

【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】	2021年3月19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】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型
【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】	野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型 1兆円を上限とします。 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型 1兆円を上限とします。 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型 1兆円を上限とします。 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型 1兆円を上限とします。
【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】

野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型

野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型

野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型

野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型

これらを総称して「野村ターゲットデートファンド2016」または「各ファンド」という場合、あるいは個別に「ファンド」という場合があります。なお、ファンドの愛称を「未来図」とします。

ファンドの名称については、正式名称ではなく略称で記載する場合があります。

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

（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。)

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、株式等の振替に関する法律（「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】

各ファンドにつき1兆円を上限とします。

（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。

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（５）【申込手数料】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜2.0%）以内 で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

（６）【申込単位】

1万口以上1口単位(当初元本1口=1円)または1万円以上1円単位

（購入コースには、分配金を受取る一般コースと、分配金が再投資される自動けいぞく投資コースがあります。原則、購入後に購入コースの変更はできません。）

なお、販売会社や申込形態によっては、申込単位が上記と異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2021年3月20日から2022年3月18日まで

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

（８）【申込取扱場所】

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（９）【払込期日】

取得申込日から起算して7営業日目までに申込代金を申込みの販売会社にお支払いください。なお、販売

会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

各取得申込日の発行価額の総額は、各販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、「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、「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。

(1 0) 【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/>

(1 1) 【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】

該当事項はありません。

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】

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

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

信託金の限度額

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

<商品分類>

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

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

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

《商品分類表》

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

《属性区分表》

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

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

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産による区分]

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

信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

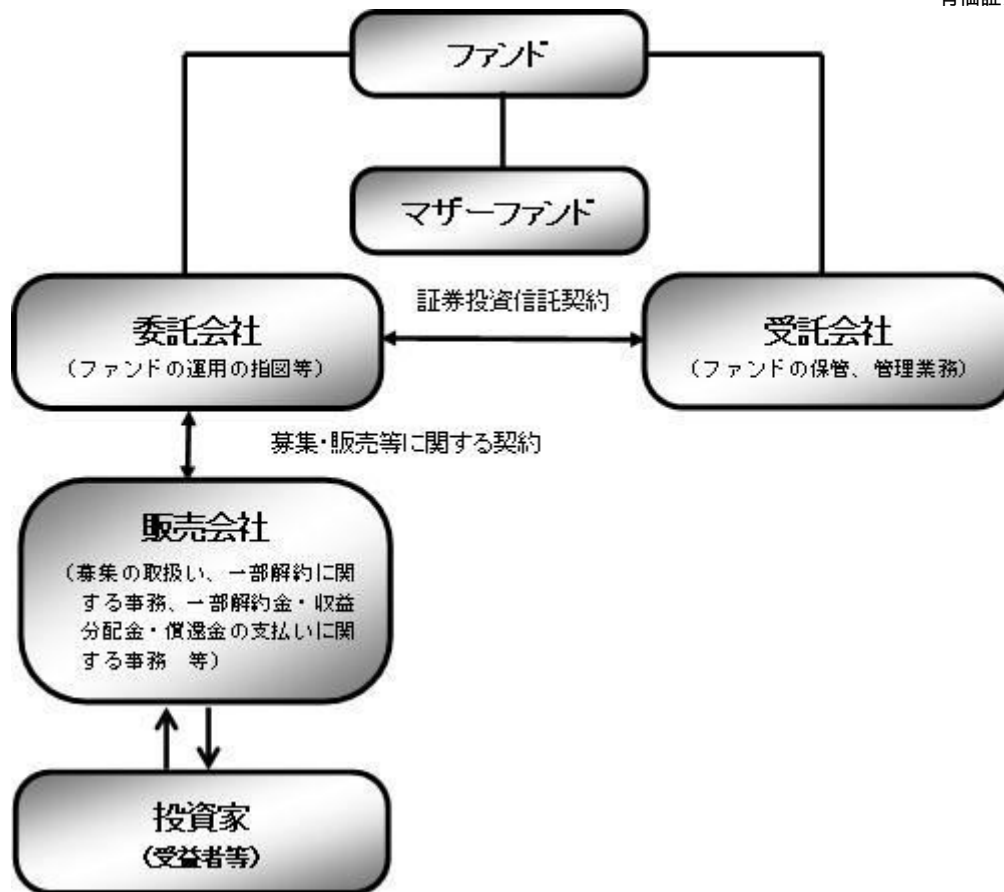
[特殊型]

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

(2) 【ファンドの沿革】

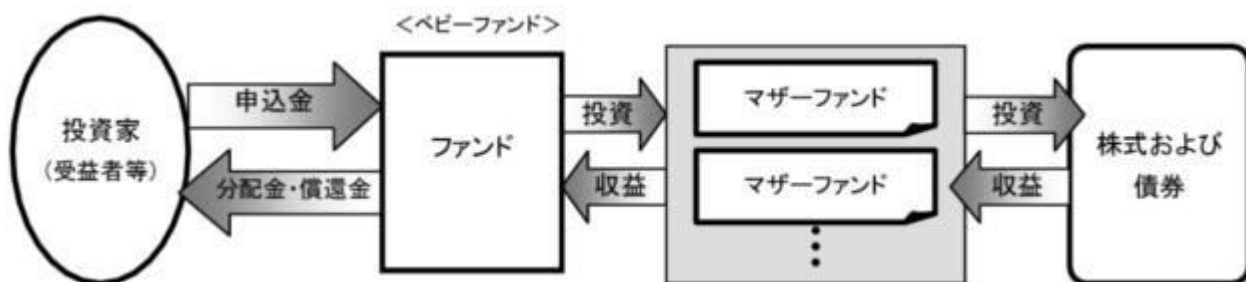
2016年4月1日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



《ファミリーファンド方式について》

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



ファンド	野村ターゲットデ トファンド2016 2026-2028年目標型	野村ターゲットデ トファンド2016 2029-2031年目標型	野村ターゲットデ トファンド2016 2032-2034年目標型	野村ターゲットデ トファンド2016 2035-2037年目標型
マザーファンド (親投資信託)	国内株式マザーファンド			
	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド			
	新興国株式マザーファンド			
	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド			
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド			
	外国債券マザーファンド			
	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド			
委託会社(委託者)	野村アセットマネジメント株式会社			

受託会社(受託者)

野村信託銀行株式会社

委託会社の概況(2021年1月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋1-13-1	5,150,693株	100%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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

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

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

当面の株式・債券配分は「株式・債券配分のイメージ図」をご覧ください。

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

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

ファンド名	投資基礎期	資産形成期	目標前準備期
-------	-------	-------	--------

2026-2028年目標型	当初設定日から 2017年12月	2018年1月から 2022年12月	2023年1月以降
2029-2031年目標型	当初設定日から 2018年12月	2019年1月から 2025年12月	2026年1月以降
2032-2034年目標型	当初設定日から 2019年12月	2020年1月から 2028年12月	2029年1月以降
2035-2037年目標型	当初設定日から 2020年12月	2021年1月から 2031年12月	2032年1月以降

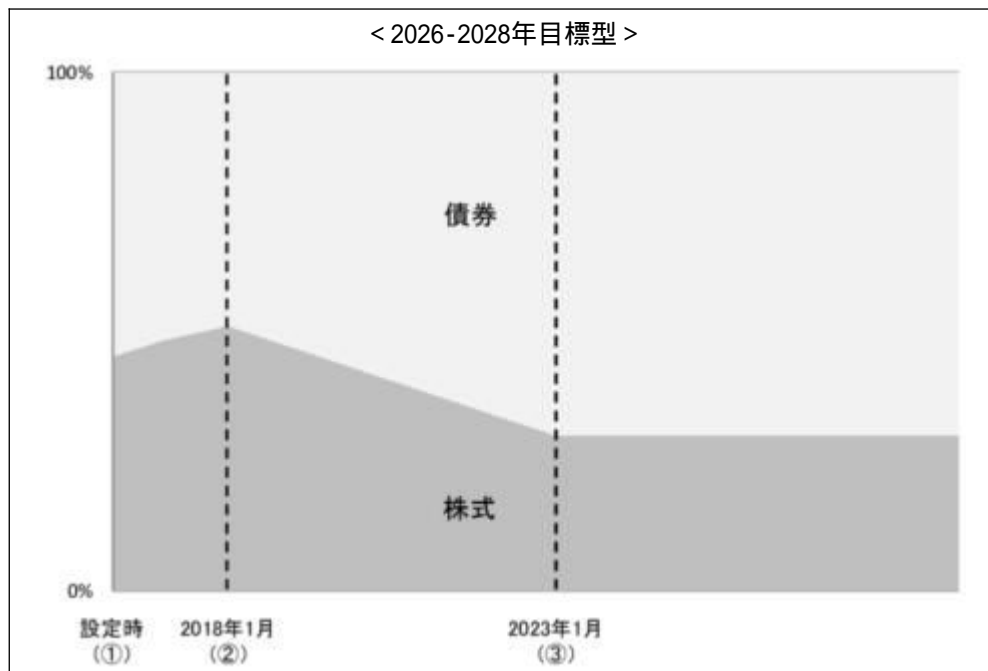
「投資基礎期」は、株式への実質投資割合を徐々に増やし、債券への実質投資割合を徐々に減らすことを基本とし、株式・債券配分を定期的に変化させます。

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

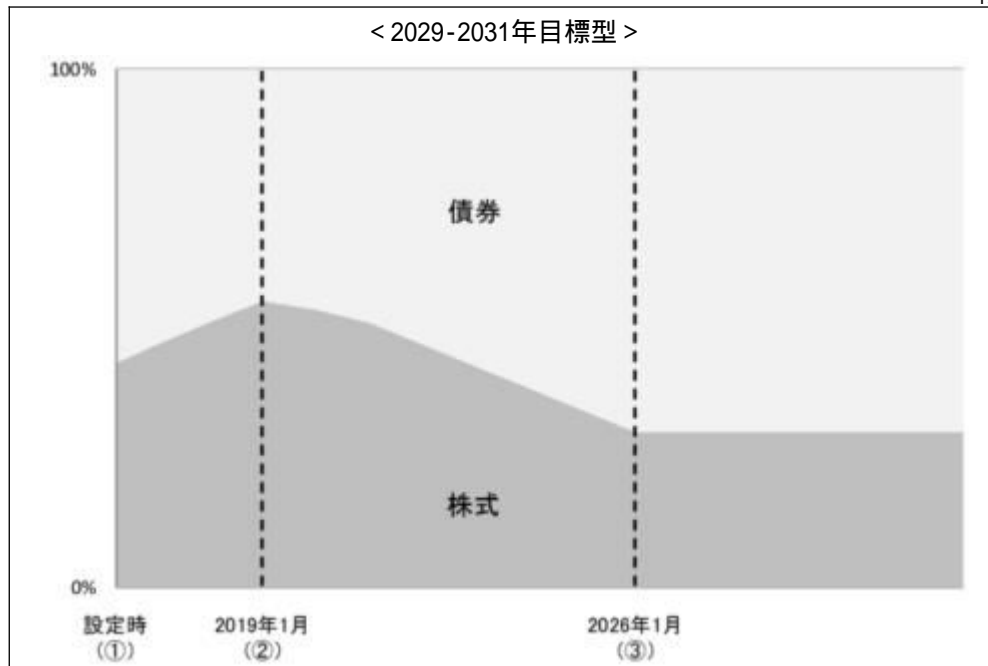
「目標前準備期」は、株式・債券配分を一定とすることを基本とします。

・期間中は、安定運用を行なう場合があります。

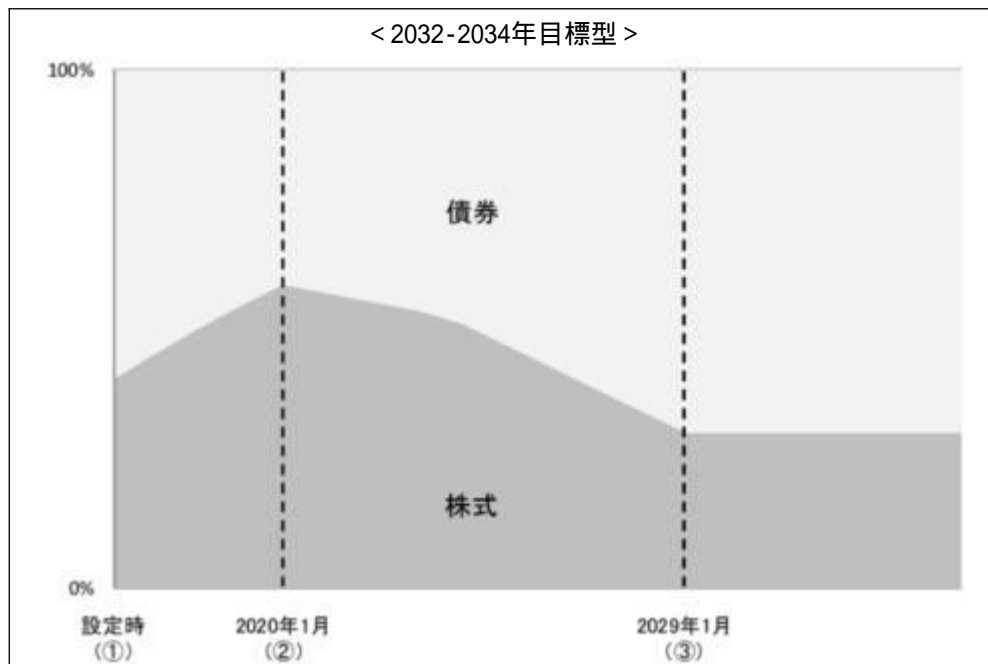
株式・債券配分のイメージ図



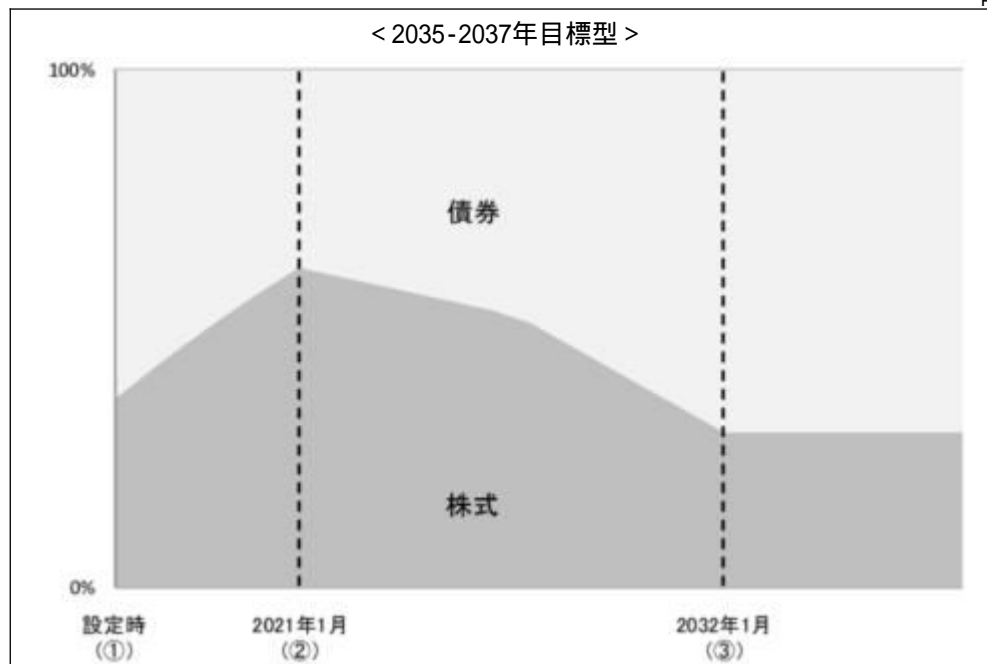
投資基礎期開始日	資産形成期開始日	目標前準備期開始日
株式45.2%	株式51.1%	株式30.0%
債券54.8%	債券48.9%	債券70.0%



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



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



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

各マザーファンドへの基本投資割合

		2026-2028年 目標型		2029-2031年 目標型		2032-2034年 目標型		2035-2037年 目標型		各ファンド 共通 目標前 準備期 開始日
		2021年 3月	資産 形成期 開始日	2021年 3月	資産 形成期 開始日	2021年 3月	資産 形成期 開始日	2021年 3月	資産 形成期 開始日	
株式	国内株式マザーファンド	18.9%	25.5%	25.2%	27.6%	28.3%	29.2%	30.8%	30.9%	15.0%
	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	10.8%	15.4%	14.5%	16.6%	16.3%	17.6%	17.7%	18.6%	9.0%
	新興国株式マザーファンド	8.0%	10.2%	10.7%	11.0%	12.0%	11.7%	13.1%	12.3%	6.0%
債券	国内債券NOMURA-BPI 総合 マザーファンド	24.2%	17.0%	17.3%	14.9%	14.2%	13.2%	11.7%	11.6%	30.0%
	外国債券為替ヘッジ型 マザーファンド	24.2%	17.0%	17.3%	14.9%	14.2%	13.2%	11.7%	11.6%	30.0%
	外国債券マザーファンド	9.0%	12.2%	9.7%	12.3%	9.7%	12.3%	9.7%	12.3%	8.2%
	新興国債券（現地通貨建て） マザーファンド	4.9%	2.7%	5.3%	2.7%	5.3%	2.8%	5.3%	2.7%	1.8%

