600,000,000	1,758,816,000
国庫債券	利付(30年)第51回	2,900,000,000	2,827,819,000
国庫債券	利付(30年)第52回	1,900,000,000	1,945,467,000
国庫債券	利付(30年)第53回	1,700,000,000	1,782,076,000
国庫債券	利付(30年)第54回	1,700,000,000	1,867,790,000
国庫債券	利付(30年)第55回	1,500,000,000	1,649,295,000
国庫債券	利付(30年)第56回	1,900,000,000	2,090,684,000
国庫債券	利付(30年)第57回	1,600,000,000	1,761,888,000
国庫債券	利付(30年)第58回	2,100,000,000	2,311,281,000
国庫債券	利付(30年)第59回	1,600,000,000	1,719,520,000
国庫債券	利付(30年)第60回	1,050,000,000	1,184,190,000

国庫債券	利付（30年）第61回	1,000,000,000	1,074,510,000
国庫債券	利付（30年）第62回	1,300,000,000	1,328,561,000
国庫債券	利付（30年）第63回	1,400,000,000	1,392,706,000
国庫債券	利付（30年）第64回	1,500,000,000	1,492,125,000
国庫債券	利付（30年）第65回	600,000,000	596,826,000
国庫債券	利付（20年）第51回	310,000,000	318,100,300
国庫債券	利付（20年）第52回	100,000,000	103,300,000
国庫債券	利付（20年）第53回	250,000,000	259,612,500
国庫債券	利付（20年）第54回	100,000,000	104,017,000
国庫債券	利付（20年）第55回	231,000,000	240,715,860
国庫債券	利付（20年）第56回	120,000,000	125,702,400
国庫債券	利付（20年）第57回	210,000,000	219,510,900
国庫債券	利付（20年）第58回	180,000,000	189,104,400
国庫債券	利付（20年）第59回	230,000,000	241,555,200
国庫債券	利付（20年）第60回	780,000,000	812,799,000
国庫債券	利付（20年）第61回	300,000,000	310,188,000
国庫債券	利付（20年）第62回	440,000,000	453,226,400
国庫債券	利付（20年）第63回	300,000,000	318,717,000
国庫債券	利付（20年）第64回	400,000,000	428,236,000
国庫債券	利付（20年）第65回	455,000,000	489,256,950
国庫債券	利付（20年）第66回	300,000,000	321,465,000
国庫債券	利付（20年）第67回	310,000,000	334,893,000
国庫債券	利付（20年）第68回	290,000,000	316,752,500
国庫債券	利付（20年）第69回	560,000,000	609,431,200
国庫債券	利付（20年）第70回	540,000,000	597,704,400
国庫債券	利付（20年）第71回	200,000,000	219,676,000
国庫債券	利付（20年）第72回	670,000,000	737,026,800
国庫債券	利付（20年）第73回	1,600,000,000	1,760,608,000
国庫債券	利付（20年）第74回	900,000,000	994,617,000
国庫債券	利付（20年）第75回	600,000,000	666,558,000
国庫債券	利付（20年）第76回	910,000,000	1,001,846,300
国庫債券	利付（20年）第77回	700,000,000	774,151,000
国庫債券	利付（20年）第78回	800,000,000	885,104,000
国庫債券	利付（20年）第79回	860,000,000	956,001,800
国庫債券	利付（20年）第80回	900,000,000	1,005,192,000
国庫債券	利付（20年）第81回	360,000,000	402,141,600
国庫債券	利付（20年）第82回	820,000,000	920,507,400
国庫債券	利付（20年）第83回	1,370,000,000	1,545,620,300
国庫債券	利付（20年）第84回	1,200,000,000	1,346,916,000
国庫債券	利付（20年）第85回	400,000,000	453,368,000
国庫債券	利付（20年）第86回	1,400,000,000	1,603,616,000
国庫債券	利付（20年）第87回	500,000,000	569,715,000



国庫債券	利付(20年)第88回	1,100,000,000	1,266,793,000
国庫債券	利付(20年)第89回	470,000,000	538,319,200
国庫債券	利付(20年)第90回	1,500,000,000	1,727,520,000
国庫債券	利付(20年)第91回	250,000,000	289,550,000
国庫債券	利付(20年)第92回	1,550,000,000	1,784,329,000
国庫債券	利付(20年)第93回	300,000,000	344,925,000
国庫債券	利付(20年)第94回	200,000,000	231,356,000
国庫債券	利付(20年)第95回	700,000,000	824,257,000
国庫債券	利付(20年)第96回	400,000,000	465,172,000
国庫債券	利付(20年)第97回	600,000,000	705,468,000
国庫債券	利付(20年)第98回	300,000,000	350,472,000
国庫債券	利付(20年)第99回	2,100,000,000	2,463,279,000
国庫債券	利付(20年)第100回	1,520,000,000	1,800,759,200
国庫債券	利付(20年)第101回	250,000,000	300,192,500
国庫債券	利付(20年)第102回	500,000,000	602,840,000
国庫債券	利付(20年)第103回	600,000,000	718,440,000
国庫債券	利付(20年)第104回	400,000,000	472,340,000
国庫債券	利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,251,348,000
国庫債券	利付(20年)第106回	400,000,000	477,376,000
国庫債券	利付(20年)第107回	300,000,000	356,649,000
国庫債券	利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,874,080,000
国庫債券	利付(20年)第109回	900,000,000	1,056,654,000
国庫債券	利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,311,255,000
国庫債券	利付(20年)第111回	800,000,000	964,480,000
国庫債券	利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,153,448,000
国庫債券	利付(20年)第113回	2,000,000,000	2,398,920,000
国庫債券	利付(20年)第114回	1,700,000,000	2,045,032,000
国庫債券	利付(20年)第115回	1,000,000,000	1,212,670,000
国庫債券	利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,337,864,000
国庫債券	利付(20年)第117回	1,400,000,000	1,688,820,000
国庫債券	利付(20年)第118回	500,000,000	599,740,000

国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	943,296,000
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	927,016,000
国庫債券 利付(20年)第121回	1,700,000,000	2,026,536,000
国庫債券 利付(20年)第122回	1,100,000,000	1,299,837,000
国庫債券 利付(20年)第123回	1,500,000,000	1,824,000,000
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,205,360,000
国庫債券 利付(20年)第125回	900,000,000	1,106,829,000
国庫債券 利付(20年)第126回	1,000,000,000	1,208,080,000
国庫債券 利付(20年)第127回	1,200,000,000	1,436,652,000
国庫債券 利付(20年)第128回	1,800,000,000	2,160,666,000
国庫債券 利付(20年)第129回	800,000,000	951,408,000
国庫債券 利付(20年)第130回	1,400,000,000	1,668,016,000
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	944,088,000
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,536,509,000
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,670,872,000
国庫債券 利付(20年)第134回	1,400,000,000	1,673,532,000
国庫債券 利付(20年)第135回	700,000,000	828,527,000
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	820,288,000
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,185,980,000
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	929,584,000
国庫債券 利付(20年)第139回	1,000,000,000	1,173,980,000
国庫債券 利付(20年)第140回	2,300,000,000	2,733,067,000
国庫債券 利付(20年)第141回	2,600,000,000	3,095,300,000
国庫債券 利付(20年)第142回	950,000,000	1,142,802,500
国庫債券 利付(20年)第143回	1,300,000,000	1,532,934,000
国庫債券 利付(20年)第144回	1,300,000,000	1,516,476,000
	2,300,000,000	2,747,833,000

国庫債券 利付(20年)第145回			
国庫債券 利付(20年)第146回	2,400,000,000	2,872,224,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	4,200,000,000	4,978,554,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	2,100,000,000	2,464,224,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	2,350,000,000	2,760,921,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	3,330,000,000	3,870,225,900	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,500,000,000	2,839,200,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	1,700,000,000	1,932,985,000	
国庫債券 利付(20年)第153回	2,450,000,000	2,825,070,500	
国庫債券 利付(20年)第154回	2,900,000,000	3,305,420,000	
国庫債券 利付(20年)第155回	2,600,000,000	2,888,392,000	
国庫債券 利付(20年)第156回	2,350,000,000	2,393,099,000	
国庫債券 利付(20年)第157回	2,490,000,000	2,457,181,800	
国庫債券 利付(20年)第158回	2,100,000,000	2,171,022,000	
国庫債券 利付(20年)第159回	2,700,000,000	2,833,461,000	
国庫債券 利付(20年)第160回	2,300,000,000	2,452,490,000	
国庫債券 利付(20年)第161回	2,100,000,000	2,204,937,000	
国庫債券 利付(20年)第162回	1,700,000,000	1,786,139,000	
国庫債券 利付(20年)第163回	2,900,000,000	3,046,363,000	
国庫債券 利付(20年)第164回	2,600,000,000	2,688,634,000	
国庫債券 利付(20年)第165回	2,200,000,000	2,274,030,000	
国庫債券 利付(20年)第166回	2,300,000,000	2,458,861,000	
国庫債券 利付(20年)第167回	2,600,000,000	2,685,020,000	
国庫債券 利付(20年)第168回	3,300,000,000	3,350,193,000	
国庫債券 利付(20年)第169回	2,530,000,000	2,525,395,400	
国庫債券 利付(20年)第170回	2,000,000,000	1,996,320,000	
	1,300,000,000	1,297,582,000	

		国庫債券 利付(20年)第171回			
		メキシコ合衆国 第22回円貨社債(2016)	300,000,000	299,886,000	
		メキシコ合衆国 第25回円貨社債(2018)	100,000,000	98,874,000	
	小計	銘柄数:257 組入時価比率:77.6%	479,026,000,000	527,323,313,010 79.1%	
	合計			527,323,313,010	
地方債証券	日本円	東京都 公募第703回	100,000,000	101,592,000	
		東京都 公募第707回	100,000,000	101,578,000	
		東京都 公募第708回	100,000,000	101,829,000	
		東京都 公募第710回	100,000,000	101,652,000	
		東京都 公募第712回	100,000,000	101,741,000	
		東京都 公募第715回	100,000,000	101,888,000	
		東京都 公募第716回	200,000,000	203,830,000	
		東京都 公募第731回	100,000,000	102,276,000	
		東京都 公募第736回	100,000,000	101,985,000	
		東京都 公募第745回	300,000,000	306,747,000	
		東京都 公募第760回	100,000,000	99,518,000	
		東京都 公募第761回	100,000,000	99,710,000	
		東京都 公募第769回	500,000,000	502,140,000	
		東京都 公募第778回	100,000,000	100,118,000	
		東京都 公募(30年)第7回	100,000,000	137,623,000	
		東京都 公募第10回	200,000,000	271,836,000	
		東京都 公募第1回	300,000,000	314,229,000	
		東京都 公募(20年)第3回	200,000,000	217,416,000	
		東京都 公募第7回	100,000,000	111,212,000	
		東京都 公募(20年)第13回	100,000,000	115,316,000	
		東京都 公募(20年)第16回	200,000,000	231,842,000	
		東京都 公募(20年)第17回	200,000,000	233,220,000	
		東京都 公募第23回	100,000,000	120,153,000	
		東京都 公募(20年)第26回	100,000,000	117,244,000	
		北海道 公募平成24年度第6回	100,000,000	101,871,000	
		北海道 公募平成24年度第9回	100,000,000	101,871,000	
		北海道 公募平成25年度第1回	300,000,000	304,728,000	
		北海道 公募平成26年度第13回	100,000,000	101,895,000	
		北海道 公募平成27年度第7回	100,000,000	102,144,000	
		北海道 公募平成28年度第13回	200,000,000	199,832,000	
		北海道 公募平成29年度第5回	200,000,000	200,150,000	
		北海道 公募平成29年度第6回	700,000,000	699,097,000	
		北海道 公募平成29年度第7回	100,000,000	100,321,000	
		北海道 公募平成29年度第9回	100,000,000	100,299,000	
		宮城県 公募第32回2号	100,000,000	99,902,000	