上記の株式・債券配分および各マザーファンドへの基本投資割合は、2021年3月現在のものであり、家計や市場の構造変化等により変更する場合があります。

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

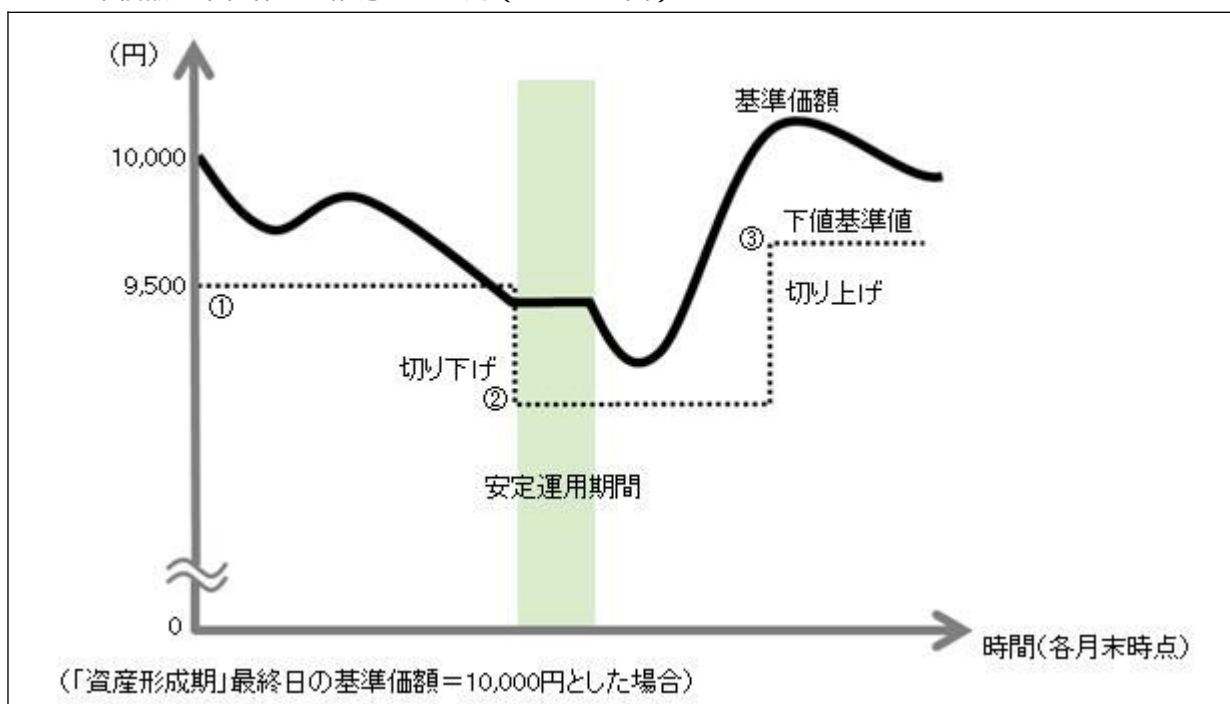
ます。

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

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

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

基準価額と下値保全に配慮した運用（イメージ図）



<ご参考例>

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

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

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

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

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

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

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

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

《マザーファンドの概要》

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

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

*2 MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

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

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

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

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

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

各マザーファンドの投資方針等について

〔国内株式マザーファンド〕

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

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

〔外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド〕

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

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

[新興国株式マザーファンド]

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

[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]

- ・主としてわが国の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指します。
NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。

[外国債券為替ヘッジ型マザーファンド]

- ・主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いません。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

[外国債券マザーファンド]

- ・主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

[新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]

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

・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

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

各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について

東証株価指数（TOPIX）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

NOMURA-BPI総合

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

「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)」

「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」

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

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

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

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

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

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

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

別に定めるマザーファンドと、主要投資対象は以下の通りです。

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

投資の対象とする資産の種類（信託約款）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、下記「（５）投資制限、及び」に定めるものに限り、）に係る権利
 - ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形
 - ロ．次に掲げるものをすべてみだす資産
 - ・リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティー・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するもの
 - ・流動性に考慮し、時価の取得が可能なもの
 - ・前号または本号イに掲げるものに該当しないもの

有価証券の指図範囲等（信託約款）

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

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券

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

金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

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

その他の投資対象

1. 先物取引等
2. スワップ取引
3. 金利先渡取引

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

4. 為替先渡取引

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

5. 直物為替先渡取引

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

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

(参考)各マザーファンドの概要

「国内株式マザーファンド」

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

「新興国株式マザーファンド」

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

2.運用方法

(1)投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

効率的な運用を行なうため、債券先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用を含め活用する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

「外国債券マザーファンド」

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

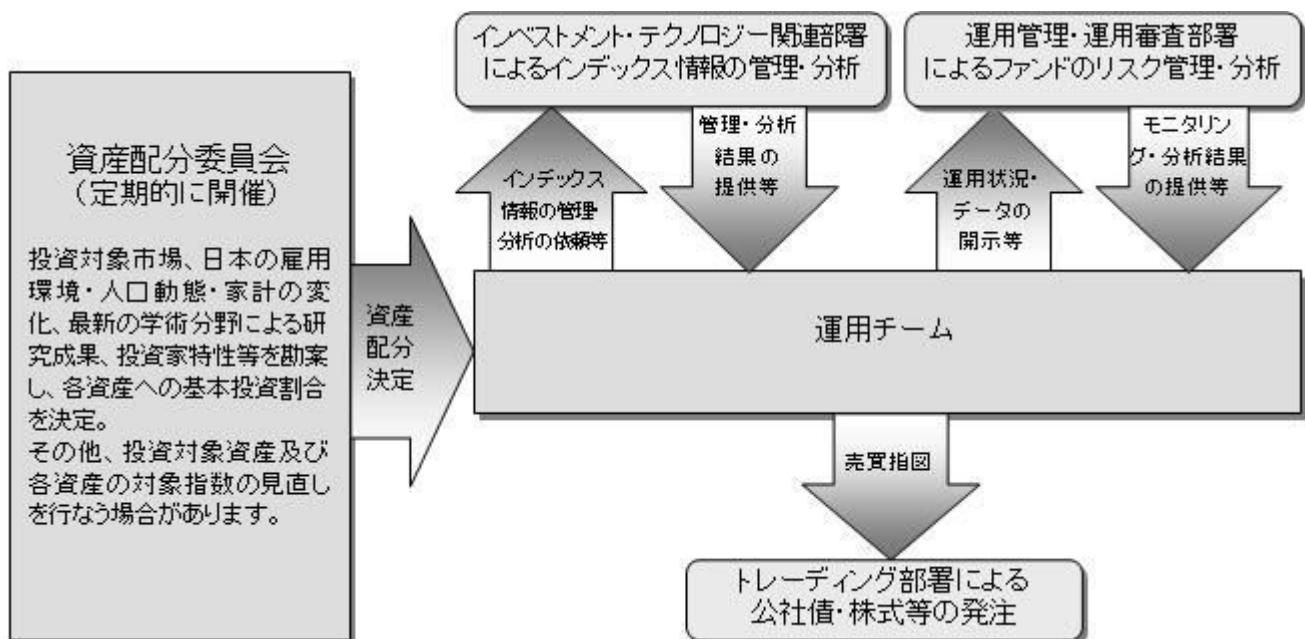
一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をい

ます。)の利用は行ないません。

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

(3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。

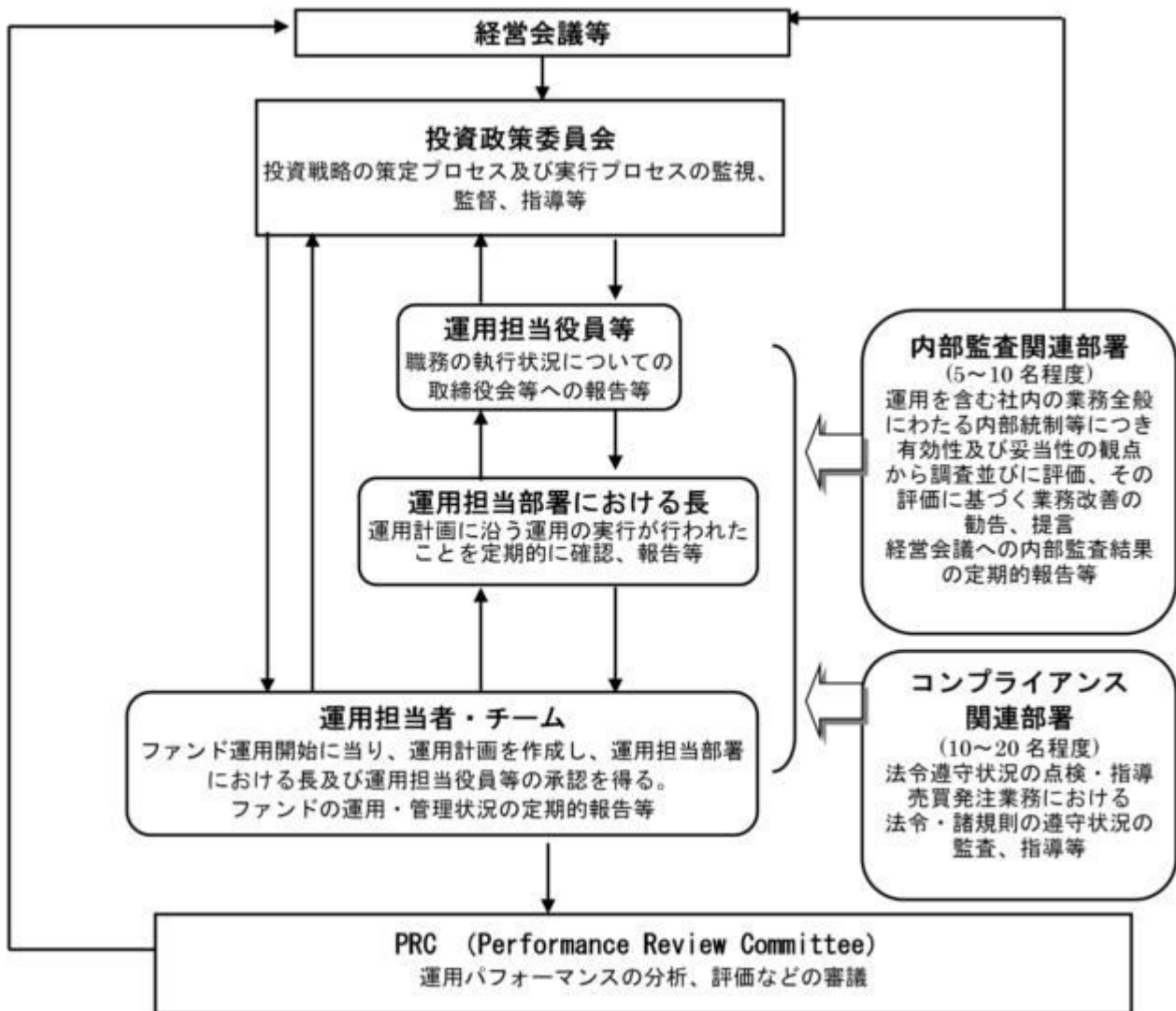


運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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

す。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

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

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

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

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

ファンドの決算日

原則として**毎年12月26日**(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

(5) 【投資制限】

運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限 (信託約款)

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

投資する株式等の範囲(信託約款)

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

信用取引の指図範囲(信託約款)

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

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

先物取引等の運用指図(信託約款)

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

スワップ取引の運用指図(信託約款)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

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

公社債の借入れ(信託約款)

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

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

直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

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

資金の借入れ(信託約款)

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

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

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

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

3【投資リスク】

基準価額の変動要因

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

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

[株価変動リスク]

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

[債券価格変動リスク]

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

[為替変動リスク]

ファンドは、実質組入外貨建資産について、為替ヘッジを行なうマザーファンドを通じて投資する部

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

す。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

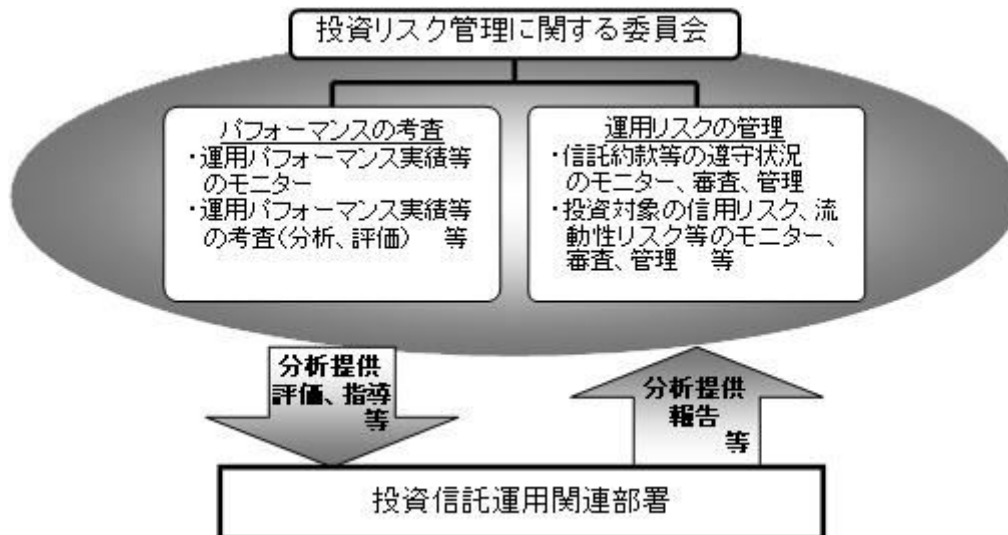
パフォーマンスの考査

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

運用リスクの管理

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

リスク管理体制図



投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

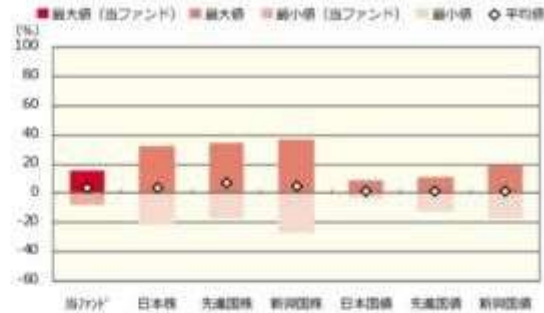
■ リスクの定量的比較 (2016年2月末～2021年1月末：月次)

2026-2028年目標型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	15.0	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 8.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	3.9	3.7	7.1	5.3	1.4	1.0	1.1

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2017年4月から2021年1月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

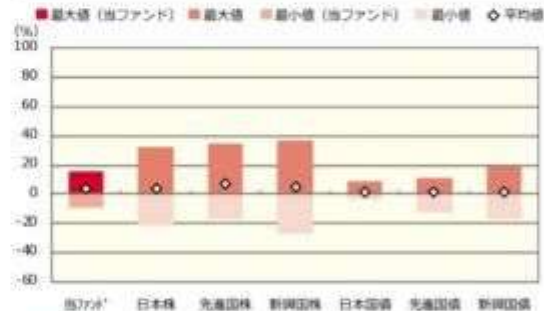
- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2016年2月から2021年1月の5年間（当ファンドは2017年4月から2021年1月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
- * 当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

2029-2031年目標型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



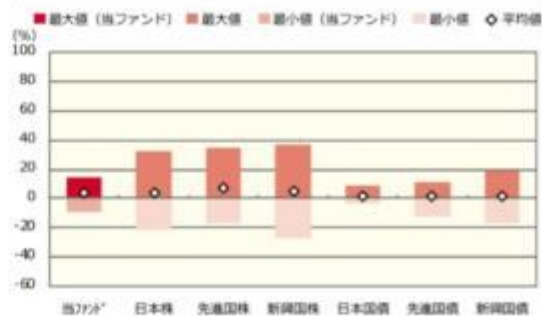
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	15.0	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 9.4	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	3.9	3.7	7.1	5.3	1.4	1.0	1.1

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2017年4月から2021年1月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2016年2月から2021年1月の5年間（当ファンドは2017年4月から2021年1月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
- * 当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