神奈川県 公募第184回	100,000,000	101,153,000
神奈川県 公募第188回	200,000,000	203,862,000
神奈川県 公募第196回	100,000,000	101,814,000
神奈川県 公募第200回	100,000,000	102,634,000
神奈川県 公募第205回	100,000,000	102,390,000
神奈川県 公募第206回	100,000,000	102,501,000
神奈川県 公募第210回	200,000,000	203,682,000
神奈川県 公募第231回	200,000,000	201,144,000
神奈川県 公募(30年)第3回	100,000,000	136,379,000
神奈川県 公募第7回	300,000,000	343,542,000
神奈川県 公募(20年)第14回	100,000,000	118,111,000
神奈川県 公募(20年)第17回	200,000,000	238,372,000
神奈川県 公募(20年)第26回	100,000,000	115,353,000
大阪府 公募第356回	100,000,000	101,731,000
大阪府 公募第378回	104,000,000	106,428,400
大阪府 公募第381回	100,000,000	102,432,000
大阪府 公募第382回	100,000,000	102,445,000
大阪府 公募第383回	100,000,000	102,579,000
大阪府 公募第384回	100,000,000	102,532,000
大阪府 公募第387回	300,000,000	306,084,000
大阪府 公募第389回	100,000,000	102,148,000
大阪府 公募第417回	102,000,000	102,751,740
大阪府 公募第423回	100,000,000	100,211,000
大阪府 公募第429回	179,000,000	179,533,420
大阪府 公募第452回	100,000,000	98,875,000
大阪府 公募第5回	100,000,000	119,872,000
大阪府 公募第8回	100,000,000	117,803,000
大阪府 公募(5年)第130回	600,000,000	599,496,000
大阪府 公募(5年)第137回	1,024,000,000	1,022,627,840
大阪府 公募(5年)第141回	230,000,000	229,643,500
京都府 公募平成24年度第2回	100,000,000	101,874,000
京都府 公募平成24年度第6回	100,000,000	101,877,000
京都府 公募平成26年度第5回	100,000,000	115,108,000
京都府 公募平成26年度第7回	200,000,000	204,494,000
京都府 公募(15年)平成27年度第8回	100,000,000	105,973,000
京都府 公募(20年)平成28年度第5回	100,000,000	98,948,000
京都府 公募平成29年度第4回	100,000,000	100,285,000
兵庫県 公募平成26年度第17回	100,000,000	101,958,000
兵庫県 公募平成29年度第22回	100,000,000	100,256,000
兵庫県 公募(30年)第2回	200,000,000	275,272,000
兵庫県 公募(15年)第1回	300,000,000	328,611,000

兵庫県	公募(15年)第3回	200,000,000	217,184,000
兵庫県	公募(12年)第3回	300,000,000	306,618,000
兵庫県	公募第2回	100,000,000	116,348,000
兵庫県	公募第9回	100,000,000	119,729,000
兵庫県	公募(20年)第11回	200,000,000	233,652,000
兵庫県	公募(20年)第14回	100,000,000	116,896,000
兵庫県	公募(20年)第22回	100,000,000	114,348,000
静岡県	公募平成24年度第5回	100,060,000	101,864,081
静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	101,817,000
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	103,879,510
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	169,233,900
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	102,256,000
静岡県	公募平成26年度第9回	200,000,000	204,500,000
静岡県	公募平成27年度第11回	115,400,000	115,468,086
静岡県	公募平成28年度第2回	300,000,000	299,643,000
静岡県	公募平成29年度第3回	100,000,000	100,345,000
静岡県	公募(31年)第1回	174,000,000	172,997,760
静岡県	公募(15年)第5回	200,000,000	215,806,000
静岡県	公募(15年)第9回	100,000,000	105,574,000
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	117,012,000
静岡県	公募(20年)第14回	200,000,000	234,392,000
静岡県	公募(20年)第18回	100,000,000	115,273,000
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	116,180,000
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	101,799,000
愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	101,898,000
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	116,656,000
愛知県	公募平成24年度第8回	150,000,000	152,782,500
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	435,632,000
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	118,814,000
愛知県	公募(30年)平成25年度第8回	120,000,000	160,904,400
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	130,207,000
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	113,934,000
愛知県	公募(15年)平成27年度第2回	100,000,000	105,630,000
愛知県	公募平成27年度第15回	100,000,000	102,088,000
愛知県	公募平成29年度第8回	100,000,000	100,395,000
愛知県	公募平成29年度第9回	100,000,000	100,034,000
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	101,979,000
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	205,118,000
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	111,074,353
広島県	公募平成29年度第4回	211,300,000	212,498,071

埼玉県	公募平成24年度第4回	300,000,000	305,379,000
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	102,832,000
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	151,824,320
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	102,379,000
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	102,366,000
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	102,517,000
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	204,424,000
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	407,860,000
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	101,805,000
埼玉県	公募平成27年度第9回	100,000,000	100,792,000
埼玉県	公募平成28年度第5回	100,000,000	99,560,000
埼玉県	公募平成30年度第4回	200,000,000	200,730,000
埼玉県	公募平成30年度第7回	200,000,000	199,692,000
埼玉県	公募(15年)第3回	100,000,000	101,710,000
埼玉県	公募(20年)第6回	100,000,000	117,569,000
埼玉県	公募(20年)第16回	100,000,000	112,376,000
埼玉県	公募(20年)第20回	100,000,000	103,869,000
福岡県	公募平成23年度第5回	100,000,000	101,492,000
福岡県	公募平成26年度第1回	100,000,000	102,511,000
福岡県	公募平成27年度第1回	300,000,000	307,473,000
福岡県	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,358,000
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	109,056,000
福岡県	公募(15年)令和元年度第1回	100,000,000	98,434,000
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	137,507,000
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	130,493,000
福岡県	公募(30年・定時償還)平成29年度第2回	100,000,000	111,179,000
福岡県	公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	116,266,000
福岡県	公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	116,134,000
千葉県	公募平成24年度第1回	100,000,000	102,033,000
千葉県	公募平成24年度第2回	100,000,000	101,813,000
千葉県	公募平成24年度第7回	100,000,000	101,837,000
千葉県	公募平成24年度第8回	100,000,000	102,181,000
千葉県	公募平成25年度第3回	100,000,000	102,659,000
千葉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	102,831,000
千葉県	公募平成26年度第3回	200,000,000	204,746,000
千葉県	公募平成28年度第4回	200,000,000	199,546,000
千葉県	公募平成29年度第4回	100,000,000	100,036,000
千葉県	公募平成29年度第8回	100,000,000	100,394,000
千葉県	公募(20年)第8回	100,000,000	119,978,000

千葉県 公募(20年)第16回	200,000,000	232,682,000
千葉県 公募(20年)第17回	100,000,000	114,402,000
群馬県 公募第8回	100,000,000	101,593,000
群馬県 公募第12回	100,000,000	102,240,000
群馬県 公募(20年)第3回	100,000,000	116,644,000
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	190,810,340
大分県 公募平成23年度第1回	902,000,000	915,277,440
共同発行市場地方債 公募第101回	300,000,000	304,119,000
共同発行市場地方債 公募第102回	150,000,000	152,136,000
共同発行市場地方債 公募第103回	100,000,000	101,461,000
共同発行市場地方債 公募第104回	200,000,000	203,186,000
共同発行市場地方債 公募第108回	200,000,000	203,742,000
共同発行市場地方債 公募第110回	200,000,000	203,542,000
共同発行市場地方債 公募第111回	200,000,000	203,676,000
共同発行市場地方債 公募第112回	100,000,000	101,793,000
共同発行市場地方債 公募第113回	800,000,000	813,528,000
共同発行市場地方債 公募第114回	243,700,000	248,254,753
共同発行市場地方債 公募第115回	100,000,000	101,885,000
共同発行市場地方債 公募第116回	200,000,000	203,894,000
共同発行市場地方債 公募第118回	100,000,000	102,181,000
共同発行市場地方債 公募第119回	200,000,000	204,256,000
共同発行市場地方債 公募第120回	300,000,000	305,481,000
共同発行市場地方債 公募第121回	100,000,000	101,544,000
共同発行市場地方債 公募第122回	400,000,000	406,976,000
共同発行市場地方債 公募第124回	300,000,000	308,394,000
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	102,593,000
共同発行市場地方債 公募第128回	700,000,000	715,267,000
共同発行市場地方債 公募第129回	100,000,000	102,423,000
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	102,669,000



共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	102,384,000
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	204,746,000
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	204,438,000
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	158,419,300
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	550,249,200
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,015,430,000
共同発行市場地方債 公募第156回	200,000,000	199,998,000
共同発行市場地方債 公募第157回	300,000,000	299,274,000
共同発行市場地方債 公募第161回	300,000,000	298,854,000
共同発行市場地方債 公募第172回	600,000,000	603,330,000
共同発行市場地方債 公募第184回	100,000,000	100,122,000
共同発行市場地方債 公募第190回	610,000,000	609,993,900
共同発行市場地方債 公募第191回	100,000,000	99,823,000
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	118,249,000
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	127,451,000
島根県 公募平成28年度第3回	100,000,000	99,891,000
佐賀県 公募平成28年度第1回	100,000,000	99,729,000
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	204,046,000
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	102,154,000
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	144,872,660
栃木県 公募平成24年度第1回	100,000,000	101,930,000
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	102,154,000
熊本市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,341,000
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	238,943,716
新潟市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,495,000
奈良県 公募平成28年度第1回	100,000,000	99,891,000
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,320,000
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	102,301,000
大阪市 公募平成26年度第5回	100,000,000	102,388,000
大阪市 公募(5年)平成28年度第5回	100,000,000	99,891,000
大阪市 公募(15年)第1回	100,000,000	110,206,000
大阪市 公募(20年)第1回	300,000,000	348,780,000
大阪市 公募(20年)第5回	100,000,000	119,326,000
大阪市 公募(20年)第6回	100,000,000	117,643,000

大阪市 公募(20年)第17回	100,000,000	117,415,000
名古屋市 公募第478回	100,000,000	101,957,000
名古屋市 公募第481回	100,000,000	101,844,000
名古屋市 公募第488回	300,000,000	307,200,000
名古屋市 公募第503回	100,000,000	100,433,000
名古屋市 公募第504回	200,000,000	200,728,000
名古屋市 公募(12年)第1回	200,000,000	209,694,000
名古屋市 公募(15年)第2回	100,000,000	107,064,000
京都市 公募平成23年度第4回	100,000,000	101,730,000
京都市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,465,000
京都市 公募平成29年度第4回	101,280,000	101,967,691
京都市 公募(20年)第2回	100,000,000	110,994,000
京都市 公募(20年)第6回	100,000,000	116,508,000
京都市 公募(20年)第13回	100,000,000	113,905,000
神戸市 公募平成26年度第17回	300,000,000	303,177,000
神戸市 公募平成28年度第1回	200,000,000	199,518,000
横浜市 公募公債平成24年度2回	200,000,000	203,814,000
横浜市 公募公債平成25年度1回	200,000,000	203,744,000
横浜市 公募公債平成25年度5回	200,000,000	204,300,000
横浜市 公募公債平成26年度5回	200,000,000	203,856,000
横浜市 公募平成28年度第5回	300,000,000	302,247,000
横浜市 公募平成29年度第3回	100,000,000	100,531,000
横浜市 公募(30年)第2回	200,000,000	261,068,000
横浜市 公募(20年)第18回	100,000,000	118,495,000
横浜市 公募(20年)第26回	100,000,000	118,200,000
横浜市 公募(20年)第30回	100,000,000	114,048,000
札幌市 公募(15年)平成23年度第9回	100,000,000	109,356,000
札幌市 公募(20年)平成24年度第1回	100,000,000	117,713,000
札幌市 公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	118,439,000
札幌市 公募平成26年度第4回	100,000,000	102,021,000
札幌市 公募平成26年度第9回	200,000,000	203,484,000
川崎市 公募第85回	100,000,000	101,779,000
川崎市 公募(20年)第17回	100,000,000	115,286,000
川崎市 公募(20年)第19回	100,000,000	113,775,000
北九州市 公募(20年)第3回	200,000,000	231,984,000
北九州市 公募(20年)第14回	100,000,000	117,263,000
福岡市 公募(20年)平成23年度第4回	100,000,000	118,351,000
福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	115,529,000
福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	102,187,000
福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	163,219,200

	広島市 公募平成26年度第2回	100,000,000	101,870,000
	広島市 公募平成27年度第2回	500,000,000	510,380,000
	広島市 公募(10年)平成30年度第6回	241,000,000	240,701,160
	千葉県 公募平成24年度第1回	100,000,000	102,033,000
	三重県 公募平成24年度第1回	140,660,000	143,315,660
	三重県 公募平成28年度第1回	155,000,000	155,455,700
	鹿児島県 公募(5年)平成28年度第1回	100,000,000	99,894,000
	福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	101,209,000
	福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	199,576,000
	山梨県 公募平成24年度第1回	200,000,000	203,782,000
	岡山県 公募平成28年度第2回	168,900,000	169,541,820
	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第96回	100,000,000	117,798,000
	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回	300,000,000	357,156,000
	福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	117,115,000
	福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	104,987,000
小計	銘柄数:273 組入時価比率:7.1%	45,662,820,000	47,906,508,421 7.2%
合計			47,906,508,421
特殊債券	日本円	フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014)	100,000,000 102,686,000
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000 153,826,720
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000 196,302,160
		新関西国際空港債券 政府保証第5回	117,000,000 117,774,540
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000 107,853,000
		新関西国際空港社債 財投機関債第22回	200,000,000 199,998,000
		日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000 106,998,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000 305,532,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000 108,084,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000 302,238,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第96回	100,000,000 100,450,000
		日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000 104,002,260
		日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	159,000,000 162,014,640

日本政策投資銀行社債 政府保証第 3 8 回	1,500,000,000	1,498,920,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 4 2 回	300,000,000	302,535,000	
道路債券 財投機関債第 1 7 回	300,000,000	312,279,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 4 回	100,000,000	132,907,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 8 回	200,000,000	228,292,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 7 回	100,000,000	114,427,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 2 3 回	300,000,000	349,110,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 3 3 回	200,000,000	321,312,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 3 9 回	200,000,000	237,264,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 4 7 回	100,000,000	120,305,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 8 0 回	100,000,000	101,808,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 8 4 回	400,000,000	407,692,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 8 6 回	200,000,000	203,548,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 8 9 回	100,000,000	116,832,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 0 回	200,000,000	204,072,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 2 回	100,000,000	101,869,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 3 回	350,000,000	409,416,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 5 回	100,000,000	119,079,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 7 回	100,000,000	102,880,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 1 6 回	400,000,000	409,464,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 2 2 回	100,000,000	102,650,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 2 3 回	100,000,000	102,595,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 3 0 回	200,000,000	204,384,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 3 4 回	200,000,000	204,122,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 3 6 回	200,000,000	204,850,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 4 5 回	300,000,000	367,926,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 4 9 回	100,000,000	124,475,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第157回	100,000,000	106,788,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第164回	100,000,000	110,983,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第173回	100,000,000	99,179,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第188回	100,000,000	103,322,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	200,000,000	238,324,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回	200,000,000	238,838,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回	200,000,000	240,982,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回	200,000,000	239,678,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	200,000,000	236,150,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	100,000,000	132,963,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第137回	840,000,000	852,902,400	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第149回	140,000,000	142,416,400	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回	100,000,000	101,719,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回	140,000,000	142,507,400	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第163回	1,000,000,000	1,018,960,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回	100,000,000	129,110,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回	100,000,000	101,894,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回	100,000,000	116,691,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	218,000,000	222,089,680	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	100,000,000	115,841,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回	300,000,000	393,696,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第173回	200,000,000	203,968,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回	200,000,000	203,958,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第180回	200,000,000	203,886,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	900,000,000	920,628,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回	100,000,000	118,175,000	
	196,000,000	199,104,640	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回	400,000,000	407,340,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回	1,000,000,000	1,027,830,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回	272,000,000	279,528,960	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	300,000,000	307,557,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第211回	137,000,000	140,430,480	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	145,000,000	148,617,750	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第216回	100,000,000	115,793,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第217回	100,000,000	128,227,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第219回	100,000,000	115,796,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	100,000,000	102,646,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第224回	100,000,000	128,493,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回	190,000,000	194,493,500	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第229回	630,000,000	644,981,400	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回	100,000,000	102,113,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第239回	500,000,000	558,160,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第261回	401,000,000	408,494,690	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第271回	151,000,000	150,728,200	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第297回	100,000,000	100,229,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第306回	403,000,000	405,667,860	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第315回	100,000,000	100,581,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第321回	600,000,000	604,830,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第324回	100,000,000	100,336,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第335回	100,000,000	108,929,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第339回	500,000,000	505,760,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第342回	131,000,000	131,991,670	
	100,000,000	100,780,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第351回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第354回	200,000,000	201,328,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第357回	100,000,000	101,333,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第13回	130,000,000	137,215,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第28回	400,000,000	530,216,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第33回	100,000,000	134,518,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	134,660,000	
地方公営企業等金融機構債券（20年）第1回	100,000,000	116,588,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	100,000,000	118,751,000	
地方公共団体金融機構債券 F16回	100,000,000	112,910,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	300,000,000	360,339,000	
地方公共団体金融機構債券 F24回	100,000,000	104,868,000	
地方公共団体金融機構債券（20年）第10回	300,000,000	347,961,000	
地方公共団体金融機構債券 第27回	300,000,000	304,218,000	
地方公共団体金融機構債券 第28回	500,000,000	507,575,000	
地方公共団体金融機構債券 F104回	100,000,000	106,275,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	104,849,000	
地方公共団体金融機構債券 F122回	100,000,000	109,168,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第37回	604,000,000	615,620,960	
地方公共団体金融機構債券 第37回	400,000,000	407,320,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第38回	194,000,000	197,612,280	
地方公共団体金融機構債券 F132回	500,000,000	527,375,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	100,000,000	101,842,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第40回	101,000,000	102,973,540	
政保 地方公共団体金融機構債券 第41回	102,000,000	103,991,040	
地方公共団体金融機構債券 第41回	600,000,000	611,832,000	
	100,000,000	104,543,000	

地方公共団体金融機構債券 F 1 4 2 回			
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 5 回	200,000,000	210,104,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 7 回	100,000,000	108,018,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	108,000,000	110,208,600	
地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	100,000,000	102,037,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 3 回	202,000,000	205,878,400	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 4 回	145,000,000	148,288,600	
地方公共団体金融機構債券 第 4 4 回	100,000,000	102,133,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 5 回	223,000,000	228,073,250	
地方公共団体金融機構債券 F 1 6 0 回	100,000,000	107,354,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 8 回	500,000,000	509,055,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 9 回	13,000,000	13,357,370	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 0 回	100,000,000	102,911,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 1 回	600,000,000	616,374,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 2 回	300,000,000	308,049,000	
地方公共団体金融機構債券（ 1 5 年） 第 2 回	200,000,000	217,648,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 6 回	591,000,000	607,335,240	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 9 回	116,000,000	119,033,400	
地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年） 第 3 8 回	100,000,000	115,118,000	
地方公共団体金融機構債券 F 2 4 0 回	300,000,000	326,139,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	102,332,000	
地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	102,395,000	
地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年） 第 3 9 回	100,000,000	114,349,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 5 回	400,000,000	409,428,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 9 回	320,000,000	326,153,600	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 2 回	189,000,000	193,452,840	
	300,000,000	307,311,000	