2032-2034年目標型**ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移**

2016年2月 2017年1月 2018年1月 2019年1月 2020年1月 2021年1月

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較

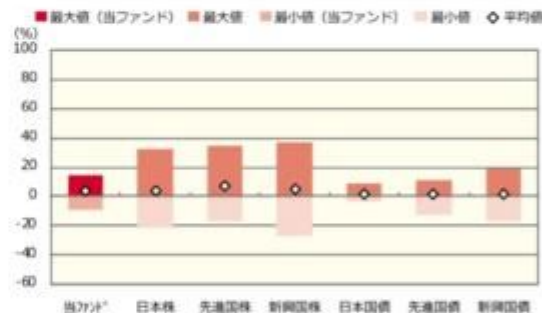
	当ファンド*	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	14.8	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 9.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	3.8	3.7	7.1	5.3	1.4	1.0	1.1

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2017年4月から2021年1月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載していません。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2016年2月から2021年1月の5年間（当ファンドは2017年4月から2021年1月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
- * 当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載していません。

2035-2037年目標型**ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移**

2016年2月 2017年1月 2018年1月 2019年1月 2020年1月 2021年1月

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較

	当ファンド*	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	14.4	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 9.1	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	3.8	3.7	7.1	5.3	1.4	1.0	1.1

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2017年4月から2021年1月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載していません。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2016年2月から2021年1月の5年間（当ファンドは2017年4月から2021年1月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
- * 当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載していません。

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

<p><代表的な資産クラスの指数></p> <ul style="list-style-type: none"> ○日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み） ○先進国株：MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース） ○新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース） ○日本国債：NOMURA-BPI 国債 ○先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） ○新興国債：JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）
<p style="text-align: center;">■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■</p> <ul style="list-style-type: none"> ○東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（旧東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、旧東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、旧東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、旧東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。 ○MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。 ○NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。 ○FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。 ○JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（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・ディバースファイド（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たり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。 <p>米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての推奨、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。</p> <p>JPMSLLC は 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。</p>

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

4 【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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

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

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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

（2）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

（3）【信託報酬等】

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

信託報酬率の配分については次の通り（税抜）とします。

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

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

支払先の役務の内容

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額 をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を1口当たりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

なお、配当控除は適用されません。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

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

損益通算について

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

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 ^(注2)	《配当所得》
<ul style="list-style-type: none"> ・ 特定公社債^(注1)の利子 ・ 公募公社債投資信託の収益分配金 	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の <ul style="list-style-type: none"> ・ 譲渡益 ・ 譲渡損 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 上場株式の配当 ・ 公募株式投資信託の収益分配金

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

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

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

法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

〔個人の投資家の場合〕

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

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

〔法人の投資家の場合〕

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

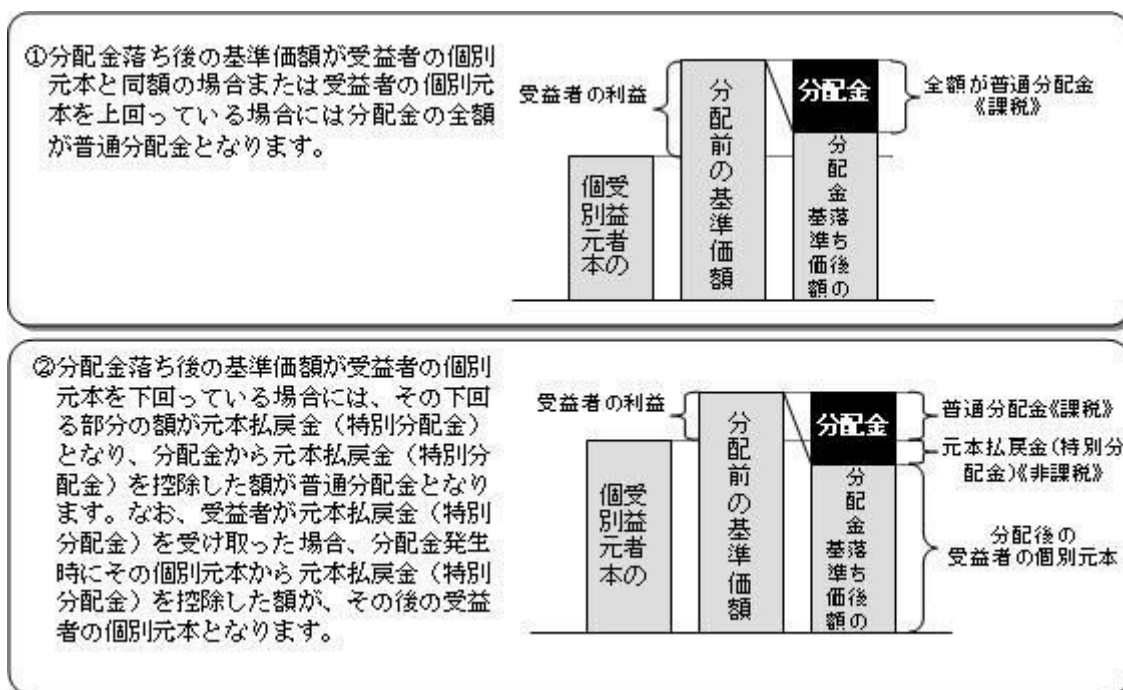
個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

分配金の課税について

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



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

- * 外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- * 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2021年1月末現在）が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は2021年1月29日現在の運用状況であります。

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

(1)【投資状況】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	133,412,358	99.89
現金・預金・その他資産(負債控除後)		135,995	0.10
合計(純資産総額)		133,548,353	100.00

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	51,356,223	99.89
現金・預金・その他資産(負債控除後)		52,016	0.10
合計(純資産総額)		51,408,239	100.00

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	33,742,067	99.89
現金・預金・その他資産(負債控除後)		34,140	0.10
合計(純資産総額)		33,776,207	100.00

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	23,780,778	99.89
現金・預金・その他資産(負債控除後)		24,001	0.10
合計(純資産総額)		23,804,779	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	423,653,523,800	98.00

現金・預金・その他資産(負債控除後)		8,628,455,813	1.99
合計(純資産総額)		432,281,979,613	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	8,623,120,000	1.99

(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	565,846,290,031	69.07
	カナダ	26,973,550,138	3.29
	ドイツ	24,862,738,588	3.03
	イタリア	6,026,314,775	0.73
	フランス	27,938,472,527	3.41
	オランダ	11,363,106,256	1.38
	スペイン	6,367,718,365	0.77
	ベルギー	2,389,481,028	0.29
	オーストリア	473,741,591	0.05
	ルクセンブルグ	350,153,050	0.04
	フィンランド	2,879,140,002	0.35
	アイルランド	1,833,409,053	0.22
	ポルトガル	465,845,824	0.05
	イギリス	37,699,283,268	4.60
	スイス	25,928,994,284	3.16
	スウェーデン	9,240,160,250	1.12
	ノルウェー	1,562,189,826	0.19
	デンマーク	6,615,235,862	0.80
	オーストラリア	17,772,671,260	2.16
	ニュージーランド	818,004,067	0.09
香港	8,126,486,714	0.99	
シンガポール	2,423,120,007	0.29	
イスラエル	871,009,178	0.10	
小計		788,827,115,944	96.29
投資証券	アメリカ	14,659,565,845	1.78
	カナダ	93,848,614	0.01
	フランス	455,932,068	0.05
	イギリス	449,492,849	0.05
	オーストラリア	1,266,127,262	0.15

	香港	352,671,174	0.04
	シンガポール	412,075,633	0.05
	小計	17,689,713,445	2.15
現金・預金・その他資産（負債控除後）		12,666,951,988	1.54
合計（純資産総額）		819,183,781,377	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	9,121,174,524	1.11
	買建	カナダ	424,118,225	0.05
	買建	ドイツ	1,341,765,605	0.16
	買建	イギリス	603,233,769	0.07
	買建	スイス	405,030,320	0.04
	買建	オーストラリア	290,249,960	0.03

（参考）新興国株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	9,681,003,011	16.14
	メキシコ	925,363,291	1.54
	ブラジル	2,712,942,449	4.52
	チリ	117,908,188	0.19
	コロンビア	46,532,267	0.07
	ギリシャ	55,224,747	0.09
	イギリス	34,474,287	0.05
	トルコ	206,647,379	0.34
	チェコ	52,546,840	0.08
	ハンガリー	123,531,705	0.20
	ポーランド	375,978,781	0.62
	香港	12,676,660,867	21.14
	マレーシア	813,040,768	1.35
	タイ	1,010,644,905	1.68
	フィリピン	397,648,585	0.66
	インドネシア	760,568,615	1.26
	韓国	7,792,714,080	12.99
	台湾	7,710,290,260	12.85
	インド	5,106,905,938	8.51
	パキスタン	11,308,203	0.01
カタール	389,750,480	0.65	

	エジプト	46,250,510	0.07
	南アフリカ	1,974,364,385	3.29
	アラブ首長国連邦	328,864,018	0.54
	クウェート	280,650,130	0.46
	サウジアラビア	1,378,857,474	2.29
	小計	55,010,672,163	91.74
投資信託受益証券	アメリカ	2,245,912,528	3.74
投資証券	メキシコ	24,435,102	0.04
	南アフリカ	16,044,916	0.02
	小計	40,480,018	0.06
現金・預金・その他資産（負債控除後）		2,660,821,365	4.43
合計（純資産総額）		59,957,886,074	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	2,148,125,506	3.58
	買建	シンガポール	460,169,100	0.76

（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	567,657,093,570	79.62
地方債証券	日本	48,999,677,490	6.87
特殊債券	日本	61,768,921,311	8.66
社債券	日本	28,585,829,300	4.00
現金・預金・その他資産（負債控除後）		5,914,934,063	0.82
合計（純資産総額）		712,926,455,734	100.00

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	32,858,990,097	42.11
	カナダ	1,441,786,314	1.84
	メキシコ	620,992,062	0.79
	ドイツ	5,535,555,273	7.09
	イタリア	8,133,024,881	10.42
	フランス	7,798,718,581	9.99
	オランダ	1,421,621,617	1.82

	スペイン	5,413,289,642	6.93
	ベルギー	2,151,929,086	2.75
	オーストリア	1,227,782,826	1.57
	フィンランド	419,002,715	0.53
	アイルランド	724,426,981	0.92
	イギリス	5,351,481,963	6.85
	スウェーデン	209,593,231	0.26
	ノルウェー	148,431,451	0.19
	デンマーク	411,132,794	0.52
	ポーランド	478,694,782	0.61
	オーストラリア	2,084,137,581	2.67
	シンガポール	662,640,036	0.84
	イスラエル	286,498,473	0.36
	小計	77,379,730,386	99.17
現金・預金・その他資産（負債控除後）		645,592,630	0.82
合計（純資産総額）		78,025,323,016	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	248,517,947,589	42.55
	カナダ	11,442,654,457	1.95
	メキシコ	4,681,032,875	0.80
	ドイツ	40,338,673,538	6.90
	イタリア	57,870,409,294	9.90
	フランス	58,834,557,761	10.07
	オランダ	9,475,604,583	1.62
	スペイン	38,526,098,072	6.59
	ベルギー	14,225,281,061	2.43
	オーストリア	8,892,527,603	1.52
	フィンランド	2,722,013,530	0.46
	アイルランド	7,788,380,076	1.33
	イギリス	39,954,414,648	6.84
	スウェーデン	1,946,249,741	0.33
	ノルウェー	1,278,069,533	0.21
	デンマーク	2,980,984,391	0.51
	ポーランド	3,621,102,743	0.62
	オーストラリア	15,908,748,303	2.72
	シンガポール	2,527,014,215	0.43
	マレーシア	2,829,121,945	0.48
イスラエル	2,603,480,589	0.44	

	小計	576,964,366,547	98.79
現金・預金・その他資産（負債控除後）		7,058,496,810	1.20
合計（純資産総額）		584,022,863,357	100.00

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	メキシコ	819,596,450	9.18
	ブラジル	715,077,359	8.01
	チリ	245,115,598	2.74
	コロンビア	464,864,965	5.21
	ペルー	240,040,102	2.69
	ウルグアイ	10,471,614	0.11
	ドミニカ共和国	15,488,678	0.17
	トルコ	167,213,023	1.87
	チェコ	341,223,362	3.82
	ハンガリー	354,304,278	3.97
	ポーランド	721,835,054	8.09
	ロシア	625,149,852	7.00
	ルーマニア	268,102,862	3.00
	マレーシア	600,384,573	6.73
	タイ	761,441,715	8.53
	フィリピン	28,128,075	0.31
	インドネシア	837,090,003	9.38
	南アフリカ	636,503,213	7.13
中国	885,794,231	9.93	
	小計	8,737,825,007	97.95
現金・預金・その他資産（負債控除後）		182,528,446	2.04
合計（純資産総額）		8,920,353,453	100.00

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （%）
1	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA - BPI総 合マザーファンド	23,613,048	1.3302	31,410,077	1.3266	31,325,069	23.45
2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	24,979,829	1.2557	31,368,637	1.2498	31,219,790	23.37

3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	13,621,170	1.8484	25,177,371	1.8723	25,502,916	19.09
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	4,386,243	3.3344	14,625,489	3.4249	15,022,443	11.24
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	4,857,187	2.4754	12,023,943	2.4792	12,041,938	9.01
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	7,391,778	1.4585	10,780,909	1.5843	11,710,793	8.76
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マ ザーファンド	4,776,665	1.3848	6,614,726	1.3795	6,589,409	4.93

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	99.89
合計	99.89

野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	6,912,125	1.8486	12,777,755	1.8723	12,941,571	25.17
2	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA-BPI総 合マザーファンド	6,497,067	1.3302	8,642,399	1.3266	8,619,009	16.76
3	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	6,873,174	1.2556	8,630,501	1.2498	8,590,092	16.70
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	2,228,188	3.3345	7,429,893	3.4249	7,631,321	14.84
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	3,769,002	1.4590	5,498,974	1.5843	5,971,229	11.61
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,986,015	2.4754	4,916,342	2.4792	4,923,728	9.57
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マ ザーファンド	1,942,206	1.3848	2,689,567	1.3795	2,679,273	5.21

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	99.89
合計	99.89

野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	5,051,869	1.8496	9,343,937	1.8723	9,458,614	28.00
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	1,630,670	3.3354	5,438,937	3.4249	5,584,881	16.53

3	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA - B P I 総 合 マザーファンド	3,534,885	1.3301	4,701,751	1.3266	4,689,378	13.88
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	3,739,496	1.2555	4,695,244	1.2498	4,673,622	13.83
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	2,744,561	1.4598	4,006,511	1.5843	4,348,207	12.87
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,302,771	2.4752	3,224,728	2.4792	3,229,829	9.56
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マ ザーファンド	1,274,039	1.3848	1,764,290	1.3795	1,757,536	5.20

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	99.89
合 計	99.89

野村ターゲットデットファンド2016 2035 - 2037年目標型

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	3,882,393	1.8486	7,176,992	1.8723	7,269,004	30.53
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	1,245,712	3.3346	4,153,952	3.4249	4,266,439	17.92
3	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	2,091,386	1.4591	3,051,542	1.5843	3,313,382	13.91
4	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA - B P I 総 合 マザーファンド	2,046,866	1.3303	2,722,946	1.3266	2,715,372	11.40
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	2,165,351	1.2557	2,719,095	1.2498	2,706,255	11.36
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	916,948	2.4755	2,269,914	2.4792	2,273,297	9.54
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マ ザーファンド	896,723	1.3848	1,241,783	1.3795	1,237,029	5.19

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	99.89
合 計	99.89

(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	1,734,200	6,660.02	11,549,806,684	7,300.00	12,659,660,000	2.92
2	日本	株式	ソフトバンクグルー プ	情報・通 信業	1,332,800	4,764.18	6,349,703,194	8,108.00	10,806,342,400	2.49
3	日本	株式	ソニー	電気機器	1,072,300	7,121.85	7,636,768,740	10,050.00	10,776,615,000	2.49