地方公共団体金融機構債券 第74回			
地方公共団体金融機構債券 第77回	100,000,000	102,339,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回	509,000,000	518,467,400	
地方公共団体金融機構債券 第79回	400,000,000	409,468,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (8年) 第5回	500,000,000	502,930,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回	116,000,000	115,788,880	
地方公共団体金融機構債券 第95回	200,000,000	200,980,000	
地方公共団体金融機構債券 第101回	400,000,000	403,000,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第108回	157,000,000	158,207,330	
政保 地方公共団体金融機構債券 第110回	100,000,000	100,661,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第113回	110,000,000	111,581,800	
公営企業債券(20年) 第2回財投機関債	100,000,000	103,849,000	
公営企業債券(20年) 第5回財投機関債	200,000,000	214,366,000	
公営企業債券(20年) 第19回財投機関債	100,000,000	115,030,000	
公営企業債券(20年) 第20回財投機関債	100,000,000	114,710,000	
公営企業債券(20年) 第24回財投機関債	100,000,000	117,159,000	
公営企業債券(20年) 第25回財投機関債	100,000,000	119,141,000	
首都高速道路 第17回	200,000,000	199,984,000	
都市再生債券 財投機関債第55回	100,000,000	101,522,000	
都市再生債券 財投機関債第96回	200,000,000	204,992,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	107,991,000	
都市再生債券 財投機関債第101回	100,000,000	107,255,000	
都市再生債券 財投機関債第109回	100,000,000	107,401,000	
都市再生債券 財投機関債第113回	300,000,000	320,172,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	111,454,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第16回	360,000,000	368,643,600	
東京交通債券 第342回	200,000,000	210,046,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	168,280,450	
関西国際空港社債 財投機関債第32回	100,000,000	101,654,000	

福祉医療機構債券 第31回財投機関債	100,000,000	101,986,000	
中部国際空港債券 政府保証第18回	368,000,000	375,025,120	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	200,000,000	229,500,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	100,000,000	107,321,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	100,000,000	109,421,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第49回	100,000,000	119,482,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	100,000,000	118,219,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第73回	100,000,000	101,484,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	100,000,000	120,054,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回	300,000,000	330,519,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	100,000,000	120,011,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第79回	100,000,000	101,514,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第86回	200,000,000	202,962,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回	200,000,000	219,650,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第120回	100,000,000	118,598,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第123回	100,000,000	118,027,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回	100,000,000	137,756,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第132回	200,000,000	214,998,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第137回	100,000,000	109,513,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第143回	100,000,000	108,897,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第177回	250,000,000	255,897,500	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第198回	300,000,000	300,678,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第223回	100,000,000	100,937,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第244回	130,000,000	131,443,000	
成田国際空港 第10回	100,000,000	101,551,000	
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	204,320,000	
成田国際空港 第17回	200,000,000	204,186,000	
	100,000,000	101,425,000	

沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第17回			
商工債券 利付第806回い号	300,000,000	299,406,000	
商工債券 利付第811回い号	300,000,000	299,871,000	
商工債券 利付第815回い号	100,000,000	99,921,000	
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	99,917,000	
商工債券 利付第819回い号	300,000,000	299,847,000	
しんきん中金債券 利付第327回	200,000,000	199,674,000	
しんきん中金債券 利付第335回	200,000,000	199,664,000	
商工債券 利付(3年)第223回	500,000,000	499,505,000	
商工債券 利付(3年)第231回	200,000,000	199,562,000	
商工債券 利付(3年)第236回	500,000,000	497,950,000	
商工債券 利付(10年)第15回	200,000,000	202,592,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関 債	200,000,000	239,774,000	
東日本高速道路 第36回	200,000,000	200,058,000	
東日本高速道路 第61回	200,000,000	198,616,000	
中日本高速道路 第63回	100,000,000	102,604,000	
中日本高速道路 第66回	1,200,000,000	1,199,916,000	
西日本高速道路 第20回	200,000,000	204,882,000	
西日本高速道路 第22回	400,000,000	410,992,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	102,282,000	
西日本高速道路 第30回	300,000,000	300,546,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第62回	100,000,000	102,525,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第68回	200,000,000	204,740,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第69回	100,000,000	114,510,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第71回	500,000,000	511,280,000	
貸付債権担保第12回住宅金融公庫 債券	31,773,000	32,028,137	
貸付債権担保第19回住宅金融公庫 債券	58,855,000	60,073,887	
貸付債権担保第5回S種住宅金融公 庫債券	36,222,000	36,931,951	
貸付債権担保第42回住宅金融公庫 債券	40,140,000	41,985,637	
貸付債権担保第7回S種住宅金融公 庫債券	12,569,000	12,968,568	
貸付債権担保第39回住宅金融公庫 債券	27,128,000	28,089,958	
貸付債権担保第40回住宅金融公庫 債券	31,000,000	32,480,870	
貸付債権担保第15回住宅金融公庫 債券	34,884,000	35,605,749	
貸付債権担保第32回住宅金融公庫 債券	57,256,000	59,071,587	

貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	59,620,000	61,109,903	
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	53,364,000	55,635,705	
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	89,640,000	93,333,168	
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	14,918,000	15,597,962	
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	23,370,000	25,313,682	
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	75,774,000	81,245,640	
貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券	15,271,000	15,575,961	
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	81,382,000	85,893,004	
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券	30,750,000	31,378,222	
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	97,038,000	103,295,010	
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	72,332,000	76,473,007	
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	41,724,000	44,824,510	
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	91,419,000	97,302,726	
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	101,823,000	106,685,048	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	137,997,000	144,826,471	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	134,400,000	141,744,960	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	86,540,000	90,945,751	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	33,524,000	35,527,729	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	78,668,000	83,558,002	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	44,795,000	46,706,850	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	96,288,000	100,497,711	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	43,663,000	45,539,635	
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	24,952,000	25,681,097	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	131,352,000	137,985,276	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	28,359,000	30,414,460	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	30,605,000	32,859,364	
	30,003,000	31,948,394	

貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	32,357,000	34,486,414	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	87,918,000	92,979,439	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	125,298,000	132,465,045	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	41,903,000	44,349,716	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	84,674,000	88,758,673	
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	11,589,000	11,812,320	
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券	63,705,000	64,534,439	
貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券	26,114,000	26,450,609	
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	81,640,000	87,448,686	
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	81,696,000	87,269,301	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	163,540,000	172,173,276	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	88,884,000	94,010,829	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	145,026,000	151,956,792	
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	127,170,000	132,554,377	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	98,674,000	104,101,070	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	84,118,000	88,397,082	
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	204,572,000	213,272,447	
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	353,738,000	368,223,571	
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	53,219,000	55,205,133	
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	55,764,000	57,905,895	
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	57,342,000	59,300,802	
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	118,912,000	122,165,432	
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	124,862,000	127,320,532	
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	67,133,000	69,186,598	
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	71,021,000	72,969,816	
	210,567,000	217,427,272	

貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	216,576,000	224,530,836	
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	144,512,000	149,663,852	
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	71,045,000	73,454,135	
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	71,197,000	73,813,489	
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	256,911,000	259,069,052	
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	172,530,000	174,821,198	
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券	173,380,000	175,425,884	
貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券	86,916,000	88,003,319	
貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券	173,998,000	176,054,656	
貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券	87,884,000	88,587,072	
貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券	88,154,000	89,029,369	
貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券	89,415,000	90,479,038	
貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券	358,904,000	362,159,259	
貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券	270,651,000	273,281,727	
貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券	180,854,000	182,479,877	
貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券	182,582,000	184,718,209	
貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券	186,808,000	188,005,439	
貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券	93,491,000	94,085,602	
貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券	93,934,000	94,872,400	
貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券	95,000,000	95,515,850	
貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券	288,486,000	288,716,788	
貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券	289,788,000	290,187,907	
貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券	493,325,000	488,968,940	
貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券	198,948,000	199,091,242	
貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券	200,000,000	199,600,000	
小計 銘柄数：312	58,865,123,000	61,781,836,848	

		組入時価比率：9.1%		9.3%
	合計			61,781,836,848
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行（B F C M）第14回円貨社債	200,000,000	200,024,000
		フランス相互信用連合銀行（B F C M）第29回円貨社債	200,000,000	196,974,000
		フランス相互信用連合銀行（B F C M）第31回円貨社債	100,000,000	97,118,000
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第14回円貨社債	100,000,000	99,217,000
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第1回非上位円貨社債	200,000,000	199,872,000
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債（2014）	100,000,000	101,880,000
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第15回円貨社債（2018）	100,000,000	99,664,000
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第16回円貨社債（2018）	100,000,000	99,449,000
		スタンダード・チャータード 第3回円貨社債（2015）	100,000,000	100,894,000
		エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第2回円	100,000,000	99,560,000
		エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第3回円	100,000,000	98,810,000
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第1回円貨社債	100,000,000	99,376,000
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第6回円貨社債	100,000,000	97,390,000
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第7回円貨社債	100,000,000	91,765,000
		サンタンデール銀行 第1回円貨社債	100,000,000	98,034,000
		フランス電力 第4回円貨社債（2017）	100,000,000	102,763,000
		現代キャピタル・サービス・インク 第15回円貨社債	200,000,000	199,578,000
		ビー・エヌ・ビー・パリバ 第1回円貨社債（2017）	100,000,000	100,313,000
		ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第12回円貨社	200,000,000	198,420,000
		オーストラリア・ニュージーランド銀行 第10回円貨社債	200,000,000	200,274,000
		ソシエテ・ジェネラル 第1回非上位円貨社債（2017）	100,000,000	99,518,000
		大和ハウス工業 第5回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,323,000
		大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,367,000
		森永乳業 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,372,000
		明治ホールディングス 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,657,000

アサヒグループホールディングス 第8回特定社債間限定同順位特	100,000,000	100,277,000	
麒麟ホールディングス 第10回 社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,756,000	
味の素 第24回特定社債間限定同 順位特約付	200,000,000	199,258,000	
日本たばこ産業 第13回	100,000,000	99,590,000	
三越伊勢丹ホールディングス 第6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,989,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	101,720,000	
野村不動産ホールディングス 第5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,766,000	
森ヒルズリート投資法人 第17回 特定投資法人債間限定同順位特	200,000,000	197,186,000	
森ビル 第23回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	100,365,000	
東急不動産ホールディングス 第2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,946,000	
東レ 第30回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	99,796,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	99,358,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	201,856,000	
王子ホールディングス 第34回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	100,449,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,382,000	
住友化学 第56回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,990,000	
三井化学 第47回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,574,000	
三井化学 第48回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,759,000	
三菱ケミカルホールディングス 第 14回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,762,000	
三菱ケミカルホールディングス 第 29回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,170,000	
電通 第1回社債間限定同順位特約 付	100,000,000	99,504,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約 付	100,000,000	100,200,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	99,655,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	102,026,000	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	98,598,000	
ヤフー 第12回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	97,865,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	97,166,000	