4	日本	株式	キーエンス	電気機器	168,000	41,631.82	6,994,146,329	56,140.00	9,431,520,000	2.18
5	日本	株式	任天堂	その他製品	98,000	43,774.54	4,289,904,920	60,580.00	5,936,840,000	1.37
6	日本	株式	日本電産	電気機器	412,000	6,409.60	2,640,758,714	13,850.00	5,706,200,000	1.32
7	日本	株式	信越化学工業	化学	310,000	12,708.70	3,939,699,533	18,175.00	5,634,250,000	1.30
8	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,549,500	424.54	4,903,256,782	469.30	5,420,180,350	1.25
9	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,171,800	3,337.68	3,911,101,920	4,542.00	5,322,315,600	1.23
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,424,300	3,763.46	5,360,298,485	3,698.00	5,267,061,400	1.21
11	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,964,700	2,420.41	4,755,379,527	2,618.00	5,143,584,600	1.18
12	日本	株式	村田製作所	電気機器	502,800	6,130.01	3,082,173,108	10,055.00	5,055,654,000	1.16
13	日本	株式	第一三共	医薬品	1,469,600	2,569.66	3,776,380,320	3,365.00	4,945,204,000	1.14
14	日本	株式	ダイキン工業	機械	218,100	14,261.11	3,110,348,996	22,105.00	4,821,100,500	1.11
15	日本	株式	HOYA	精密機器	339,600	9,806.20	3,330,187,888	13,395.00	4,548,942,000	1.05
16	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,347,100	3,162.25	4,259,874,198	3,079.00	4,147,720,900	0.95
17	日本	株式	ファナック	電気機器	150,200	17,890.40	2,687,138,080	27,365.00	4,110,223,000	0.95
18	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	100,300	22,847.58	2,291,612,274	39,810.00	3,992,943,000	0.92
19	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,168,400	2,825.43	3,301,234,325	3,245.00	3,791,458,000	0.87
20	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,347,800	2,618.43	3,529,132,926	2,764.50	3,725,993,100	0.86
21	日本	株式	日立製作所	電気機器	823,000	3,288.09	2,706,099,276	4,306.00	3,543,838,000	0.81
22	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,179,300	2,250.48	2,654,002,162	2,997.50	3,534,951,750	0.81
23	日本	株式	SMC	機械	50,100	51,254.31	2,567,840,931	63,360.00	3,174,336,000	0.73
24	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,294,200	1,236.92	2,837,749,711	1,378.50	3,162,554,700	0.73
25	日本	株式	花王	化学	409,900	8,432.46	3,456,468,710	7,597.00	3,114,010,300	0.72
26	日本	株式	中外製薬	医薬品	535,400	4,269.30	2,285,785,232	5,472.00	2,929,708,800	0.67
27	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	559,600	4,513.32	2,525,653,872	5,133.00	2,872,426,800	0.66
28	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	174,000	14,317.72	2,491,283,846	16,350.00	2,844,900,000	0.65
29	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,711,800	1,366.76	2,339,627,536	1,594.50	2,729,465,100	0.63
30	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,026,500	2,415.57	2,479,582,605	2,647.50	2,717,658,750	0.62

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.14
		建設業	2.24
		食料品	3.50
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.50
		医薬品	5.89
		石油・石炭製品	0.40
		ゴム製品	0.55
		ガラス・土石製品	0.77

鉄鋼	0.59
非鉄金属	0.72
金属製品	0.58
機械	5.65
電気機器	17.76
輸送用機器	6.64
精密機器	2.63
その他製品	2.45
電気・ガス業	1.32
陸運業	3.37
海運業	0.17
空運業	0.39
倉庫・運輸関連業	0.16
情報・通信業	9.07
卸売業	4.45
小売業	4.65
銀行業	4.48
証券、商品先物取引業	0.73
保険業	1.81
その他金融業	1.09
不動産業	1.85
サービス業	5.49
合 計	98.00

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	2,768,000	7,065.98	19,558,639,284	14,323.16	39,646,515,738	4.83
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,163,500	17,181.73	19,990,949,836	24,963.40	29,044,923,346	3.54
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	68,900	215,665.52	14,859,354,769	338,266.53	23,306,564,441	2.84

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	388,900	18,258.92	7,100,895,855	27,687.20	10,767,552,080	1.31
5	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	120,630	13,676.43	1,649,787,993	87,285.72	10,529,277,176	1.28
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	48,560	123,871.48	6,015,199,457	194,657.73	9,452,579,505	1.15
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	48,600	123,812.97	6,017,310,789	193,622.33	9,410,045,530	1.14
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	425,700	13,981.51	5,951,930,340	17,673.83	7,523,752,326	0.91
9	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	492,700	9,827.38	4,841,954,462	13,593.89	6,697,710,983	0.81
10	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	272,600	17,549.50	4,783,995,227	20,710.02	5,645,552,979	0.68
11	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	465,700	11,795.99	5,493,395,337	12,070.92	5,621,428,655	0.68
12	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	402,500	12,219.98	4,918,542,272	13,620.01	5,482,055,152	0.66
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	226,500	19,353.87	4,383,652,733	24,129.65	5,465,367,084	0.66
14	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	99,740	30,515.47	3,043,613,337	54,542.73	5,440,092,808	0.66
15	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	153,600	26,929.72	4,136,404,992	35,329.91	5,426,674,483	0.66
16	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	292,100	10,639.19	3,107,709,853	17,958.02	5,245,538,343	0.64
17	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	174,000	21,159.28	3,681,716,390	29,050.66	5,054,815,536	0.61
18	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	144,400	26,985.09	3,896,647,631	33,880.77	4,892,383,823	0.59
19	アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	情報技術サービス	180,300	10,989.20	1,981,353,914	24,844.29	4,479,427,146	0.54
20	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	114,100	36,369.02	4,149,706,266	37,250.20	4,250,248,333	0.51

21	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	686,900	5,729.68	3,935,719,390	5,857.67	4,023,634,347	0.49
22	アメリカ	株式	NETFLIX INC	娯楽	71,250	39,847.62	2,839,143,438	56,272.92	4,009,446,120	0.48
23	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,260,000	2,320.50	2,923,831,008	3,167.83	3,991,470,336	0.48
24	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	736,500	3,776.95	2,781,725,148	5,391.16	3,970,595,232	0.48
25	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	68,910	31,832.48	2,193,576,638	56,789.51	3,913,365,823	0.47
26	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	668,600	5,749.53	3,844,138,699	5,785.05	3,867,889,511	0.47
27	アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア	77,500	34,671.68	2,687,055,820	48,653.20	3,770,623,124	0.46
28	アメリカ	株式	ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア機器・用品	287,600	8,547.50	2,458,263,531	12,578.34	3,617,532,655	0.44
29	アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア	147,800	17,264.27	2,551,659,875	23,664.72	3,497,645,616	0.42
30	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品	358,600	9,137.19	3,276,598,952	9,731.69	3,489,786,437	0.42

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	4.09
		メディア	1.16
		娯楽	1.61
		不動産管理・開発	0.42
		エネルギー設備・サービス	0.13
		石油・ガス・消耗燃料	2.88
		化学	2.16
		建設資材	0.25
		容器・包装	0.28
		金属・鉱業	1.55
		紙製品・林産品	0.10
		航空宇宙・防衛	1.37
		建設関連製品	0.55
		建設・土木	0.25
電気設備	0.89		

コングロマリット	1.18
機械	1.70
商社・流通業	0.28
商業サービス・用品	0.40
航空貨物・物流サービス	0.60
旅客航空輸送業	0.05
海運業	0.06
陸運・鉄道	1.04
運送インフラ	0.14
自動車部品	0.27
自動車	1.94
家庭用耐久財	0.36
レジャー用品	0.08
繊維・アパレル・贅沢品	1.44
ホテル・レストラン・レジャー	1.49
販売	0.08
インターネット販売・通信販売	3.69
複合小売り	0.51
専門小売り	1.63
食品・生活必需品小売り	1.40
飲料	1.64
食品	1.65
タバコ	0.66
家庭用品	1.22
パーソナル用品	0.64
ヘルスケア機器・用品	3.11
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.90
バイオテクノロジー	1.86
医薬品	4.95
銀行	5.52
各種金融サービス	0.91
保険	3.01
情報技術サービス	4.51
ソフトウェア	7.31
通信機器	0.66
コンピュータ・周辺機器	5.11

	電子装置・機器・部品	0.54
	半導体・半導体製造装置	4.43
	各種電気通信サービス	1.51
	無線通信サービス	0.28
	電力	1.96
	ガス	0.14
	総合公益事業	0.86
	水道	0.11
	消費者金融	0.39
	資本市場	2.96
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10
	ヘルスケア・テクノロジー	0.18
	ライフサイエンス・ツール/サービス	1.07
	専門サービス	0.69
	その他の業種	0.00
投資証券		2.15
合 計		98.45

(参考) 新興国株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半 導体製造装 置	1,666,000	1,185.42	1,974,917,147	2,241.73	3,734,722,180	6.22
2	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	388,800	5,906.88	2,296,595,131	9,179.88	3,569,137,344	5.95
3	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インター ネット販 売・通信販 売	128,290	21,926.97	2,813,012,217	27,244.20	3,495,159,034	5.82
4	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュ ータ・周辺機 器	323,640	4,779.20	1,546,740,324	7,842.69	2,538,208,192	4.23

5	アメリカ	投資信託受益証券	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF		515,000	2,986.03	1,537,809,776	4,360.99	2,245,912,528	3.74
6	香港	株式	MEITUAN-CLASS B	インター ネット販 売・通信販 売	244,700	2,009.03	491,610,480	4,793.48	1,172,966,514	1.95
7	南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インター ネット販 売・通信販 売	29,680	20,766.13	616,339,032	24,162.56	717,144,781	1.19
8	アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	インター ネット販 売・通信販 売	59,020	5,550.75	327,605,733	9,550.51	563,671,502	0.94
9	アメリカ	株式	NIO INC ADR	自動車	87,600	1,700.42	148,957,199	6,098.49	534,228,390	0.89
10	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	6,566,000	82.74	543,297,423	80.74	530,172,983	0.88
11	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガ ス・消耗燃 料	189,900	2,301.52	437,059,788	2,702.23	513,153,857	0.85
12	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	403,000	1,076.46	433,816,334	1,259.03	507,389,896	0.84
13	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	18,280	11,159.87	204,002,435	25,584.01	467,675,842	0.78
14	アメリカ	株式	PINDUODUO INC ADR	インター ネット販 売・通信販 売	26,030	9,066.51	236,001,378	17,694.73	460,593,895	0.76
15	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	246,921	993.68	245,360,669	1,749.11	431,894,459	0.72
16	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	37,350	8,203.48	306,400,279	11,525.10	430,462,485	0.71
17	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術 サービス	233,200	1,058.16	246,764,044	1,837.72	428,558,170	0.71
18	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵 当・不動産 金融	116,600	2,539.07	296,055,862	3,493.08	407,293,128	0.67
19	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュ ータ・周辺機 器	55,030	4,105.89	225,947,386	7,083.72	389,817,112	0.65

20	香港	株式	XIAOMI CORPORATION	コンピュータ・周辺機器	944,000	218.05	205,848,345	394.96	372,846,016	0.62
21	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・機器・部品	837,649	289.17	242,227,644	442.00	370,245,046	0.61
22	アメリカ	株式	NETEASE INC-ADR	娯楽	27,880	7,997.94	222,982,678	12,249.23	341,508,677	0.56
23	台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	101,538	1,639.66	166,488,535	3,241.36	329,122,227	0.54
24	香港	株式	MUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	ライフサイエンス・ツール/サービス	207,000	655.69	135,727,953	1,446.40	299,405,628	0.49
25	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術サービス	64,600	2,909.96	187,983,897	4,603.03	297,355,867	0.49
26	韓国	株式	LG CHEMICALS LTD	化学	3,160	37,428.08	118,272,762	87,890.60	277,734,296	0.46
27	韓国	株式	NAVER CORP	インタラクティブ・メディアおよびサービス	8,300	20,813.12	172,748,946	33,263.50	276,087,050	0.46
28	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,084,000	68.21	278,600,670	67.26	274,711,077	0.45
29	韓国	株式	SAMSUNG SDI CO,LTD	電子装置・機器・部品	3,800	29,721.12	112,940,286	71,867.90	273,098,020	0.45
30	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	724,000	288.07	208,569,348	364.20	263,682,721	0.43

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	8.02
		メディア	0.21
		娯楽	1.29
		不動産管理・開発	1.63
		エネルギー設備・サービス	0.06
		石油・ガス・消耗燃料	4.26
		化学	2.31
		建設資材	0.88
		容器・包装	0.03
		金属・鋳業	3.33
		紙製品・林産品	0.21

航空宇宙・防衛	0.06
建設関連製品	0.02
建設・土木	0.38
電気設備	0.29
コングロマリット	0.92
機械	0.33
商社・流通業	0.01
商業サービス・用品	0.23
航空貨物・物流サービス	0.22
旅客航空輸送業	0.07
海運業	0.11
陸運・鉄道	0.20
運送インフラ	0.49
自動車部品	0.53
自動車	3.05
家庭用耐久財	0.35
レジャー用品	0.06
繊維・アパレル・贅沢品	0.82
ホテル・レストラン・レジャー	0.64
インターネット販売・通信販売	11.23
複合小売り	0.44
専門小売り	0.39
食品・生活必需品小売り	1.15
飲料	0.67
食品	1.49
タバコ	0.27
家庭用品	0.38
パーソナル用品	0.58
ヘルスケア機器・用品	0.32
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.55
バイオテクノロジー	0.87
医薬品	1.10
銀行	10.70
各種金融サービス	0.50
保険	2.47
情報技術サービス	1.92

	ソフトウェア	0.31
	通信機器	0.15
	コンピュータ・周辺機器	6.24
	電子装置・機器・部品	2.37
	半導体・半導体製造装置	8.60
	各種電気通信サービス	0.93
	無線通信サービス	1.19
	電力	0.64
	ガス	0.52
	総合公益事業	0.02
	水道	0.11
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.67
	消費者金融	0.38
	資本市場	0.83
	各種消費者サービス	0.80
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.44
	ヘルスケア・テクノロジー	0.22
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.88
	専門サービス	0.02
	その他の業種	0.00
投資信託受益証券		3.74
投資証券		0.06
合 計		95.56

(参考) 国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 60回	7,900,000,000	100.74	7,958,494,000	100.62	7,949,296,000	0.1	2030/9/20	1.11
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	7,300,000,000	102.36	7,472,870,000	102.06	7,450,526,000	0.3	2025/12/20	1.04
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 48回	6,800,000,000	101.65	6,912,678,000	101.26	6,886,156,000	0.1	2027/9/20	0.96
4	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	102.46	6,762,426,000	0.6	2024/6/20	0.94
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 52回	6,600,000,000	101.47	6,697,657,000	101.18	6,678,408,000	0.1	2028/9/20	0.93

6	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	100.37	6,223,312,000	0.1	2022/9/20	0.87
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	6,000,000,000	102.98	6,179,135,000	102.20	6,132,480,000	0.8	2023/6/20	0.86
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	5,900,000,000	102.64	6,055,780,000	102.09	6,023,723,000	0.6	2023/12/20	0.84
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	5,900,000,000	101.40	5,983,005,000	101.13	5,967,024,000	0.1	2026/6/20	0.83
10	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	101.25	5,923,359,000	0.1	2028/3/20	0.83
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 55回	5,350,000,000	111.00	5,938,998,000	110.52	5,912,980,500	1	2035/12/20	0.82
12	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	101.16	5,867,338,000	0.1	2026/9/20	0.82
13	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	101.22	5,668,488,000	0.1	2028/6/20	0.79
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 8回	5,500,000,000	100.81	5,544,842,000	100.66	5,536,575,000	0.1	2023/12/20	0.77
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 58回	5,470,000,000	100.93	5,521,335,100	100.82	5,514,854,000	0.1	2030/3/20	0.77
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 47回	5,400,000,000	101.67	5,490,218,000	101.25	5,467,554,000	0.1	2027/6/20	0.76
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 59回	5,300,000,000	100.63	5,333,618,000	100.74	5,339,697,000	0.1	2030/6/20	0.74
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,250,000,000	102.19	5,365,395,000	101.54	5,331,217,500	0.6	2023/3/20	0.74
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 1回	5,300,000,000	100.47	5,325,014,000	100.24	5,312,879,000	0.1	2022/3/20	0.74
20	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	101.14	5,158,446,000	0.1	2028/12/20	0.72
21	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	101.04	5,153,499,000	0.1	2029/6/20	0.72
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 39回	5,000,000,000	102.73	5,136,630,000	102.31	5,115,600,000	0.4	2025/6/20	0.71
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	5,000,000,000	102.58	5,129,264,000	102.17	5,108,900,000	0.4	2025/3/20	0.71
24	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	101.21	5,060,650,000	0.1	2026/12/20	0.70
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 3回	4,970,000,000	101.00	5,019,928,700	100.95	5,017,413,800	0.1	2025/3/20	0.70
26	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	101.23	4,960,417,000	0.1	2027/3/20	0.69
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 5回	4,900,000,000	101.03	4,950,671,000	101.02	4,950,176,000	0.1	2025/9/20	0.69
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 56回	4,800,000,000	100.98	4,847,420,000	100.99	4,847,712,000	0.1	2029/9/20	0.67

29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 47回	4,000,000,000	118.53	4,741,200,000	117.95	4,718,080,000	1.6	2033/12/20	0.66
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	4,600,000,000	102.83	4,730,180,000	102.28	4,704,880,000	0.5	2024/9/20	0.65