J Xホールディングス 第9回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	102,066,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,239,000	
ブリヂストン 第11回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	99,779,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	101,844,000	
日本特殊陶業 第8回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,600,000	
新日鐵住金 第7回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,407,000	
新日鐵住金 第8回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,167,000	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順 位特約付	300,000,000	296,916,000	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,768,000	
ジェイ エフ イー ホールディン グス 第22回(JFEス保証)	100,000,000	101,270,000	
ジェイ エフ イー ホールディン グス 第28回社債間限定同順	100,000,000	98,522,000	
DOWAホールディングス 第4回 社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,537,000	
住友電気工業 第26回社債間限定 同順位特約付	200,000,000	199,430,000	
日立製作所 第17回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	216,064,000	
三菱電機 第45回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,307,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	101,817,000	
日本電産 第8回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	99,219,000	
日本電気 第48回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,882,000	
パナソニック 第16回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,016,000	
パナソニック 第17回社債間限定 同順位特約付	200,000,000	200,474,000	
ソニー 第32回	200,000,000	199,896,000	
東海理化電機製作所 第1回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	99,917,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	101,924,000	
三菱重工業 第35回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,307,000	
J A三井リース 第7回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	99,566,000	
J A三井リース 第8回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	99,091,000	
三井住友トラスト・パナソニック ファイナンス 第2回社債間限定	100,000,000	99,852,000	

トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	102,219,000	
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,375,000	
楽天カード 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,861,000	
ドンキホーテホールディングス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,042,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,744,000	
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,634,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,207,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,081,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	205,808,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,812,000	
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,681,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,428,000	
住友商事 第53回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,033,000	
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,714,000	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,926,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,735,000	
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,716,000	
クレディセゾン 第65回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,175,000	
イオン 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,461,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付	100,000,000	100,434,000	
りそなホールディングス 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,812,000	
りそなホールディングス 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,671,000	
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	200,000,000	200,714,000	
みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,214,000	
東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,324,000	
三菱東京UFJ銀行 第159回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,630,000	
	300,000,000	299,298,000	

三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付			
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	100,000,000	99,906,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付	100,000,000	103,046,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約 付	300,000,000	307,737,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	102,002,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	101,461,000	
みずほフィナンシャルグループ 第 1回劣後特約付	200,000,000	200,382,000	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	101,495,000	
みずほ銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	113,393,000	
N T Tファイナンス 第2回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	99,722,000	
トヨタファイナンス 第77回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	99,381,000	
トヨタファイナンス 第81回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	99,446,000	
リコーリース 第28回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	99,281,000	
アコム 第76回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,616,000	
アコム 第77回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,023,000	
ジャックス 第12回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,386,000	
ジャックス 第19回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,538,000	
日立キャピタル 第52回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,377,000	
日立キャピタル 第57回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,845,000	
日立キャピタル 第61回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	98,750,000	
日立キャピタル 第80回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	97,121,000	
三井住友ファイナンス&リース 第 27回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,523,000	
三菱UFJリース 第52回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	99,214,000	
三菱UFJリース 第75回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	98,924,000	
三菱UFJリース 第30回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,187,000	
大和証券グループ本社 第23回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	102,524,000	
三井不動産 第71回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	196,686,000	
	100,000,000	104,810,000	

三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無			
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	101,664,000	
三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	98,900,000	
東京建物 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,357,000	
ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,216,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,580,000	
住友不動産 第97回社債間限定同順位特約付	200,000,000	204,538,000	
住友不動産 第100回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,037,000	
日本ビルファンド投資法人 第13回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	102,798,000	
野村不動産オフィスファンド投資法人 第7回特定投資法人債間限	100,000,000	117,695,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人 第5回特定投資法人債	100,000,000	102,205,000	
東武鉄道 第102回社債間限定同順位特約付	200,000,000	210,534,000	
相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付	200,000,000	201,770,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,639,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,676,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	212,786,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,538,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	208,542,000	
東日本旅客鉄道 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,252,000	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	200,000,000	234,028,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,034,000	
東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,341,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	117,583,000	
東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,372,000	
西日本旅客鉄道 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,696,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	300,000,000	343,869,000	
	200,000,000	234,926,000	

東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付			
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,830,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	123,234,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	99,292,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	101,580,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	109,143,000	
西武ホールディングス 第1回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,234,000	
西日本鉄道 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,009,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,205,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,910,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,403,000	
日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,546,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,456,000	
九州旅客鉄道 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,125,000	
A N Aホールディングス 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,747,000	
滋澤倉庫 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,381,000	
K D D I 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,797,000	
K D D I 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,544,000	
東京電力 第548回	100,000,000	109,991,000	
東京電力 第560回	100,000,000	108,312,000	
中部電力 第500回	200,000,000	205,048,000	
中部電力 第524回	100,000,000	100,103,000	
中部電力 第530回	200,000,000	197,046,000	
関西電力 第496回	100,000,000	102,469,000	
関西電力 第497回	200,000,000	206,052,000	
関西電力 第509回	100,000,000	99,688,000	
関西電力 第511回	100,000,000	99,136,000	
関西電力 第514回	200,000,000	199,770,000	
関西電力 第527回	200,000,000	199,556,000	
中国電力 第377回	400,000,000	411,964,000	
中国電力 第378回	100,000,000	102,675,000	
中国電力 第400回	100,000,000	99,563,000	
中国電力 第402回	300,000,000	299,322,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	102,775,000	

北陸電力 第304回	100,000,000	102,622,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	104,143,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	102,054,000	
北陸電力 第326回	100,000,000	100,675,000	
東北電力 第475回	100,000,000	102,186,000	
東北電力 第481回	200,000,000	204,676,000	
東北電力 第484回	100,000,000	100,981,000	
東北電力 第491回	100,000,000	100,098,000	
四国電力 第281回	200,000,000	205,884,000	
九州電力 第424回	300,000,000	310,263,000	
九州電力 第428回	105,000,000	107,754,150	
九州電力 第449回	200,000,000	199,928,000	
九州電力 第451回	100,000,000	100,103,000	
九州電力 第476回	100,000,000	99,211,000	
北海道電力 第321回	100,000,000	102,330,000	
北海道電力 第323回	100,000,000	107,176,000	
北海道電力 第338回	100,000,000	101,025,000	
電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,188,000	
電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,403,000	
電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,439,000	
電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,027,000	
電源開発 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,741,000	
電源開発 第59回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,341,000	
東京電力パワーグリッド 第2回	100,000,000	100,639,000	
東京電力パワーグリッド 第6回	100,000,000	99,885,000	
東京電力パワーグリッド 第11回	300,000,000	297,351,000	
東京電力パワーグリッド 第14回	100,000,000	99,965,000	
東京電力パワーグリッド 第28回	100,000,000	100,222,000	
東京瓦斯 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,416,000	
東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	129,403,000	
東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,170,000	
大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,557,000	
東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,750,000	
北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,847,000	
	100,000,000	97,262,000	

	北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付			
	広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,511,000	
	東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,546,000	
	ファーストリテイリング 第3回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,644,000	
	ファーストリテイリング 第4回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,221,000	
	ファーストリテイリング 第7回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,720,000	
	ソフトバンクグループ 第54回社債間限定同順位特約付	100,000,000	88,630,000	
小計	銘柄数：233 組入時価比率：4.3%	28,905,000,000	29,411,446,150	4.4%
合計			29,411,446,150	
合計			666,423,104,429	

(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)

(2020年 3月31日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	335,270,610
コール・ローン	1,322,362,253
国債証券	575,473,797,784
派生商品評価勘定	5,397,042
未収入金	3,219,402,322
未収利息	5,087,515,523
前払費用	229,570,189
その他未収収益	11,844,801
流動資産合計	585,685,160,524
資産合計	585,685,160,524
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,641,210
未払金	845,670,117
未払解約金	370,898,706
未払利息	2,420
その他未払費用	9,193,174
流動負債合計	1,238,405,627
負債合計	1,238,405,627
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	242,346,981,667

剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	342,099,773,230
元本等合計	584,446,754,897
純資産合計	584,446,754,897
負債純資産合計	585,685,160,524

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 3月31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	2.4116円
(10,000口当たり純資産額)	(24,116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	187,060,844,351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	196,105,464,249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 2019年 4月 2日  
至 2020年 3月31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

2020年 3月31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

2020年 3月31日現在

期首	2019年 4月 2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	270,596,175,268円
同期中における追加設定元本額	30,239,721,858円
同期中における一部解約元本額	58,488,915,459円
期末元本額	242,346,981,667円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	84,284,213円
バランスセレクト50	88,718,522円

バランスセレクト70	67,127,356円
野村外国債券インデックスファンド	301,177,391円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,649,718,733円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	24,031,695,476円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,483,681,272円
野村資産設計ファンド2015	26,947,517円
野村資産設計ファンド2020	30,378,607円
野村資産設計ファンド2025	46,656,892円
野村資産設計ファンド2030	44,796,614円
野村資産設計ファンド2035	30,815,996円
野村資産設計ファンド2040	57,786,781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)	106,801,161,780円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	5,424,594,663円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	10,400,625,306円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	2,061,110,449円
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	754,403,570円
野村資産設計ファンド2045	7,103,817円
野村インデックスファンド・外国債券	811,583,593円
マイ・ロード	8,270,826,615円
ネクストコア	145,383,760円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	152,125,263円
野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	6,198,918,908円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,189,269,436円
野村資産設計ファンド2050	8,984,647円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	5,709,928円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,050,360円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,505,484円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,100,815円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	440,060,174円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	279,163,409円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,490,626円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,556,469円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,313,851円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,619,597円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,510,179円
野村6資産均等バランス	756,236,909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)	7,775,845,194円
世界6資産分散ファンド	79,340,430円
野村資産設計ファンド2060	2,340,599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	2,419,722,012円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	1,971,939,201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)	8,916,243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)	1,390,321,682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)	338,880,526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)	1,552,194,424円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	1,257,847,192円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	3,130,050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)	8,475,778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)	340,828円
野村インデックス・バランス60V A(適格機関投資家専用)	3,472,449,158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)	17,372,683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)	86,461,759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)	16,513,885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)	169,501,234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)	180,534,511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)	1,739,360,759円
野村世界バランス25V A(適格機関投資家専用)	103,558,284円
ノムラ外国債券インデックスファンドV A(適格機関投資家専用)	733,358,369円
ノムラF O F s用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	1,877,297,199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)	369,756円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,552,636円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	5,768,496円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	5,376,246円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	571,598,978円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,081,545,802円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,570,892,203円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	3,936,362,536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)	16,036,627,214円
マイバランスD C 30	1,730,986,942円
マイバランスD C 50	1,104,260,061円
マイバランスD C 70	681,643,863円
野村D C外国債券インデックスファンド	5,878,652,387円
野村D C運用戦略ファンド	2,110,367,571円
野村D C運用戦略ファンド(マイルド)	187,268,291円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	132,765,978円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	189,389,451円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	88,777,854円
野村世界6資産分散投信(D C)安定コース	8,368,355円
野村世界6資産分散投信(D C)インカムコース	22,610,797円
野村世界6資産分散投信(D C)成長コース	7,803,796円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2030	3,319,350円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2040	1,984,517円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2050	1,265,614円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	49,338,448円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	31,118,295円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	12,616,698円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	14,137,617円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2060	314,937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(2020年3月31日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2020年3月31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	30,700,000.00	34,589,063.72	
		US TREASURY BOND	38,800,000.00	46,590,310.56	
		US TREASURY BOND	45,100,000.00	49,042,723.18	
		US TREASURY BOND	72,200,000.00	95,419,628.30	
		US TREASURY BOND	19,000,000.00	26,433,750.00	
		US TREASURY BOND	10,800,000.00	15,300,139.68	
		US TREASURY BOND	43,300,000.00	60,598,007.93	
		US TREASURY BOND	49,300,000.00	68,496,187.50	
		US TREASURY BOND	27,500,000.00	38,431,250.00	
		US TREASURY BOND	100,000.00	156,968.75	
		US TREASURY BOND	24,500,000.00	32,615,625.00	
		US TREASURY BOND	7,000,000.00	10,626,875.00	
		US TREASURY N/B	6,400,000.00	6,459,499.52	
		US TREASURY N/B	800,000.00	817,562.48	
		US TREASURY N/B	400,000.00	404,625.00	
		US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,929,238.16	
		US TREASURY N/B	10,800,000.00	11,051,436.96	
		US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,472,140.22	
		US TREASURY N/B	45,400,000.00	46,942,887.22	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,028,007.80	
		US TREASURY N/B	17,900,000.00	18,283,170.98	
		US TREASURY N/B	15,900,000.00	16,125,455.64	
		US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,301,640.30	
		US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,227,851.29	
		US TREASURY N/B	34,000,000.00	34,842,030.40	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,619,687.36			
US TREASURY N/B	40,300,000.00	41,044,602.95			