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	79.62
地方債証券	6.87
特殊債券	8.66
社債券	4.00
合計	99.17

(参考) 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,400,000	12,121.64	654,568,738	11,877.25	641,371,660	2.625	2029/2/15	0.82
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,592.28	629,614,429	12,254.36	612,718,049	3.125	2028/11/15	0.78
3	イギリス	国債証券	UK TREASURY	2,180,000	25,960.81	565,945,824	25,737.45	561,076,516	4.25	2046/12/7	0.71
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,831.22	541,561,469	10,789.19	539,459,599	1.375	2023/9/30	0.69
5	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,480,000	19,727.08	489,231,722	21,292.90	528,064,118	4.75	2044/9/1	0.67
6	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000	13,006.89	520,275,987	13,056.26	522,250,592	0	2026/2/25	0.66
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	11,561.36	520,261,425	11,438.11	514,714,994	2.625	2025/3/31	0.65
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	3,450,000	15,454.06	533,165,104	14,578.22	502,948,762	3.75	2043/11/15	0.64
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	12,138.45	509,815,025	11,890.31	499,393,145	2.75	2028/2/15	0.64
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,022.36	480,894,527	11,684.61	467,384,719	2.375	2029/5/15	0.59
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	11,180.99	469,601,663	11,074.06	465,110,645	1.625	2026/5/15	0.59
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,696.86	467,874,480	11,571.97	462,879,040	2.875	2025/4/30	0.59
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,675.64	467,025,600	11,549.12	461,964,840	2.75	2025/6/30	0.59
14	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,200,000	13,897.62	444,723,917	14,220.14	455,044,685	2.2	2027/6/1	0.58
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,313.22	452,529,000	11,226.70	449,068,079	2.25	2024/11/15	0.57
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,110,000	10,912.44	448,501,530	10,847.14	445,817,700	2	2023/2/15	0.57
17	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,400,000	13,018.58	442,631,937	13,085.68	444,913,257	0	2029/11/25	0.57
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,520,000	13,330.54	469,235,329	12,635.55	444,771,360	2.75	2047/8/15	0.57
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,149.15	445,966,318	11,078.96	443,158,439	2	2024/6/30	0.56
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,161.40	446,456,079	11,066.71	442,668,679	1.625	2026/2/15	0.56
21	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,400,000	12,899.84	438,594,696	12,875.03	437,751,074	0.45	2022/10/31	0.56
22	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,300,000	18,986.54	436,690,540	18,716.38	430,476,830	6.5	2027/7/4	0.55
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,752.46	430,098,439	10,697.77	427,910,879	1.625	2022/8/31	0.54

24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,442.69	417,707,775	10,450.85	418,034,259	0.125	2022/9/30	0.53
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,429.22	417,169,050	10,439.42	417,577,138	0.125	2023/9/15	0.53
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,422.69	416,907,850	10,437.79	417,511,859	0.125	2023/10/15	0.53
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,397.80	415,912,025	10,382.70	415,308,000	0.25	2025/9/30	0.53
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,395.19	415,807,845	10,376.17	415,046,800	0.25	2025/10/31	0.53
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	12,855.12	437,074,114	12,041.32	409,404,880	2.5	2046/5/15	0.52
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,530,000	12,286.19	433,702,683	11,496.06	405,811,094	2.25	2046/8/15	0.52

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	99.17
合計	99.17

(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	70,700,000	13,782.14	9,743,979,804	13,354.66	9,441,748,854	6	2026/2/15	1.61
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,500,000	10,851.27	7,650,146,422	10,689.20	7,535,887,046	2.5	2022/1/15	1.29
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	48,000,000	14,490.33	6,955,358,976	13,950.93	6,696,449,512	5.25	2028/11/15	1.14
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	46,200,000	14,596.18	6,743,436,074	14,063.98	6,497,561,984	5.5	2028/8/15	1.11
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,500,000	12,976.33	6,682,811,732	12,044.58	6,202,961,275	2.5	2046/2/15	1.06
6	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,550,000	20,413.87	5,828,160,456	21,627.43	6,174,631,957	3.25	2045/5/25	1.05
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,600,000	11,496.85	5,817,408,313	11,367.91	5,752,163,961	2.25	2025/11/15	0.98
8	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	27,800,000	19,728.35	5,484,481,411	20,674.42	5,747,488,982	5.75	2032/7/30	0.98
9	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	26,400,000	22,810.97	6,022,096,080	21,648.57	5,715,222,921	3.25	2044/1/22	0.97
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,300,000	15,456.88	5,919,985,476	14,815.75	5,674,433,386	5.375	2031/2/15	0.97
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,000,000	10,885.53	5,442,765,645	10,788.37	5,394,187,995	1.75	2023/1/31	0.92
12	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000	16,446.12	4,917,392,522	17,812.17	5,325,841,342	5.25	2029/11/1	0.91
13	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	15,561.46	5,306,460,179	15,436.25	5,263,761,796	3.5	2026/4/25	0.90
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,100,000	11,277.55	5,311,727,995	11,128.75	5,241,642,182	2.75	2023/7/31	0.89
15	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	19,040.52	5,140,942,253	18,996.19	5,128,972,818	5.5	2029/4/25	0.87
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	11,367.91	5,126,928,748	11,239.76	5,069,132,652	2.375	2024/8/15	0.86
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,100,000	14,009.11	5,197,380,263	13,074.69	4,850,710,724	3	2044/11/15	0.83

18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,900,000	12,906.80	5,149,815,526	12,031.52	4,800,578,475	2.5	2045/2/15	0.82
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,363.83	4,840,992,423	11,204.66	4,773,186,424	2.75	2023/11/15	0.81
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,700,000	11,278.94	4,816,108,224	11,160.58	4,765,570,217	2.125	2024/9/30	0.81
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,000,000	11,204.66	4,818,005,075	11,078.96	4,763,953,225	2.25	2023/12/31	0.81
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,504.95	4,851,920,600	12,073.15	4,684,383,351	6.25	2023/8/15	0.80
23	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	32,400,000	14,117.55	4,574,089,122	13,934.30	4,514,713,719	5.5	2022/11/1	0.77
24	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,400,000	21,479.57	4,381,832,465	21,709.72	4,428,783,460	5.75	2032/10/25	0.75
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,000,000	11,783.38	4,477,686,300	11,576.87	4,399,211,727	2.375	2027/5/15	0.75
26	イギリス	国債証券	UK TREASURY	18,440,000	23,987.11	4,423,223,755	22,686.52	4,183,395,913	3.5	2045/1/22	0.71
27	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	22,500,000	17,169.12	3,863,053,344	17,883.00	4,023,676,620	6.5	2027/11/1	0.68
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	11,751.69	4,054,334,176	11,571.97	3,992,331,716	2.875	2025/4/30	0.68
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	12,421.44	4,285,397,959	11,496.06	3,966,142,425	2.25	2046/8/15	0.67
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	28,200,000	14,595.85	4,116,031,157	14,032.97	3,957,297,540	5.25	2029/2/15	0.67

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.79
合計	98.79

(参考)新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	15,500,000	1,591.67	246,709,976	1,593.21	246,948,116	2.2	2025/7/27	2.76
2	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	6,700,000	3,051.18	204,429,649	3,102.59	207,874,003	2.5	2027/7/25	2.33
3	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	12,300,000	1,621.73	199,473,012	1,589.75	195,540,384		2024/1/1	2.19
4	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000	1,745.15	174,515,962	1,721.48	172,148,503	3.6	2030/5/21	1.92
5	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000	1,740.70	174,070,352	1,695.45	169,545,122	3.48	2027/6/29	1.90
6	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	3,610,000,000	3.72	134,511,524	3.79	137,134,695	9.85	2027/6/28	1.53
7	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000	2,179.77	132,971,736	2,102.67	128,263,008	10	2023/1/1	1.43
8	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,500,000	1,654.21	124,066,492	1,643.70	123,277,997	3.03	2024/6/24	1.38
9	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,900,000	779.71	116,177,892	813.48	121,209,635	10.5	2026/12/21	1.35

10	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000	2,992.71	119,708,659	2,998.44	119,937,916	2.5	2024/4/25	1.34
11	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000	3,131.10	118,982,035	3,132.00	119,016,000	3.25	2025/7/25	1.33
12	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	17,100,000	595.19	101,777,688	629.33	107,615,430	8.5	2029/5/31	1.20
13	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	12,230,000,000	0.85	105,097,747	0.87	107,142,138	9	2029/3/15	1.20
14	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000	1,773.90	106,434,178	1,767.84	106,070,616	4.15	2027/12/4	1.18
15	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000	2,887.06	106,821,244	2,864.36	105,981,501	2.25	2022/4/25	1.18
16	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	481,000	2,257.60	108,592,652	2,171.04	104,427,060	10	2025/1/1	1.17
17	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,700,000	2,781.92	102,931,242	2,788.71	103,182,607	3.955	2025/9/15	1.15
18	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	28,300,000	359.44	101,722,896	360.45	102,010,092	1.6	2029/12/17	1.14
19	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,700,000	642.13	94,394,433	656.52	96,509,362	8	2030/1/31	1.08
20	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,200,000	3,000.83	96,026,786	2,997.18	95,910,029	2.25	2024/10/25	1.07
21	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	19,600,000	471.22	92,360,296	487.01	95,454,309	1	2026/6/26	1.07
22	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,550,000	544.09	84,606,185	590.24	91,782,553	7.5	2027/6/3	1.02
23	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	11,100,000,000	0.75	84,152,551	0.78	87,549,863	7	2030/9/15	0.98
24	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,900,000	357.85	85,526,644	359.44	85,906,945	1.45	2024/12/17	0.96
25	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,700,000	559.59	82,259,828	577.21	84,850,921	8	2024/9/5	0.95
26	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,900,000	1,703.26	83,460,005	1,717.97	84,180,593		2022/7/1	0.94
27	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000	2,737.66	79,392,301	2,798.27	81,149,843	3.733	2028/6/15	0.90
28	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	11,600,000	608.29	70,562,669	631.77	73,285,448	8.5	2038/11/18	0.82
29	メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	12,900,000	560.28	72,277,125	566.18	73,037,975	8	2023/12/7	0.81
30	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	48,000,000	154.07	73,953,833	151.05	72,508,291	7.65	2030/4/10	0.81

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.95
合計	97.95

【投資不動産物件】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

該当事項はありません。

(参考) 国内株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物(2021年03月限)	買建	478	日本円	8,751,228,602	8,623,120,000	1.99

(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(2021年03月限)	買建	462	米ドル	85,664,537.5	8,950,230,878	87,300,675	9,121,174,524	1.11
	カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2021年03月限)	買建	25	カナダドル	5,185,492	421,839,775	5,213,500	424,118,225	0.05
	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(2021年03月限)	買建	299	ユーロ	10,520,675	1,330,654,974	10,608,520	1,341,765,605	0.16
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200株価指数先物(2021年03月限)	買建	22	豪ドル	3,636,275	291,192,902	3,624,500	290,249,960	0.03
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2021年03月限)	買建	65	英ポンド	4,223,740	605,008,516	4,211,350	603,233,769	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(2021年03月限)	買建	32	スイスフラン	3,355,090	394,189,523	3,447,360	405,030,320	0.04

(参考) 新興国株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	E-mini MSCIエマージングマーケット株価指数先物(2021年03月限)	買建	302	米ドル	20,381,205	2,129,428,298	20,560,160	2,148,125,506	3.58
	シンガポール	シンガポール取引所	SGX FTSE China A50 指数先物(2021年02月限)	買建	243	米ドル	4,552,996	475,697,037	4,404,375	460,169,100	0.76

（参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

2021年1月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2016年12月26日)	55	55	1.0544	1.0544
第2計算期間 (2017年12月26日)	87	87	1.1699	1.1699
第3計算期間 (2018年12月26日)	88	88	1.0553	1.0553
第4計算期間 (2019年12月26日)	114	114	1.1863	1.1863
第5計算期間 (2020年12月28日)	131	131	1.2347	1.2347
2020年 1月末日	115		1.1839	
2月末日	112		1.1482	
3月末日	107		1.0880	
4月末日	110		1.1165	
5月末日	114		1.1405	
6月末日	116		1.1532	
7月末日	118		1.1579	
8月末日	121		1.1864	
9月末日	122		1.1818	

10月末日	122		1.1714	
11月末日	128		1.2249	
12月末日	131		1.2398	
2021年 1月末日	133		1.2469	

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

2021年1月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2016年12月26日)	10	10	1.0514	1.0514
第2計算期間 (2017年12月26日)	21	21	1.1664	1.1664
第3計算期間 (2018年12月26日)	27	27	1.0377	1.0377
第4計算期間 (2019年12月26日)	40	40	1.1878	1.1878
第5計算期間 (2020年12月28日)	50	50	1.2467	1.2467
2020年 1月末日	40		1.1813	
2月末日	39		1.1339	
3月末日	37		1.0599	
4月末日	39		1.0958	
5月末日	41		1.1259	
6月末日	42		1.1411	
7月末日	43		1.1452	
8月末日	46		1.1844	
9月末日	45		1.1770	
10月末日	45		1.1647	
11月末日	49		1.2335	
12月末日	50		1.2532	
2021年 1月末日	51		1.2648	

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

2021年1月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2016年12月26日)	7	7	1.0472	1.0472
第2計算期間 (2017年12月26日)	15	15	1.1589	1.1589
第3計算期間 (2018年12月26日)	19	19	1.0320	1.0320
第4計算期間 (2019年12月26日)	28	28	1.1848	1.1848
第5計算期間 (2020年12月28日)	37	37	1.2479	1.2479
2020年 1月末日	29		1.1764	
2月末日	29		1.1237	

3月末日	27	1.0440
4月末日	28	1.0831
5月末日	29	1.1158
6月末日	30	1.1320
7月末日	31	1.1359
8月末日	32	1.1798
9月末日	32	1.1710
10月末日	32	1.1580
11月末日	35	1.2334
12月末日	37	1.2550
2021年 1月末日	33	1.2692

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

2021年1月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2016年12月26日)	6	6	1.0409	1.0409
第2計算期間 (2017年12月26日)	10	10	1.1478	1.1478
第3計算期間 (2018年12月26日)	13	13	1.0248	1.0248
第4計算期間 (2019年12月26日)	18	18	1.1734	1.1734
第5計算期間 (2020年12月28日)	23	23	1.2457	1.2457
2020年 1月末日	19		1.1656	
2月末日	18		1.1145	
3月末日	17		1.0354	
4月末日	17		1.0740	
5月末日	18		1.1072	
6月末日	19		1.1239	
7月末日	19		1.1277	
8月末日	20		1.1734	
9月末日	20		1.1638	
10月末日	20		1.1504	
11月末日	22		1.2300	
12月末日	23		1.2532	
2021年 1月末日	23		1.2684	

【分配の推移】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
--	------	-----------

第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	0.0000円
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	0.0000円

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	0.0000円
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	0.0000円

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	0.0000円
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	0.0000円

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	0.0000円
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	0.0000円

【収益率の推移】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	5.4%

第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	11.0%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	9.8%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	12.4%
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	4.1%

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

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	5.1%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.9%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	11.0%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.5%
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	5.0%

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

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	4.7%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.7%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	11.0%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.8%
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	5.3%

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

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	4.1%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.3%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	10.7%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.5%
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	6.2%

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

（４）【設定及び解約の実績】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	55,225,894	2,600,834	52,625,060
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	24,780,288	2,633,235	74,772,113
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	18,821,572	10,010,450	83,583,235
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	16,232,168	3,027,760	96,787,643
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	12,106,975	2,687,771	106,206,847

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	9,846,136	172	9,845,964
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	8,525,619	19,110	18,352,473
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	8,382,826	156,480	26,578,819
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	7,806,968	403,555	33,982,232
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	8,125,766	1,891,861	40,216,137

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	6,747,567	22	6,747,545
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	6,892,208	7,296	13,632,457
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	5,291,632	64,250	18,859,839
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	5,443,331	88,292	24,214,878
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	6,341,882	549,936	30,006,824

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	6,671,960	59,305	6,612,655
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	2,418,017	29,744	9,000,928

第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	4,410,696	625,991	12,785,633
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	3,370,205	55,192	16,100,646
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	3,607,259	1,199,279	18,508,626

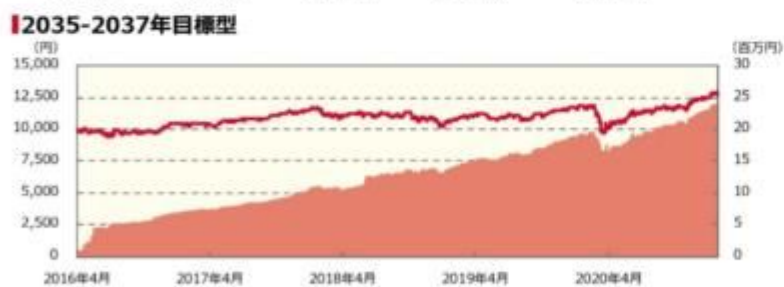
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報