US TREASURY N/B	23,500,000.00	24,229,783.10	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	11,714,390.34	
US TREASURY N/B	24,300,000.00	24,613,241.58	
US TREASURY N/B	26,100,000.00	26,796,337.56	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,973,453.04	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,457,499.20	
US TREASURY N/B	9,650,000.00	9,782,687.50	
US TREASURY N/B	24,700,000.00	25,385,037.21	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,931,171.78	
US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,719,433.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,027,695.30	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,794,234.19	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,810,750.00	
US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,907,281.25	
US TREASURY N/B	80,000,000.00	83,278,120.00	
US TREASURY N/B	6,400,000.00	6,549,499.52	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,424,375.00	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,898,029.20	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,996,031.08	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,611,015.45	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	4,019,132.52	
US TREASURY N/B	500,000.00	516,406.25	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,353,370.98	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,842,935.04	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	26,165,733.11	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	9,088,405.92	
US TREASURY N/B	200,000.00	207,062.50	
US TREASURY N/B	900,000.00	929,531.25	
US TREASURY N/B	17,600,000.00	18,350,749.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,390.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,085.93	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,038,125.00	
US TREASURY N/B	900,000.00	929,636.64	
US TREASURY N/B	19,100,000.00	19,849,077.17	
US TREASURY N/B	900,000.00	933,398.37	

US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,567,148.40	
US TREASURY N/B	7,600,000.00	7,868,671.40	
US TREASURY N/B	10,200,000.00	10,719,562.50	
US TREASURY N/B	47,900,000.00	49,913,294.48	
US TREASURY N/B	400,000.00	419,656.24	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,710,936.00	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	15,274,187.50	
US TREASURY N/B	400,000.00	414,500.00	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,614,062.50	
US TREASURY N/B	34,800,000.00	36,374,153.64	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,580,218.52	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,945,874.88	
US TREASURY N/B	41,100,000.00	44,439,375.00	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,977,343.75	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,293,421.33	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	36,470,498.24	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	12,351,280.66	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	46,337,481.18	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,803,030.56	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,784,375.00	
US TREASURY N/B	43,000,000.00	46,087,262.40	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,407,960.84	
US TREASURY N/B	800,000.00	874,124.96	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,820,460.81	
US TREASURY N/B	20,100,000.00	21,872,882.31	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,934,851.12	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,089,750.00	
US TREASURY N/B	42,700,000.00	46,055,950.99	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,907,406.16	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	37,144,404.54	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,486,335.88	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	18,207,108.53	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,789,406.08	
US TREASURY N/B	35,000,000.00	38,850,000.00	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	33,721,875.00	

US TREASURY N/B	6,500,000.00	7,061,640.30	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,595,523.13	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	29,231,717.40	
US TREASURY N/B	19,200,000.00	21,852,000.00	
US TREASURY N/B	70,300,000.00	77,291,552.93	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,132,343.60	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	9,574,889.98	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,920,937.50	
US TREASURY N/B	21,100,000.00	22,400,616.66	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,652,500.00	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,999,000.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	14,242,108.40	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,149,218.00	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,613,625.00	
US TREASURY N/B	38,000,000.00	42,880,625.00	
US TREASURY N/B	8,400,000.00	9,432,937.08	
US TREASURY N/B	500,000.00	583,242.15	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,124,000.00	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,450,312.44	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	6,027,327.93	
US TREASURY N/B	41,700,000.00	62,093,906.25	
US TREASURY N/B	7,500,000.00	11,586,034.50	
US TREASURY N/B	200,000.00	330,375.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	159,324.21	
US TREASURY N/B	100,000.00	143,523.43	
US TREASURY N/B	100,000.00	156,519.53	
US TREASURY N/B	100,000.00	161,414.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	159,539.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	164,601.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	160,179.68	
US TREASURY N/B	200,000.00	302,687.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	158,437.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	168,445.31	
US TREASURY N/B	100,000.00	161,656.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	149,812.50	

	US TREASURY N/B	300,000.00	413,250.00	
	US TREASURY N/B	100,000.00	137,843.75	
	US TREASURY N/B	100,000.00	135,449.21	
	US TREASURY N/B	200,000.00	260,687.50	
	US TREASURY N/B	8,800,000.00	11,476,780.48	
	US TREASURY N/B	3,600,000.00	4,972,500.00	
	US TREASURY N/B	100,000.00	148,843.75	
	US TREASURY N/B	7,400,000.00	11,056,062.50	
	US TREASURY N/B	15,200,000.00	21,945,000.00	
	US TREASURY N/B	23,000,000.00	32,027,500.00	
	US TREASURY N/B	36,900,000.00	50,472,281.25	
	US TREASURY N/B	49,400,000.00	62,336,625.00	
	US TREASURY N/B	21,900,000.00	30,085,125.00	
	US TREASURY N/B	17,500,000.00	23,619,531.25	
	US TREASURY N/B	5,200,000.00	7,185,140.56	
	US TREASURY N/B	51,500,000.00	65,421,093.75	
	US TREASURY N/B	28,200,000.00	35,875,687.50	
	US TREASURY N/B	34,300,000.00	41,749,531.25	
	US TREASURY N/B	14,200,000.00	19,365,250.00	
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,375,750.00	
	US TREASURY N/B	11,400,000.00	15,229,687.50	
	US TREASURY N/B	9,300,000.00	12,431,847.54	
	US TREASURY N/B	9,500,000.00	13,292,206.20	
	US TREASURY N/B	6,100,000.00	8,727,526.81	
	US TREASURY N/B	10,500,000.00	14,741,425.65	
	US TREASURY N/B	3,400,000.00	4,787,625.00	
	US TREASURY N/B	100,000.00	137,949.21	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,459,140.60	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,262,382.80	
小計	銘柄数：161	2,334,150,000.00	2,682,692,621.42	
			(291,957,437,989)	
	組入時価比率：50.0%		50.7%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	5,500,000.00	5,770,270.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	14,300,000.00	14,344,616.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	13,050,000.00	13,476,213.00	



	CANADIAN GOVERNMENT	12,200,000.00	12,369,458.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	301,176.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	300,240.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	6,783,549.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	310,797.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,460,000.00	4,595,896.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,154,054.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	532,360.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	7,336,928.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	4,007,766.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	315,714.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,250,000.00	10,941,410.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	204,538.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	110,447.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,080,000.00	14,525,078.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	6,674,094.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	6,097,252.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	10,702,043.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	14,678,638.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,750,580.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	709,914.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	150,118.00	
小計	銘柄数：25	114,190,000.00	138,143,149.60	
			(10,581,765,259)	
	組入時価比率：1.8%		1.8%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	95,300,000.00	95,482,023.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	58,700,000.00	59,630,395.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,400,000.00	44,560,728.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	302,982.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	56,117,438.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	45,236,000.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	51,300,000.00	48,491,325.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	112,300,000.00	114,383,165.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	45,300,000.00	49,083,456.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,500,000.00	70,491,295.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	10,256,300.00	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,300,000.00	68,463,052.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	11,800,000.00	12,549,064.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	78,000,000.00	76,292,580.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	33,000,000.00	33,057,750.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	87,100,000.00	91,320,866.00	
	銘柄数：16	845,600,000.00	875,718,419.00	(4,002,033,174)
	組入時価比率：0.7%			0.7%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	750,134.00	
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	873,430.40	
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	672,420.00	
	BELGIUM KINGDOM	9,700,000.00	10,562,504.60	
	BELGIUM KINGDOM	2,900,000.00	2,954,520.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,488,400.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,038,554.80	
	BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,163,200.00	
	BELGIUM KINGDOM	6,000,000.00	7,725,024.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,076,549.00	
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,141,024.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,073,300.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,275,313.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,657,845.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	5,138,799.75	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	113,710.00	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	587,799.00	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	125,697.64	
	BELGIUM KINGDOM	3,400,000.00	5,914,344.20	
	BELGIUM KINGDOM	4,400,000.00	7,649,681.60	
	BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,428,193.20	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,268,564.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,765,714.80	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,500,011.30	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	16,757,248.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	18,640,875.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	19,400,000.00	20,614,440.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,100,000.00	5,170,507.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,700,000.00	10,752,633.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,550,000.00	16,184,212.35
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,350,000.00	4,354,176.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,019,500.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	17,432,481.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,247,745.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	6,138,173.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,600,000.00	17,269,274.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,900,000.00	7,951,215.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	504,628.87
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	955,809.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	18,734,751.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,555,600.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,419,664.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	30,304,534.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,307,545.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,157,420.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,369,500.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	12,968,850.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,273,055.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,400,000.00	7,632,000.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	2,540,471.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,700,000.00	14,567,454.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,100,000.00	16,615,144.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	4,328,736.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,800,000.00	7,656,220.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,700,000.00	2,741,552.60
BUNDES OblIGATION	700,000.00	704,480.00
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,010,680.00
BUNDES OblIGATION	700,000.00	710,129.00
BUNDES OblIGATION	750,000.00	764,130.00
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,023,260.00
BUNDES OblIGATION	2,000,000.00	2,065,540.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	350,000.00	367,248.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	416,800.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	6,023,646.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	738,696.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	415,611.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,100,000.00	10,817,908.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,580,000.00	2,823,577.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,900,000.00	17,602,126.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,866,345.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	874,568.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000.00	8,721,675.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,862,891.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,950,486.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	6,214,758.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,044,420.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	745,374.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	21,500,000.00	32,954,340.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,087,540.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	12,288,766.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	1,529,024.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	10,623,617.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,500,000.00	16,009,780.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	10,351,024.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,600,000.00	13,392,409.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	5,934,506.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,500,000.00	8,533,926.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	11,031,616.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,900,000.00	3,398,311.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	12,103,334.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	8,861,164.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,400,000.00	14,432,808.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	154,961.02	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	99,891.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,200,000.00	12,667,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,100,000.00	5,116,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,372,160.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	16,500,000.00	17,544,615.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,372,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,050,000.00	1,050,913.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,600,000.00	2,679,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,600,000.00	20,231,778.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	2,742,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	407,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	404,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,200,000.00	9,192,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,174,660.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	31,100,000.00	35,093,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,874,635.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,232,965.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	568,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	24,231,460.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,700,000.00	16,859,430.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	313,470.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,534,860.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,831,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,074,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	20,105,736.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	825,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,086,773.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,582,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,166,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,500,000.00	13,800,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,125,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,100,000.00	25,126,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,500,000.00	24,134,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	7,382,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,200,000.00	25,722,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,000,000.00	23,161,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	503,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	15,946,700.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,522,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,400,000.00	21,464,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,191,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	898,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	572,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	7,272,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	230,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	17,091,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,800,000.00	21,548,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,500,000.00	4,136,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,473,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	9,181,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,021,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	1,820,581.00	
FINNISH GOVERNMENT	600,000.00	625,862.40	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	507,127.50	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,544.70	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	106,338.80	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	407,447.68	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	772,240.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,445,460.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	106,707.30	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,098,630.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,113,997.80	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,543,155.20	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	874,571.20	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	229,019.20	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	610,186.80	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	384,647.04	
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	804,864.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,000,000.00	6,063,904.20	
FRANCE (GOVT OF)	2,600,000.00	2,644,070.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,693,716.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	101,990.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,600,000.00	10,710,192.00	

FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,838,148.30	
FRANCE (GOVT OF)	11,000,000.00	11,529,012.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,888,380.00	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,773,889.64	
FRANCE (GOVT OF)	1,700,000.00	1,851,857.60	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,155,684.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,600,000.00	1,727,497.60	
FRANCE (GOVT OF)	9,500,000.00	12,008,807.50	
FRANCE (GOVT OF)	10,500,000.00	12,060,279.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	115,280.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	125,094.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	14,297,566.20	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	505,759.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,900,000.00	1,987,647.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,100,000.00	4,351,994.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,500,000.00	9,141,778.05	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,200,000.00	3,243,712.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	18,913,576.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,900,000.00	13,897,500.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	31,687,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,311,685.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	26,907,091.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,465,900.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000.00	42,094,745.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	5,529,150.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	40,813,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,500,000.00	15,790,383.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000.00	34,584,060.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,300,000.00	17,269,186.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	496,599.42	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,600,000.00	17,416,281.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	22,200,000.00	36,116,958.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,500,000.00	11,104,390.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,700,000.00	9,978,617.00	
IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,112,323.58	

IRISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,322,986.40	
IRISH TSY 0.8% 2022	1,200,000.00	1,231,989.60	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	661,072.80	
IRISH TSY 1.3% 2033	2,400,000.00	2,738,347.20	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,272,606.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	1,500,000.00	1,798,599.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	700,000.00	847,997.50	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,931,255.20	
IRISH TSY 2.4% 2030	3,700,000.00	4,582,246.50	
IRISH TSY 2% 2045	3,100,000.00	4,110,851.10	
IRISH TSY 2022	4,800,000.00	4,859,380.80	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,100,000.00	7,000,848.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	50,000.00	52,615.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,520,400.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	106,990.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	225,540.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	246,200.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	432,632.56	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	102,553.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	10,000,000.00	11,168,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,565,811.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,256,200.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,720,532.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	10,693,770.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,093,350.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,400,000.00	3,600,260.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,500,000.00	7,447,110.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,700,000.00	6,282,806.83	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	548,950.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,400,000.00	4,373,176.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,500,000.00	9,446,798.35	
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,454,718.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	742,261.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	3,481,280.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	101,593.80	



	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	221,439.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	915,840.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	162,323.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,326,455.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	767,581.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,414,708.75	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,108,560.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,137,127.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	11,207,910.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,600,000.00	2,745,860.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,800,000.00	6,326,419.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	665,674.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	5,325,779.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6,100,000.00	7,784,820.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	450,000.00	1,001,655.45	
	REPUBLIC OF IRELAND	3,350,000.00	3,779,816.05	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,662,961.60	
	SPANISH GOVERNMENT	16,400,000.00	26,115,360.00	
	SPANISH GOVERNMENT	500,000.00	754,473.50	
小計	銘柄数：256	1,339,620,000.00	1,728,917,519.39 (206,692,089,443)	
	組入時価比率：35.4%		35.9%	
英ポンド	UK TREASURY	40,000.00	43,735.60	
	UK TREASURY	470,000.00	494,707.90	
	UK TREASURY	2,750,000.00	2,956,607.50	
	UK TREASURY	300,000.00	302,721.00	
	UK TREASURY	1,300,000.00	1,351,467.00	
	UK TREASURY	14,000,000.00	14,289,380.00	
	UK TREASURY	4,800,000.00	5,149,296.00	
	UK TREASURY	1,600,000.00	1,656,512.00	
	UK TREASURY	7,450,000.00	8,313,306.00	
	UK TREASURY	9,950,000.00	12,317,901.00	
	UK TREASURY	200,000.00	204,634.00	
	UK TREASURY	200,000.00	220,788.00	
	UK TREASURY	160,000.00	173,672.00	

	UK TREASURY	400,000.00	432,308.00
	UK TREASURY	9,630,000.00	12,621,463.20
	UK TREASURY	200,000.00	224,410.00
	UK TREASURY	6,900,000.00	10,341,996.00
	UK TREASURY	6,000,000.00	8,793,600.00
	UK TREASURY	5,550,000.00	8,043,615.00
	UK TREASURY	13,400,000.00	20,782,060.00
	UK TREASURY	2,600,000.00	4,045,080.00
	UK TREASURY	100,000.00	172,360.00
	UK TREASURY	600,000.00	990,480.00
	UK TREASURY	1,800,000.00	3,024,180.00
	UK TREASURY	400,000.00	439,000.00
	UK TREASURY	1,200,000.00	2,145,120.00
	UK TREASURY	18,440,000.00	29,865,424.00
	UK TREASURY	6,700,000.00	12,368,200.00
	UK TREASURY	9,100,000.00	10,796,240.00
	UK TREASURY	9,600,000.00	12,095,040.00
	UK TREASURY	5,350,000.00	10,364,555.00
	UK TREASURY	6,750,000.00	12,774,375.00
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,297,300.00
	UK TREASURY	2,100,000.00	2,876,790.00
	UK TREASURY	100,000.00	175,740.00
	UK TREASURY	950,000.00	2,121,160.00
	UK TSY 3 1/4% 2044	26,900,000.00	41,460,970.00
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,800,000.00	14,618,640.00
小計	銘柄数：38	185,790,000.00	270,344,834.20 (36,042,373,295)
	組入時価比率：6.2%		6.3%
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	36,050,000.00	39,137,682.50
	SWEDISH GOVERNMENT	3,100,000.00	3,315,653.67
	SWEDISH GOVERNMENT	32,250,000.00	37,064,925.00
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	13,044,000.00
	SWEDISH GOVERNMENT	16,800,000.00	18,143,983.20
	SWEDISH GOVERNMENT	14,300,000.00	15,571,484.50
	SWEDISH GOVERNMENT	10,500,000.00	16,956,853.20

小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.3%	125,000,000.00	143,234,582.07 (1,548,365,832) 0.3%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	23,600,000.00	24,555,800.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	13,963,670.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	38,900,000.00	42,737,485.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,974,950.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,937,820.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,211,040.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,817,760.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	8,070,000.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,830,369.50
小計	銘柄数：9 組入時価比率：0.2%	112,200,000.00	120,098,894.50 (1,232,214,657) 0.2%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	17,200,000.00	18,206,578.40
	KINGDOM OF DENMARK	400,000.00	408,671.44
	KINGDOM OF DENMARK	18,570,000.00	19,832,760.00
	KINGDOM OF DENMARK	32,000,000.00	35,972,800.00
	KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	16,803,710.00
	KINGDOM OF DENMARK	10,400,000.00	11,176,880.00
	KINGDOM OF DENMARK	38,100,000.00	71,940,526.68
小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.5%	132,370,000.00	174,341,926.52 (2,791,214,243) 0.5%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	46,300,000.00	46,940,023.42
	POLAND GOVERNMENT BOND	28,500,000.00	31,236,000.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	25,000,000.00	26,497,500.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,103,200.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	16,182,000.00
小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.6%	116,800,000.00	122,958,723.42 (3,236,273,600) 0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,051,332.61
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,900,000.00	7,106,863.38
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,040,000.00	1,165,684.00

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	80,000.00	84,112.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	6,256,979.46	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,863,840.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	15,200,000.00	17,345,037.68	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	15,632,866.62	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,100,000.00	15,592,395.17	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,709,538.24	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,800,000.00	19,864,800.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,457,551.88	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	12,326,116.76	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	6,267,780.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,334,594.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	11,049,971.24	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,179,717.38	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	5,445,794.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	893,200.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,569,722.96	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	6,661,040.00	
小計	銘柄数：21	127,700,000.00	151,858,938.18	
			(10,036,357,224)	
	組入時価比率：1.7%		1.7%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,380,000.00	1,407,543.83	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	705,509.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,347,150.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,533,920.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	307,650.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,600,000.00	3,815,640.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	728,560.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,065,984.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,173,480.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	743,050.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,510,350.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	555,150.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	342,679.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,763,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,483,632.00	

小計	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	2,326,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,050,000.00	2,503,050.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,240,000.00	
	銘柄数：18	28,530,000.00	31,553,748.33 (2,409,759,759)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,122,549.23	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	416,831.52	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,830,726.34	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	435,262.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	407,095.32	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,200,000.00	6,320,915.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	507,259.05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,641,521.44	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	510,826.35	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,735,496.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,590,055.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,260,382.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	6,081,931.62	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	624,185.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,127,062.08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,698,971.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,104,996.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,248,818.66	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	3,052,955.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	291,044.65	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,103,130.22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,619,265.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,304,900.15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	808,513.36	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	928,486.71	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	3,124,606.52	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	10,770,446.41	
MALAYSIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,174,539.96		
MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	336,108.93		

小計	銘柄数：29 組入時価比率：0.4%	99,480,000.00	104,178,884.90 (2,619,057,166) 0.5%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	35,600,000.00	36,038,246.68
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	62,300,000.00	62,392,571.57
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	38,200,000.00	30,230,991.04
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	21,135,000.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	68,900,000.00	52,581,854.91
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,800,000.00	5,235,186.72
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	27,100,000.00	15,795,638.79
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,000,000.00	23,145,600.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000.00	8,859,191.02
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,000,000.00	2,264,645.20
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	132,500,000.00	95,606,541.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	43,200,000.00	30,988,275.84
小計	銘柄数：12 組入時価比率：0.4%	492,400,000.00	384,273,742.77 (2,324,856,143) 0.4%
合計			575,473,797,784 (575,473,797,784)

(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(2020年 3月31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	1,700,000	
		US TREASURY N/B	39,000,000	
		US TREASURY N/B	26,775,000	
		US TREASURY N/B	10,000,000	
		US TREASURY N/B	8,000,000	
		US TREASURY N/B	6,400,000	
		US TREASURY N/B	7,480,000	
		US TREASURY N/B	5,000,000	
		US TREASURY BOND	20,825,000	
		US TREASURY N/B	12,070,000	
		US TREASURY N/B	8,925,000	
		US TREASURY N/B	18,615,000	
		US TREASURY N/B	31,000,000	
		US TREASURY N/B	7,983,000	

US TREASURY N/B	10,000,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY BOND	30,000,000
US TREASURY BOND	41,000,000
US TREASURY N/B	27,795,000
US TREASURY BOND	36,000,000
US TREASURY BOND	50,000,000
US TREASURY BOND	9,403,000
US TREASURY BOND	32,000,000
US TREASURY BOND	13,800,000
US TREASURY BOND	20,000,000
US TREASURY N/B	29,000,000
US TREASURY N/B	9,265,000
US TREASURY N/B	13,500,000
US TREASURY N/B	15,728,000
US TREASURY N/B	340,000
US TREASURY N/B	1,530,000
US TREASURY N/B	6,460,000
US TREASURY N/B	12,500,000
US TREASURY N/B	17,000,000
US TREASURY N/B	2,820,000
US TREASURY N/B	10,030,000
US TREASURY N/B	29,000,000
US TREASURY N/B	17,000,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	40,000,000
US TREASURY N/B	715,000
US TREASURY N/B	20,000,000
US TREASURY N/B	16,000,000
US TREASURY N/B	5,000,000
US TREASURY N/B	425,000
US TREASURY N/B	22,950,000
US TREASURY N/B	20,600,000
US TREASURY N/B	340,000
US TREASURY N/B	11,050,000
US TREASURY N/B	15,215,000
US TREASURY N/B	20,000,000
US TREASURY N/B	21,000,000
US TREASURY N/B	20,000,000
US TREASURY N/B	13,770,000
US TREASURY N/B	12,509,000
US TREASURY N/B	36,000,000
US TREASURY N/B	8,670,000
US TREASURY N/B	7,140,000
US TREASURY N/B	6,826,000
US TREASURY N/B	50,000,000
US TREASURY N/B	9,755,000
US TREASURY N/B	36,550,000
US TREASURY BOND	38,000,000

	US TREASURY BOND	335,000
	US TREASURY N/B	32,300,000
	US TREASURY N/B	7,310,000
	US TREASURY N/B	4,925,000
	US TREASURY N/B	600,000
	US TREASURY N/B	41,000,000
	US TREASURY N/B	27,000,000
	US TREASURY N/B	17,085,000
	US TREASURY N/B	1,105,000
	US TREASURY N/B	12,000,000
	US TREASURY N/B	29,000,000
	US TREASURY N/B	36,000,000
	US TREASURY N/B	34,000,000
	US TREASURY N/B	1,530,000
	US TREASURY N/B	25,000,000
	US TREASURY N/B	16,320,000
	US TREASURY N/B	38,000,000
	US TREASURY N/B	1,020,000
ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,100,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,400,000
	BUNDESOBLIGATION	4,250,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,600,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000
	FRANCE (GOVT OF)	1,300,000
	FRANCE (GOVT OF)	2,000,000
	FRANCE (GOVT OF)	6,200,000
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,700,000
	FRANCE (GOVT OF)	8,000,000
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,100,000
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,000,000
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,000,000
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,100,000
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,260,000

## 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	2020年 3月31日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	921,604,468	-	924,834,000	3,229,532



米ドル	464,241,576	-	467,896,000	3,654,424
ユーロ	371,103,310	-	370,574,000	529,310
英ポンド	53,143,332	-	53,324,000	180,668
豪ドル	33,116,250	-	33,040,000	76,250
売建	6,044,856,300	-	6,055,330,000	10,473,700
米ドル	3,254,055,000	-	3,264,600,000	10,545,000
ユーロ	2,389,470,600	-	2,390,800,000	1,329,400
英ポンド	401,330,700	-	399,930,000	1,400,700
合計	-	-	-	7,244,168

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## マイバランスDC70

2020年4月30日現在

資産総額	16,387,107,931円
負債総額	16,673,403円
純資産総額（ - ）	16,370,434,528円
発行済口数	11,838,107,440口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3829円

## （参考）国内株式マザーファンド

2020年4月30日現在

資産総額	462,354,456,612円
負債総額	46,027,951,853円
純資産総額（ - ）	416,326,504,759円
発行済口数	277,960,342,113口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4978円

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2020年4月30日現在

資産総額	618,930,095,729円
負債総額	1,278,020,702円
純資産総額（ - ）	617,652,075,027円
発行済口数	233,430,940,344口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6460円

## （参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

2020年4月30日現在

資産総額	683,297,879,103円
負債総額	3,199,082,396円
純資産総額（ - ）	680,098,796,707円
発行済口数	508,090,499,861口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3385円

## （参考）外国債券マザーファンド

2020年4月30日現在

資産総額	572,088,215,694円
負債総額	451,835,123円
純資産総額（ - ）	571,636,380,571円
発行済口数	241,591,314,514口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3661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、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

## (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

## (3) 受益権の譲渡

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

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

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

## (4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

## (5) 受益権の再分割

委託者は、受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

2020年4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2020年3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	1,012	26,107,360
単位型株式投資信託	178	816,726
追加型公社債投資信託	14	5,451,259
単位型公社債投資信託	453	1,632,839
合計	1,657	34,008,185

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

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

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

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

#### (1)【貸借対照表】

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

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

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



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

## (2) 【損益計算書】

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

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,031		6,538	
受取利息		4		0	
その他		362		424	
営業外収益計			4,398		6,964
営業外費用					
支払利息		2		1	
金銭の信託運用損		312		489	
時効後支払損引当金繰入額		13		43	
為替差損		46		34	
その他		31		17	
営業外費用計			405		585
經常利益			35,141		38,222
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		20	
関係会社清算益	3	-		29	
株式報酬受入益		75		85	
特別利益計			95		135
特別損失					
投資有価証券等評価損		2		938	
関係会社株式評価損		-		161	
固定資産除却損	2	58		310	
投資損失引当金繰入額		-		707	
特別損失計			60		2,118
税引前当期純利益			35,176		36,239
法人税、住民税及び事業税			10,775		10,196
法人税等調整額			439		370
当期純利益			24,840		25,672

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別 途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837

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

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

## [重要な会計方針]

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

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

## 【 未適用の会計基準等 】

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

### (1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

### (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 【 表示方法の変更に関する注記 】

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

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

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

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

#### [注記事項]

##### 貸借対照表関係

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

##### 損益計算書関係

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

##### 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

##### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

##### 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2017年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

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

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

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

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

## 金融商品関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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



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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### (1) 現金・預金

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

### (2) 金銭の信託

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

### (3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

ます。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度（自 2017年4月 1 日 至 2018年3月31日）

1．売買目的有価証券(2018年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2018年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(2018年3月31日)

該当事項はありません。

## 4．その他有価証券(2018年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

## 当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 4．その他有価証券(2019年3月31日)

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

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

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

該当事項はありません。

### 退職給付関係

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

## 当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

## 及び前払年金費用の調整表

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

## 税効果会計関係

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



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

## セグメント情報等

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 関連当事者情報

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

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

(イ) 子会社等  
該当はありません。

## (ウ) 兄弟会社等

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

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

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

## (イ) 子会社等

該当はありません。

## (ウ) 兄弟会社等

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

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

## 1株当たり情報

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

## 中間財務諸表

## 中間貸借対照表

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

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

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

## 中間損益計算書

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

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

(単位:百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

## [重要な会計方針]

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

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

#### [注記事項]

##### 中間貸借対照表関係

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

##### 中間損益計算書関係

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



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

## 中間株主資本等変動計算書関係

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

## 金融商品関係

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

有価証券関係

当中間会計期間末（2019年9月30日）

## 1．満期保有目的の債券(2019年9月30日)

該当事項はありません。

## 2．子会社株式及び関連会社株式(2019年9月30日)

該当事項はありません。

## 3．その他有価証券(2019年9月30日)

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

## セグメント情報等

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

## 1．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2．関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 1 株当たり情報

自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日
------------------------------

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

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

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

2. 1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

委託者およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託者

(a)名称	(b)資本金の額 <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。

\* 2020年3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。
株式会社北國銀行	26,673百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	

\* 2020年3月末現在

## 2【関係業務の概要】

## (1) 受託者

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

## (2) 販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱い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・償還金の支払いに関する事務等を行いません。

## 3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

## (1) 受託者

該当事項はありません。

## (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【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。

す。

- (4) 目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (5) 目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- (6) 目論見書の表紙裏等にインターネットホームページに加え、他のインターネットのアドレス(当該アドレスをコード化した図形等も含む)も掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (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ことがあります。
- (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ことがあります。

## 独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 亀井 純子指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 櫻井 雄一郎指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 津村 健二郎

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



## 独立監査人の監査報告書

2020年5月15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 亀井純子  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保  
業務執行社員

## 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」に掲げられているマイバランスDC70の2019年4月2日から2020年3月31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、マイバランスDC70の2020年3月31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。

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年11月28日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 亀井純子指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 櫻井雄一郎指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 津村健二郎

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的な手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監

査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

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