運用実績（2021年1月29日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次：設定来）



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2026-2028年目標型

2020年12月	0 円
2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
2017年12月	0 円
2016年12月	0 円
設定来累計	0 円

2029-2031年目標型

2020年12月	0 円
2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
2017年12月	0 円
2016年12月	0 円
設定来累計	0 円

2032-2034年目標型

2020年12月	0 円
2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
2017年12月	0 円
2016年12月	0 円
設定来累計	0 円

2035-2037年目標型

2020年12月	0 円
2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
2017年12月	0 円
2016年12月	0 円
設定来累計	0 円

■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

	投資比率 (%)			
	野村ターゲットデートファンド2016			
	2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
国内株式マザーファンド	19.1	25.2	28.0	30.5
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	11.2	14.8	16.5	17.9
新興国株式マザーファンド	8.8	11.6	12.9	13.9
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	23.5	16.8	13.9	11.4
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	23.4	16.7	13.8	11.4
外国債券マザーファンド	9.0	9.6	9.6	9.5
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	4.9	5.2	5.2	5.2

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.6	0.7	0.8	0.9
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.5	0.6	0.7	0.8
3	ソニー	電気機器	0.5	0.6	0.7	0.8
4	キーエンス	電気機器	0.4	0.5	0.6	0.7
5	任天堂	その他製品	0.3	0.3	0.4	0.4

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.5	0.7	0.8	0.9
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.4	0.5	0.6	0.6
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.3	0.4	0.5	0.5
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.2	0.2	0.2
5	TESLA INC	自動車	0.1	0.2	0.2	0.2

・「新興国株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.5	0.7	0.8	0.9
2	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.5	0.7	0.8	0.8
3	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネット販売・通信販売	0.5	0.7	0.7	0.8
4	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.4	0.5	0.5	0.6
5	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	—	0.3	0.4	0.5	0.5

・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	国庫債券 利付（10年）第360回	国債証券	0.3	0.2	0.2	0.1
2	国庫債券 利付（10年）第341回	国債証券	0.2	0.2	0.1	0.1
3	国庫債券 利付（10年）第348回	国債証券	0.2	0.2	0.1	0.1
4	国庫債券 利付（10年）第334回	国債証券	0.2	0.2	0.1	0.1
5	国庫債券 利付（10年）第352回	国債証券	0.2	0.2	0.1	0.1

・「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

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

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

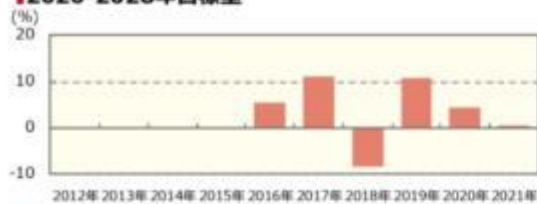
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	US TREASURY BOND	国債証券	0.1	0.2	0.2	0.2
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
3	US TREASURY BOND	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
4	US TREASURY BOND	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1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

・「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」を通じての投資銘柄

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

■ 年間収益率の推移（暦年ベース）

■ 2026-2028年目標型



■ 2029-2031年目標型



■ 2032-2034年目標型



■ 2035-2037年目標型



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドは合成指数をベンチマークとしていますが、毎月基本投資割合を変更するため、暦年ベースで収益率を表示した場合、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマークは掲載しておりません。
- ・2016年は設定日（2016年4月1日）から年末までの収益率。
- ・2021年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- ・ 申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。
- ・ 取得申込みの受付については、午後3時までに取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付にかか
る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。
- ・ 販売会社の営業日であっても、下記の条件に該当する日（「申込不可日」といいます。）には、原則とし
て取得の申込みができません。

申込日当日またはその翌営業日が以下のいずれかの休業日と同日の場合

- ・ ニューヨーク証券取引所
- ・ ニューヨークの銀行

申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

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

積立方式

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

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

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

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

2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、委託者に1口単位または1円単位で一部解約の実行を請求することができます。
 - ・受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
 - ・一部解約の実行の請求の受付については、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。
- ただし、販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として受益権の一部解約の実行の請求ができません。（申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。）
- ・換金価額は、換金申込日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口換金には制限を設ける場合があります。
- ・解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して7営業日目から販売会社において支払います。
- ・金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

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

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

< 基準価額の計算方法 >

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

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

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

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

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

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年12月27日から翌年12月26日までとします。

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

（５）【その他】

(a) ファンドの繰上償還条項

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

(b) 信託期間の終了

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

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

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

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

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

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

(c) 運用報告書

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

(d) 信託約款の変更等

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

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

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

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

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

(g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

(i) 関係法人との契約の更新に関する手続

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

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

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

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

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

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2019年12月27日から2020年12月28日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2019年12月26日現在)	第5期 (2020年12月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	655,248	758,604
親投資信託受益証券	114,701,262	131,031,690
未収入金	27,748	-
流動資産合計	115,384,258	131,790,294
資産合計	115,384,258	131,790,294
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	29,594	34,322
未払委託者報酬	532,604	617,667
その他未払費用	1,724	1,992
流動負債合計	563,922	653,981
負債合計	563,922	653,981
純資産の部		
元本等		
元本	96,787,643	106,206,847
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	18,032,693	24,929,466
(分配準備積立金)	11,895,922	16,739,869
元本等合計	114,820,336	131,136,313
純資産合計	114,820,336	131,136,313
負債純資産合計	115,384,258	131,790,294

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2018年12月27日	自	2019年12月27日
	至	2019年12月26日	至	2020年12月28日
営業収益				
有価証券売買等損益		12,812,646		6,591,710
営業収益合計		12,812,646		6,591,710
営業費用				
支払利息		60		28
受託者報酬		55,987		65,346
委託者報酬		1,007,619		1,176,035
その他費用		3,246		3,791
営業費用合計		1,066,912		1,245,200
営業利益又は営業損失（ ）		11,745,734		5,346,510
経常利益又は経常損失（ ）		11,745,734		5,346,510
当期純利益又は当期純損失（ ）		11,745,734		5,346,510
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（ ）		209,464		75,399
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,622,437		18,032,693
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,056,298		1,962,979
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,056,298		1,962,979
剰余金減少額又は欠損金増加額		182,312		488,115
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		182,312		488,115
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		18,032,693		24,929,466

(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12月27日から2020年12月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第4期 2019年12月26日現在	第5期 2020年12月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 96,787,643口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 106,206,847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 1.1863円 (10,000口当たり純資産額) (11,863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 1.2347円 (10,000口当たり純資産額) (12,347円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28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>2,059,551円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>7,125,542円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>9,836,371円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>19,021,464円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>96,787,643口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>1,965円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,059,551円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	7,125,542円	分配準備積立金額	D	9,836,371円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	19,021,464円	当ファンドの期末残存口数	F	96,787,643口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,965円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円	<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>1,912,691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>3,239,679円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>9,316,449円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>11,587,499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>26,056,318円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>106,206,847口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>2,453円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,912,691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	3,239,679円	収益調整金額	C	9,316,449円	分配準備積立金額	D	11,587,499円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,056,318円	当ファンドの期末残存口数	F	106,206,847口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,453円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	2,059,551円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	7,125,542円																																																											
分配準備積立金額	D	9,836,371円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	19,021,464円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	96,787,643口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,965円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,912,691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	3,239,679円																																																											
収益調整金額	C	9,316,449円																																																											
分配準備積立金額	D	11,587,499円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,056,318円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	106,206,847口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,453円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円																																																											

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第4期 2019年12月26日現在	第5期 2020年12月28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4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28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4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日
期首元本額 83,583,235円	期首元本額 96,787,643円
期中追加設定元本額 16,232,168円	期中追加設定元本額 12,106,975円
期中一部解約元本額 3,027,760円	期中一部解約元本額 2,687,771円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28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	11,271,940	6,775,627
合計	11,271,940	6,775,627

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12月28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12月28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	13,885,692	25,666,313	
		外国債券マザーファンド	4,799,101	11,880,174	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	4,460,557	14,872,835	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	22,950,537	30,533,394	
		新興国株式マザーファンド	7,434,898	10,838,594	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	4,900,758	6,787,059	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	24,252,068	30,453,321	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	82,683,611	131,031,690 100.0%	
合計			131,031,690		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (2019年12月26日現在)	第5期 (2020年12月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	224,672	286,220
親投資信託受益証券	40,321,608	50,098,958
未収入金	9,770	-
流動資産合計	40,556,050	50,385,178
資産合計	40,556,050	50,385,178
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	10,139	12,944
未払委託者報酬	182,255	232,938
その他未払費用	563	733
流動負債合計	192,957	246,615
負債合計	192,957	246,615
純資産の部		
元本等		
元本	33,982,232	40,216,137
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	6,380,861	9,922,426
(分配準備積立金)	3,802,025	6,216,409
元本等合計	40,363,093	50,138,563
純資産合計	40,363,093	50,138,563
負債純資産合計	40,556,050	50,385,178

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自	2018年12月27日 至 2019年12月26日	自	2019年12月27日 至 2020年12月28日
営業収益				
有価証券売買等損益		4,853,896		3,085,661
営業収益合計		4,853,896		3,085,661
営業費用				
支払利息		2		4
受託者報酬		18,794		23,962
委託者報酬		337,985		431,237
その他費用		1,015		1,323
営業費用合計		357,796		456,526
営業利益又は営業損失()		4,496,100		2,629,135
経常利益又は経常損失()		4,496,100		2,629,135
当期純利益又は当期純損失()		4,496,100		2,629,135
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()		21,590		29,647
期首剰余金又は期首欠損金()		1,002,476		6,380,861
剰余金増加額又は欠損金減少額		923,179		1,285,547
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		923,179		1,285,547
剰余金減少額又は欠損金増加額		19,304		343,470
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		19,304		343,470
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		6,380,861		9,922,426

(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12月27日から2020年12月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第4期 2019年12月26日現在	第5期 2020年12月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 33,982,232口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 40,216,137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 1.1878円 (10,000口当たり純資産額) (11,878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 1.2467円 (10,000口当たり純資産額) (12,467円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28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>724,758円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>330,270円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>3,334,615円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,746,997円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>7,136,640円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>33,982,232口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>2,100円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	724,758円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	330,270円	収益調整金額	C	3,334,615円	分配準備積立金額	D	2,746,997円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,136,640円	当ファンドの期末残存口数	F	33,982,232口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,100円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円	<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>763,840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>1,835,648円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>4,849,043円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>3,616,921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>11,065,452円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>40,216,137口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>2,751円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	763,840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	1,835,648円	収益調整金額	C	4,849,043円	分配準備積立金額	D	3,616,921円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,065,452円	当ファンドの期末残存口数	F	40,216,137口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,751円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	724,758円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	330,270円																																																											
収益調整金額	C	3,334,615円																																																											
分配準備積立金額	D	2,746,997円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,136,640円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	33,982,232口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,100円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	763,840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	1,835,648円																																																											
収益調整金額	C	4,849,043円																																																											
分配準備積立金額	D	3,616,921円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,065,452円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	40,216,137口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,751円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円																																																											

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第4期 2019年12月26日現在	第5期 2020年12月28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4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28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4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日
期首元本額 26,578,819円	期首元本額 33,982,232円
期中追加設定元本額 7,806,968円	期中追加設定元本額 8,125,766円
期中一部解約元本額 403,555円	期中一部解約元本額 1,891,861円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28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	4,476,773	3,073,229
合計	4,476,773	3,073,229

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12月28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12月28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	7,014,632	12,965,845	
		外国債券マザーファンド	1,950,726	4,829,022	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	2,232,515	7,443,874	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	6,256,629	8,323,819	
		新興国株式マザーファンド	3,768,717	5,494,035	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	1,978,757	2,740,380	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	6,611,439	8,301,983	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	29,813,415	50,098,958 100.0%	
合計			50,098,958		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (2019年12月26日現在)	第5期 (2020年12月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	158,625	206,984
親投資信託受益証券	28,659,353	37,417,180
未収入金	6,958	-
流動資産合計	28,824,936	37,624,164
資産合計	28,824,936	37,624,164
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	7,155	9,304
未払委託者報酬	128,700	167,549
その他未払費用	380	490
流動負債合計	136,235	177,343
負債合計	136,235	177,343
純資産の部		
元本等		
元本	24,214,878	30,006,824
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,473,823	7,439,997
(分配準備積立金)	2,683,561	4,677,082
元本等合計	28,688,701	37,446,821
純資産合計	28,688,701	37,446,821
負債純資産合計	28,824,936	37,624,164

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2018年12月27日	自	2019年12月27日
	至	2019年12月26日	至	2020年12月28日
営業収益				
有価証券売買等損益		3,525,282		2,323,872
営業収益合計		3,525,282		2,323,872
営業費用				
支払利息		1		-
受託者報酬		13,276		17,264
委託者報酬		238,746		310,836
その他費用		709		898
営業費用合計		252,732		328,998
営業利益又は営業損失（ ）		3,272,550		1,994,874
経常利益又は経常損失（ ）		3,272,550		1,994,874
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,272,550		1,994,874
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（ ）		5,150		52,537
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		602,981		4,473,823
剰余金増加額又は欠損金減少額		607,135		1,016,499
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		607,135		1,016,499
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,693		97,736
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,693		97,736
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,473,823		7,439,997

(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12月27日から2020年12月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第4期 2019年12月26日現在	第5期 2020年12月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 24,214,878口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 30,006,824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 1.1848円 (10,000口当たり純資産額) (11,848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 1.2479円 (10,000口当たり純資産額) (12,479円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28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>520,368円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>288,052円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,165,629円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,875,141円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>4,849,190円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>24,214,878口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>2,002円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	520,368円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	288,052円	収益調整金額	C	2,165,629円	分配準備積立金額	D	1,875,141円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,849,190円	当ファンドの期末残存口数	F	24,214,878口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,002円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円	<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>568,111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>1,479,300円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>3,391,517円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,629,671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>8,068,599円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>30,006,824口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>2,688円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	568,111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	1,479,300円	収益調整金額	C	3,391,517円	分配準備積立金額	D	2,629,671円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,068,599円	当ファンドの期末残存口数	F	30,006,824口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,688円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	520,368円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	288,052円																																																											
収益調整金額	C	2,165,629円																																																											
分配準備積立金額	D	1,875,141円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,849,190円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	24,214,878口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,002円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	568,111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	1,479,300円																																																											
収益調整金額	C	3,391,517円																																																											
分配準備積立金額	D	2,629,671円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,068,599円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	30,006,824口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,688円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円																																																											

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第4期 2019年12月26日現在	第5期 2020年12月28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4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28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4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日
期首元本額 18,859,839円	期首元本額 24,214,878円
期中追加設定元本額 5,443,331円	期中追加設定元本額 6,341,882円
期中一部解約元本額 88,292円	期中一部解約元本額 549,936円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28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	3,355,496	2,412,502
合計	3,355,496	2,412,502

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12月28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12月28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	5,803,212	10,726,657	
		外国債券マザーファンド	1,455,286	3,602,560	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,858,116	6,195,516	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	3,889,654	5,174,795	
		新興国株式マザーファンド	3,121,075	4,549,903	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	1,448,861	2,006,527	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	4,110,235	5,161,222	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	21,686,439	37,417,180 100.0%	
合計			37,417,180		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2019年12月26日現在)	第5期 (2020年12月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	103,681	128,894
親投資信託受益証券	18,873,776	23,038,068
未収入金	14,657	-
流動資産合計	18,992,114	23,166,962
資産合計	18,992,114	23,166,962
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,970	-
未払受託者報酬	4,679	5,829
未払委託者報酬	84,113	104,790
その他未払費用	216	269
流動負債合計	99,978	110,888
負債合計	99,978	110,888
純資産の部		
元本等		
元本	16,100,646	18,508,626
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,791,490	4,547,448
（分配準備積立金）	1,821,641	3,148,088
元本等合計	18,892,136	23,056,074
純資産合計	18,892,136	23,056,074
負債純資産合計	18,992,114	23,166,962

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日
営業収益		
有価証券売買等損益	2,290,517	1,539,239
営業収益合計	2,290,517	1,539,239
営業費用		
支払利息	1	1
受託者報酬	8,669	10,876
委託者報酬	155,831	195,605
その他費用	415	499
営業費用合計	164,916	206,981
営業利益又は営業損失()	2,125,601	1,332,258
経常利益又は経常損失()	2,125,601	1,332,258
当期純利益又は当期純損失()	2,125,601	1,332,258
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()	4,063	115,438
期首剰余金又は期首欠損金()	316,530	2,791,490
剰余金増加額又は欠損金減少額	355,325	508,226
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	355,325	508,226
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,903	199,964
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,903	199,964
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	2,791,490	4,547,448

(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12月27日から2020年12月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第4期 2019年12月26日現在	第5期 2020年12月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 16,100,646口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 18,508,626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 1.1734円 (10,000口当たり純資産額) (11,734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 1.2457円 (10,000口当たり純資産額) (12,457円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28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>345,372円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>195,614円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>1,345,095円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,280,655円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>3,166,736円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>16,100,646口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>1,966円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	345,372円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	195,614円	収益調整金額	C	1,345,095円	分配準備積立金額	D	1,280,655円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,166,736円	当ファンドの期末残存口数	F	16,100,646口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,966円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円	<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>370,446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>1,077,250円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>1,950,671円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,700,392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>5,098,759円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>18,508,626口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>2,754円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	370,446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	1,077,250円	収益調整金額	C	1,950,671円	分配準備積立金額	D	1,700,392円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,098,759円	当ファンドの期末残存口数	F	18,508,626口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,754円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	345,372円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	195,614円																																																											
収益調整金額	C	1,345,095円																																																											
分配準備積立金額	D	1,280,655円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,166,736円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	16,100,646口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,966円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	370,446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	1,077,250円																																																											
収益調整金額	C	1,950,671円																																																											
分配準備積立金額	D	1,700,392円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,098,759円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	18,508,626口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,754円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円																																																											

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第4期 2019年12月26日現在	第5期 2020年12月28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4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28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4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日
期首元本額 12,785,633円	期首元本額 16,100,646円
期中追加設定元本額 3,370,205円	期中追加設定元本額 3,607,259円
期中一部解約元本額 55,192円	期中一部解約元本額 1,199,279円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,184,772	1,631,304
合計	2,184,772	1,631,304

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12月28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12月28日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	3,845,359	7,107,761	
		外国債券マザーファンド	904,435	2,238,928	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,233,608	4,113,219	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	1,999,603	2,660,271	
		新興国株式マザーファンド	2,062,705	3,007,011	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	908,070	1,257,586	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	2,112,999	2,653,292	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	13,066,779	23,038,068 100.0%	
合計			23,038,068		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「野村ターゲットデートファンド2016」の各ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」および「新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2020年12月28日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	16,632,716,064
株式	423,207,842,020
派生商品評価勘定	66,721,545
未収入金	2,077,922

(2020年12月28日現在)

未収配当金	22,841,155
未収利息	719,446
その他未収収益	6,563,049
差入委託証拠金	368,321,250
流動資産合計	440,307,802,451
資産合計	440,307,802,451
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	466,485
未払解約金	380,562,877
未払利息	8,375
有価証券貸借取引受入金	8,470,863,005
流動負債合計	8,851,900,742
負債合計	8,851,900,742
純資産の部	
元本等	
元本	233,420,305,440
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	198,035,596,269
元本等合計	431,455,901,709
純資産合計	431,455,901,709
負債純資産合計	440,307,802,451

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年12月28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	1.8484円
(10,000口当たり純資産額)	(18,484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	
	8,074,615,620円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年12月27日 至 2020年12月28日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年12月28日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年12月28日現在		2019年12月27日
期首		2019年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額		262,681,989,592円
同期中における追加設定元本額		48,869,000,071円
同期中における一部解約元本額		78,130,684,223円
期末元本額		233,420,305,440円
期末元本額の内訳*		
バランスセレクト30		151,991,820円
バランスセレクト50		345,577,605円
バランスセレクト70		455,930,912円
野村世界6資産分散投信(安定コース)		2,495,964,700円
野村世界6資産分散投信(分配コース)		3,178,607,173円
野村世界6資産分散投信(成長コース)		7,574,267,165円
野村資産設計ファンド2015		42,097,456円
野村資産設計ファンド2020		42,588,188円
野村資産設計ファンド2025		78,726,440円
野村資産設計ファンド2030		103,481,552円
野村資産設計ファンド2035		82,733,480円
野村資産設計ファンド2040		161,441,083円
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)		58,567,237,645円
のむらっぴ・ファンド(保守型)		2,438,556,038円
のむらっぴ・ファンド(普通型)		8,490,244,894円
のむらっぴ・ファンド(積極型)		2,327,886,220円
野村資産設計ファンド2045		24,435,137円
野村インデックスファンド・TOPIX		1,509,361,023円
マイ・ロード		3,359,625,692円
ネクストコア		43,510,577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		1,398,818,905円
野村TOPIXインデックス(野村SMA・EW向け)		2,402,851,911円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)		1,978,808,967円
野村資産設計ファンド2050		41,515,978円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型		13,885,692円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型		7,014,632円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型		5,803,212円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型		3,845,359円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)		317,821,228円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)		330,946,674円
インデックス・ブレンド(タイプ)		3,776,779円
インデックス・ブレンド(タイプ)		4,021,132円
インデックス・ブレンド(タイプ)		16,893,741円
インデックス・ブレンド(タイプ)		5,141,348円
インデックス・ブレンド(タイプ)		20,588,532円
野村6資産均等バランス		1,611,659,952円
世界6資産分散ファンド		86,349,640円

野村資産設計ファンド2060	17,141,926円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	649,841,279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)	362,780,956円
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	201,241,912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)	561,633,470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)	667,224,841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)	3,586,745円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	9,601,357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)	850,429円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,615,508,729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)	9,702,420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)	94,370,287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)	75,321,966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)	26,399,347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)	96,318,292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)	235,987,029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)	4,332,197,539円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	64,218,385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)	378,671,297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)	1,522,525,918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)	334,374,938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)	950,510,596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)	2,218,980円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	6,733,804円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	27,167,306円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	36,447,652円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	125,127,110円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	9,382,204,281円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	24,658,424,003円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	26,912,634,122円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)	31,498,564,993円
マイバランスDC30	3,248,236,151円
マイバランスDC50	5,279,855,115円
マイバランスDC70	5,045,480,106円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	9,816,068,242円
野村DC運用戦略ファンド	776,429,130円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	64,433,958円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	1,036,782,008円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	825,573,446円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	685,201,777円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	8,075,652円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	3,974,935円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	56,180,918円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	14,998,813円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	12,072,460円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	10,827,122円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	339,501,520円

マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	275,180,352円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	149,539,401円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	182,797,621円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	5,556,322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12月28日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	8,100	2,950.00	23,895,000	
		日本水産	232,100	420.00	97,482,000	
		マルハニチロ	33,500	2,206.00	73,901,000	貸付有価証券 100株
		雪国まいたけ	14,300	1,690.00	24,167,000	
		カネコ種苗	7,000	1,552.00	10,864,000	
		サカタのタネ	27,700	3,615.00	100,135,500	
		ホクト	17,700	2,095.00	37,081,500	貸付有価証券 7,400株(4,400株)
		ホクリヨウ	3,600	691.00	2,487,600	
		住石ホールディングス	46,900	111.00	5,205,900	
		日鉄鉱業	5,300	6,160.00	32,648,000	
		三井松島ホールディングス	9,000	695.00	6,255,000	
		国際石油開発帝石	853,500	573.00	489,055,500	
		石油資源開発	30,300	1,888.00	57,206,400	貸付有価証券 100株
		K&Oエナジーグループ	11,300	1,453.00	16,418,900	
		ヒノキヤグループ	5,800	2,225.00	12,905,000	貸付有価証券 400株
		ショーボンドホールディングス	36,100	5,030.00	181,583,000	貸付有価証券 200株
		ミライト・ホールディングス	69,000	1,713.00	118,197,000	
タマホーム	12,500	1,438.00	17,975,000			

サンヨーホームズ	2,000	720.00	1,440,000	
日本アクア	9,200	648.00	5,961,600	
ファーストコーポレーション	7,100	689.00	4,891,900	
ベストテラ	4,000	1,708.00	6,832,000	貸付有価証券 1,500株
TATERU	43,500	165.00	7,177,500	貸付有価証券 300株
キャンディル	4,000	504.00	2,016,000	
スペースバリューホールディングス	28,300	690.00	19,527,000	
ダイセキ環境ソリューション	4,500	690.00	3,105,000	
第一カッター興業	2,900	2,694.00	7,812,600	貸付有価証券 100株（100株）
安藤・間	138,200	707.00	97,707,400	
東急建設	68,000	493.00	33,524,000	
コムシスホールディングス	82,300	3,080.00	253,484,000	
ビーアールホールディングス	25,300	640.00	16,192,000	貸付有価証券 100株
高松コンストラクショングループ	14,400	2,042.00	29,404,800	
東建コーポレーション	7,100	8,170.00	58,007,000	
ソネック	2,400	886.00	2,126,400	貸付有価証券 900株
ヤマウラ	10,100	930.00	9,393,000	貸付有価証券 500株
大成建設	178,700	3,525.00	629,917,500	
大林組	536,000	881.00	472,216,000	
清水建設	543,900	740.00	402,486,000	
飛島建設	15,400	1,065.00	16,401,000	
長谷工コーポレーション	207,500	1,183.00	245,472,500	貸付有価証券 2,900株
松井建設	21,100	754.00	15,909,400	
銭高組	2,300	4,480.00	10,304,000	
鹿島建設	420,800	1,369.00	576,075,200	
不動テトラ	14,000	1,747.00	24,458,000	
大末建設	6,200	795.00	4,929,000	
鉄建建設	11,600	1,817.00	21,077,200	

西松建設	41,300	2,073.00	85,614,900	貸付有価証券 12,600株
三井住友建設	129,500	425.00	55,037,500	貸付有価証券 200株
大豊建設	12,700	3,630.00	46,101,000	貸付有価証券 4,000株（100株）
前田建設工業	134,200	924.00	124,000,800	
佐田建設	11,500	421.00	4,841,500	
ナカノフードー建設	14,600	415.00	6,059,000	
奥村組	25,300	2,544.00	64,363,200	
東鉄工業	23,000	2,730.00	62,790,000	
イチケン	3,900	1,801.00	7,023,900	貸付有価証券 100株
富士ピー・エス	7,900	621.00	4,905,900	貸付有価証券 1,100株
浅沼組	6,000	3,965.00	23,790,000	
戸田建設	222,600	686.00	152,703,600	貸付有価証券 9,700株
熊谷組	24,800	2,562.00	63,537,600	
北野建設	3,300	2,460.00	8,118,000	
植木組	2,400	2,813.00	6,751,200	貸付有価証券 1,200株
矢作建設工業	23,700	894.00	21,187,800	
ピーエス三菱	17,600	611.00	10,753,600	
日本ハウスホールディングス	36,600	326.00	11,931,600	
大東建託	58,500	9,540.00	558,090,000	
新日本建設	22,800	841.00	19,174,800	
N I P P O	44,300	2,793.00	123,729,900	
東亜道路工業	3,300	3,740.00	12,342,000	
前田道路	47,300	1,707.00	80,741,100	貸付有価証券 1,200株
日本道路	5,200	7,630.00	39,676,000	
東亜建設工業	16,700	1,982.00	33,099,400	貸付有価証券 7,900株（2,700株）
日本国土開発	52,100	570.00	29,697,000	
若築建設	9,600	1,168.00	11,212,800	
東洋建設	60,100	424.00	25,482,400	
五洋建設	212,500	892.00	189,550,000	貸付有価証券

				1,400株
世紀東急工業	25,700	843.00	21,665,100	貸付有価証券 100株
福田組	6,200	5,730.00	35,526,000	貸付有価証券 2,900株
住友林業	135,800	2,196.00	298,216,800	貸付有価証券 4,500株
日本基礎技術	18,000	493.00	8,874,000	
巴コーポレーション	23,800	404.00	9,615,200	
大和ハウス工業	530,300	2,994.00	1,587,718,200	
ライト工業	30,700	1,784.00	54,768,800	
積水ハウス	581,300	2,060.50	1,197,768,650	貸付有価証券 100株
日特建設	14,000	791.00	11,074,000	
北陸電気工事	9,300	1,284.00	11,941,200	
ユアテック	30,700	861.00	26,432,700	
日本リーテック	11,200	2,354.00	26,364,800	貸付有価証券 200株(200株)
四電工	2,900	2,761.00	8,006,900	
中電工	21,600	2,193.00	47,368,800	
関電工	76,200	863.00	65,760,600	貸付有価証券 100株
きんでん	127,300	1,677.00	213,482,100	
東京エネシス	17,800	880.00	15,664,000	
トーエネック	5,400	3,960.00	21,384,000	
住友電設	15,100	2,566.00	38,746,600	貸付有価証券 600株
日本電設工業	29,400	2,118.00	62,269,200	
協和エクシオ	81,300	2,840.00	230,892,000	貸付有価証券 100株
新日本空調	14,200	2,251.00	31,964,200	
九電工	37,600	3,355.00	126,148,000	
三機工業	38,000	1,203.00	45,714,000	貸付有価証券 500株
日揮ホールディングス	165,000	952.00	157,080,000	
中外炉工業	5,800	1,623.00	9,413,400	
ヤマト	17,100	698.00	11,935,800	
太平電業	13,000	2,320.00	30,160,000	貸付有価証券 100株

高砂熱学工業	41,000	1,555.00	63,755,000	
三晃金属工業	2,300	2,859.00	6,575,700	
朝日工業社	3,600	3,160.00	11,376,000	
明星工業	34,700	790.00	27,413,000	
大気社	26,100	2,741.00	71,540,100	
ダイダン	12,800	2,894.00	37,043,200	
日比谷総合設備	17,200	1,894.00	32,576,800	
フィル・カンパニー	3,100	1,897.00	5,880,700	
OSJBホールディングス	84,500	278.00	23,491,000	
レイズネクスト	28,700	1,218.00	34,956,600	
日本製粉	50,200	1,629.00	81,775,800	
日清製粉グループ本社	193,800	1,619.00	313,762,200	
日東富士製粉	1,200	6,650.00	7,980,000	
昭和産業	15,700	3,070.00	48,199,000	貸付有価証券 7,200株
鳥越製粉	15,200	997.00	15,154,400	貸付有価証券 7,200株
中部飼料	21,000	1,426.00	29,946,000	
フィード・ワン	23,000	879.00	20,217,000	
東洋精糖	2,900	1,178.00	3,416,200	
日本甜菜製糖	8,900	1,626.00	14,471,400	
三井製糖	15,000	1,826.00	27,390,000	
塩水港精糖	18,600	220.00	4,092,000	貸付有価証券 9,500株
日新製糖	8,100	1,850.00	14,985,000	
森永製菓	40,300	3,895.00	156,968,500	貸付有価証券 100株
中村屋	4,400	3,995.00	17,578,000	
江崎グリコ	47,200	4,640.00	219,008,000	
名糖産業	8,200	1,503.00	12,324,600	
井村屋グループ	9,700	2,508.00	24,327,600	
不二家	10,900	2,420.00	26,378,000	貸付有価証券 5,800株
山崎製パン	128,600	1,792.00	230,451,200	貸付有価証券 2,500株
第一屋製パン	3,300	992.00	3,273,600	貸付有価証券 1,700株

モロゾフ	2,900	5,960.00	17,284,000	
亀田製菓	9,800	4,810.00	47,138,000	
寿スピリッツ	16,500	5,180.00	85,470,000	貸付有価証券 3,700株（300株）
カルビー	78,200	3,145.00	245,939,000	
森永乳業	31,700	5,100.00	161,670,000	
六甲バター	11,400	1,889.00	21,534,600	
ヤクルト本社	118,000	5,250.00	619,500,000	
明治ホールディングス	113,400	7,260.00	823,284,000	
雪印メグミルク	41,300	2,212.00	91,355,600	貸付有価証券 600株
プリマハム	26,800	3,225.00	86,430,000	貸付有価証券 300株
日本ハム	65,600	4,530.00	297,168,000	
林兼産業	5,700	570.00	3,249,000	
丸大食品	18,300	1,693.00	30,981,900	
S Foods	13,700	3,350.00	45,895,000	
柿安本店	5,900	2,599.00	15,334,100	
伊藤ハム米久ホールディングス	110,400	681.00	75,182,400	貸付有価証券 5,400株
サッポロホールディングス	58,500	2,083.00	121,855,500	貸付有価証券 100株
アサヒグループホールディングス	374,700	4,277.00	1,602,591,900	
キリンホールディングス	727,500	2,441.50	1,776,191,250	
宝ホールディングス	127,200	1,248.00	158,745,600	
オエノンホールディングス	48,700	407.00	19,820,900	貸付有価証券 7,400株
養命酒製造	5,300	1,899.00	10,064,700	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	131,300	1,615.00	212,049,500	
サントリー食品インターナショナル	114,800	3,770.00	432,796,000	
ダイトーグループホールディングス	8,800	5,360.00	47,168,000	貸付有価証券 4,200株（3,800株）
伊藤園	52,100	6,570.00	342,297,000	貸付有価証券 3,100株
キーコーヒー	16,900	2,152.00	36,368,800	
ユニカフェ	5,200	1,221.00	6,349,200	貸付有価証券 2,700株

ジャパンフーズ	2,400	1,209.00	2,901,600	
日清オイリオグループ	22,100	3,070.00	67,847,000	
不二製油グループ本社	41,800	2,938.00	122,808,400	貸付有価証券 700株
かどや製油	1,900	3,885.00	7,381,500	
J - オイルミルズ	8,900	3,535.00	31,461,500	
キッコーマン	123,500	6,920.00	854,620,000	貸付有価証券 1,900株
味の素	378,800	2,286.00	865,936,800	
キューピー	95,500	2,257.00	215,543,500	貸付有価証券 200株
ハウス食品グループ本社	64,200	3,885.00	249,417,000	
カゴメ	70,100	3,705.00	259,720,500	貸付有価証券 100株
焼津水産化学工業	8,300	1,003.00	8,324,900	
アリアケジャパン	15,700	7,330.00	115,081,000	
ピエトロ	2,200	1,702.00	3,744,400	
エバラ食品工業	4,200	2,460.00	10,332,000	
やまみ	1,500	2,119.00	3,178,500	
ニチレイ	81,700	2,871.00	234,560,700	
東洋水産	88,300	5,070.00	447,681,000	貸付有価証券 1,000株
イトアンドホールディングス	5,900	1,803.00	10,637,700	
大冷	2,200	1,970.00	4,334,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,500	746.00	7,087,000	貸付有価証券 3,100株
日清食品ホールディングス	72,900	8,760.00	638,604,000	貸付有価証券 1,100株
永谷園ホールディングス	8,400	2,265.00	19,026,000	
一正蒲鉾	6,700	1,248.00	8,361,600	
フジッコ	18,600	2,010.00	37,386,000	
ロック・フィールド	18,500	1,585.00	29,322,500	貸付有価証券 1,600株
日本たばこ産業	919,700	2,186.00	2,010,464,200	
ケンコーマヨネーズ	9,600	1,862.00	17,875,200	
わらべや日洋ホールディングス	11,200	1,430.00	16,016,000	貸付有価証券 100株
なとり	9,600	1,907.00	18,307,200	貸付有価証券

				4,200株
イフジ産業	3,000	875.00	2,625,000	
ピククルスコーポレーション	3,800	3,205.00	12,179,000	
北の達人コーポレーション	59,900	456.00	27,314,400	貸付有価証券 29,900株(25,200株)
ユーグレナ	74,100	754.00	55,871,400	貸付有価証券 37,000株(16,400株)
ミヨシ油脂	6,000	1,344.00	8,064,000	貸付有価証券 2,800株
理研ビタミン	16,200	1,375.00	22,275,000	
片倉工業	22,400	1,362.00	30,508,800	貸付有価証券 10,500株
グンゼ	12,300	3,380.00	41,574,000	
東洋紡	66,200	1,378.00	91,223,600	
ユニチカ	49,000	387.00	18,963,000	貸付有価証券 8,700株(8,700株)
富士紡ホールディングス	8,100	3,775.00	30,577,500	
倉敷紡績	16,600	1,821.00	30,228,600	
シキボウ	8,800	1,011.00	8,896,800	
日本毛織	55,100	1,013.00	55,816,300	貸付有価証券 100株
ダイトウボウ	27,100	106.00	2,872,600	貸付有価証券 12,700株(7,100株)
トーア紡コーポレーション	6,600	488.00	3,220,800	
ダイドーリミテッド	22,000	169.00	3,718,000	貸付有価証券 100株
帝国繊維	18,900	2,528.00	47,779,200	貸付有価証券 8,900株
帝人	136,500	1,928.00	263,172,000	貸付有価証券 400株
東レ	1,212,000	607.10	735,805,200	
サカイオーボックス	4,400	2,165.00	9,526,000	
住江織物	3,700	2,181.00	8,069,700	
日本フェルト	9,500	440.00	4,180,000	貸付有価証券 4,800株
イチカワ	2,400	1,273.00	3,055,200	
日東製網	1,900	1,446.00	2,747,400	
アツギ	13,800	500.00	6,900,000	

ダイニック	6,300	849.00	5,348,700	
セーレン	41,200	1,575.00	64,890,000	貸付有価証券 14,800株
ソトー	6,700	805.00	5,393,500	
東海染工	2,300	1,132.00	2,603,600	
小松マテール	27,500	964.00	26,510,000	
ワコールホールディングス	41,800	2,083.00	87,069,400	
ホギメディカル	19,100	3,355.00	64,080,500	
クラウドシアホールディングス	4,100	248.00	1,016,800	
T S I ホールディングス	50,800	203.00	10,312,400	
マツオカコーポレーション	4,800	2,112.00	10,137,600	貸付有価証券 800株（800株）
ワールド	23,700	1,235.00	29,269,500	
三陽商会	8,700	557.00	4,845,900	貸付有価証券 4,700株（100株）
ナイガイ	6,100	339.00	2,067,900	
オンワードホールディングス	100,600	202.00	20,321,200	
ルックホールディングス	5,700	1,007.00	5,739,900	貸付有価証券 2,700株
ゴールドウイン	30,200	6,850.00	206,870,000	
デサント	32,700	1,832.00	59,906,400	
キング	7,900	535.00	4,226,500	
ヤマトインターナショナル	14,700	323.00	4,748,100	
特種東海製紙	10,300	5,000.00	51,500,000	
王子ホールディングス	699,700	594.00	415,621,800	貸付有価証券 100株
日本製紙	74,000	1,200.00	88,800,000	貸付有価証券 19,400株（1,800株）
三菱製紙	19,000	314.00	5,966,000	
北越コーポレーション	99,800	410.00	40,918,000	貸付有価証券 200株
中越パルプ工業	7,100	1,213.00	8,612,300	
巴川製紙所	5,000	755.00	3,775,000	
大王製紙	80,700	1,990.00	160,593,000	
阿波製紙	4,300	425.00	1,827,500	

レンゴー	158,200	884.00	139,848,800	貸付有価証券 8,800株
トーモク	10,300	1,723.00	17,746,900	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
ザ・パック	12,700	2,817.00	35,775,900	貸付有価証券 6,000株
クラレ	263,600	1,092.00	287,851,200	
旭化成	1,109,500	1,036.00	1,149,442,000	貸付有価証券 66,800株
共和レザー	9,100	636.00	5,787,600	
昭和電工	127,100	2,225.00	282,797,500	
住友化学	1,229,800	400.00	491,920,000	
住友精化	7,400	4,070.00	30,118,000	
日産化学	92,300	6,150.00	567,645,000	
ラサ工業	5,900	2,290.00	13,511,000	
クレハ	14,400	7,170.00	103,248,000	貸付有価証券 500株
多木化学	6,500	6,580.00	42,770,000	貸付有価証券 3,000株
テイカ	12,300	1,571.00	19,323,300	
石原産業	30,000	619.00	18,570,000	
片倉コープアグリ	4,300	1,192.00	5,125,600	
日本曹達	24,800	3,040.00	75,392,000	
東ソー	258,700	1,627.00	420,904,900	
トクヤマ	48,200	2,303.00	111,004,600	貸付有価証券 100株
セントラル硝子	34,200	2,313.00	79,104,600	
東亜合成	105,100	1,244.00	130,744,400	
大阪ソーダ	17,000	2,741.00	46,597,000	
関東電化工業	39,700	794.00	31,521,800	
デンカ	61,100	3,975.00	242,872,500	
信越化学工業	287,400	17,870.00	5,135,838,000	貸付有価証券 7,400株
日本カーバイド工業	5,900	1,274.00	7,516,600	
堺化学工業	10,800	1,938.00	20,930,400	
第一稀元素化学工業	18,100	850.00	15,385,000	
エア・ウォーター	155,700	1,824.00	283,996,800	
日本酸素ホールディングス	160,900	1,866.00	300,239,400	貸付有価証券 6,600株

日本化学工業	5,200	2,741.00	14,253,200	
東邦アセチレン	2,500	1,397.00	3,492,500	貸付有価証券 1,100株
日本パーカライズン	84,400	1,055.00	89,042,000	
高圧ガス工業	26,500	801.00	21,226,500	
チタン工業	2,100	1,968.00	4,132,800	
四国化成工業	24,500	1,209.00	29,620,500	
戸田工業	3,900	2,278.00	8,884,200	
ステラ ケミファ	9,100	3,175.00	28,892,500	
保土谷化学工業	6,300	4,750.00	29,925,000	
日本触媒	26,000	5,760.00	149,760,000	
大日精化工業	14,800	2,379.00	35,209,200	貸付有価証券 100株
カネカ	43,300	3,615.00	156,529,500	貸付有価証券 100株
三菱瓦斯化学	155,700	2,339.00	364,182,300	貸付有価証券 100株
三井化学	155,300	3,020.00	469,006,000	貸付有価証券 100株
J S R	156,000	2,814.00	438,984,000	貸付有価証券 400株
東京応化工業	28,700	7,190.00	206,353,000	貸付有価証券 2,000株
大阪有機化学工業	15,500	3,155.00	48,902,500	貸付有価証券 500株
三菱ケミカルホールディングス	1,119,000	614.40	687,513,600	貸付有価証券 700株
K H ネオケム	27,600	2,756.00	76,065,600	
ダイセル	209,000	743.00	155,287,000	貸付有価証券 5,900株
住友ベークライト	26,300	3,480.00	91,524,000	
積水化学工業	354,000	1,914.00	677,556,000	
日本ゼオン	151,000	1,475.00	222,725,000	貸付有価証券 100株
アイカ工業	50,200	3,620.00	181,724,000	
宇部興産	84,500	1,863.00	157,423,500	貸付有価証券 1,000株
積水樹脂	30,100	2,192.00	65,979,200	
タキロンシーアイ	36,200	687.00	24,869,400	
旭有機材	9,500	1,500.00	14,250,000	

ニチバン	8,800	1,656.00	14,572,800	貸付有価証券 100株
リケンテクノス	40,800	454.00	18,523,200	
大倉工業	7,900	1,960.00	15,484,000	貸付有価証券 3,700株
積水化成工業	22,400	527.00	11,804,800	
群栄化学工業	3,800	2,325.00	8,835,000	
タイガースポリマー	8,800	400.00	3,520,000	
ミライアル	5,900	1,091.00	6,436,900	
ダイキアクシス	5,900	1,132.00	6,678,800	貸付有価証券 2,800株
ダイキョーニシカワ	35,300	832.00	29,369,600	貸付有価証券 200株
竹本容器	6,000	981.00	5,886,000	貸付有価証券 2,800株
森六ホールディングス	9,000	2,177.00	19,593,000	
日本化薬	103,600	953.00	98,730,800	
カーリットホールディングス	17,900	680.00	12,172,000	貸付有価証券 9,200株
日本精化	13,500	1,439.00	19,426,500	
扶桑化学工業	17,000	3,660.00	62,220,000	
トリケミカル研究所	3,700	16,050.00	59,385,000	
A D E K A	77,000	1,804.00	138,908,000	貸付有価証券 200株
日油	63,000	5,310.00	334,530,000	
新日本理化	27,700	232.00	6,426,400	貸付有価証券 13,100株
ハリマ化成グループ	13,800	1,047.00	14,448,600	
花王	409,200	7,934.00	3,246,592,800	
第一工業製薬	6,200	4,140.00	25,668,000	
石原ケミカル	4,500	2,248.00	10,116,000	
日華化学	5,600	863.00	4,832,800	貸付有価証券 2,700株
ニイタカ	3,500	2,921.00	10,223,500	
三洋化成工業	10,000	5,650.00	56,500,000	
有機合成薬品工業	12,800	300.00	3,840,000	貸付有価証券 2,000株
大日本塗料	18,900	959.00	18,125,100	貸付有価証券 100株

日本ペイントホールディングス	138,100	11,700.00	1,615,770,000	
関西ペイント	188,100	3,185.00	599,098,500	貸付有価証券 2,000株
神東塗料	13,200	205.00	2,706,000	
中国塗料	47,600	1,028.00	48,932,800	貸付有価証券 200株
日本特殊塗料	12,500	1,231.00	15,387,500	
藤倉化成	22,600	555.00	12,543,000	
太陽ホールディングス	12,300	6,150.00	75,645,000	
D I C	70,700	2,665.00	188,415,500	
サカタインクス	36,500	1,177.00	42,960,500	
東洋インキ S C ホールディングス	35,400	2,040.00	72,216,000	
T & K T O K A	13,000	883.00	11,479,000	
富士フイルムホールディングス	327,700	5,419.00	1,775,806,300	貸付有価証券 9,100株
資生堂	339,600	6,905.00	2,344,938,000	
ライオン	222,200	2,566.00	570,165,200	
高砂香料工業	10,700	2,397.00	25,647,900	
マンダム	38,400	1,667.00	64,012,800	
ミルボン	22,800	6,510.00	148,428,000	貸付有価証券 100株
ファンケル	69,200	4,050.00	280,260,000	貸付有価証券 1,100株
コーセー	32,200	17,450.00	561,890,000	貸付有価証券 700株
コタ	9,800	1,405.00	13,769,000	
シーボン	2,200	1,880.00	4,136,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	72,900	2,060.00	150,174,000	貸付有価証券 34,400株
ノエビアホールディングス	14,500	4,610.00	66,845,000	
アジュバンコスメジャパン	3,800	1,013.00	3,849,400	
エステー	11,000	1,948.00	21,428,000	
アグロ カネショウ	6,400	1,734.00	11,097,600	貸付有価証券 3,000株
コニシ	28,100	1,698.00	47,713,800	
長谷川香料	29,500	2,170.00	64,015,000	

星光PMC	9,800	697.00	6,830,600	
小林製薬	47,900	12,760.00	611,204,000	
荒川化学工業	15,300	1,174.00	17,962,200	
メック	11,700	2,281.00	26,687,700	貸付有価証券 5,500株(300株)
日本高純度化学	4,700	2,728.00	12,821,600	
タカラバイオ	44,700	2,686.00	120,064,200	貸付有価証券 1,200株
JCU	20,700	3,870.00	80,109,000	
新田ゼラチン	10,700	645.00	6,901,500	
OATアグリオ	3,200	1,466.00	4,691,200	貸付有価証券 1,500株
デクセリアルズ	44,200	1,341.00	59,272,200	貸付有価証券 800株
アース製薬	12,900	5,960.00	76,884,000	
北興化学工業	15,900	1,159.00	18,428,100	
大成ラミック	5,600	3,215.00	18,004,000	
クミアイ化学工業	70,700	927.00	65,538,900	
日本農薬	30,400	501.00	15,230,400	
アキレス	11,800	1,430.00	16,874,000	
有沢製作所	27,000	975.00	26,325,000	
日東電工	117,900	8,910.00	1,050,489,000	貸付有価証券 2,800株
レック	18,200	1,335.00	24,297,000	
三光合成	19,500	337.00	6,571,500	貸付有価証券 9,200株
きもと	29,100	175.00	5,092,500	貸付有価証券 100株
藤森工業	15,300	4,800.00	73,440,000	
前澤化成工業	10,900	976.00	10,638,400	
未来工業	9,200	1,695.00	15,594,000	貸付有価証券 100株
ウェーブロックホールディングス	5,900	720.00	4,248,000	
JSP	10,000	1,718.00	17,180,000	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	35,900	4,360.00	156,524,000	
天馬	11,400	2,040.00	23,256,000	
信越ポリマー	30,700	937.00	28,765,900	

東リ	42,600	252.00	10,735,200	
ニフコ	62,800	3,975.00	249,630,000	
バルカー	13,900	2,015.00	28,008,500	
ユニ・チャーム	362,400	4,957.00	1,796,416,800	
ショーエイコーポレーション	2,800	988.00	2,766,400	貸付有価証券 200株
協和キリン	171,900	2,809.00	482,867,100	
武田薬品工業	1,422,000	3,696.00	5,255,712,000	貸付有価証券 56,200株
アステラス製薬	1,481,800	1,559.50	2,310,867,100	貸付有価証券 30,500株
大日本住友製薬	126,700	1,293.00	163,823,100	
塩野義製薬	214,900	5,556.00	1,193,984,400	貸付有価証券 6,900株
わかもと製薬	20,300	251.00	5,095,300	
あすか製薬	19,500	1,600.00	31,200,000	
日本新薬	44,700	6,760.00	302,172,000	
ピオフェルミン製薬	2,900	2,530.00	7,337,000	
中外製薬	534,600	5,406.00	2,890,047,600	
科研製薬	29,300	3,920.00	114,856,000	貸付有価証券 300株
エーザイ	204,600	7,239.00	1,481,099,400	貸付有価証券 5,400株
ロート製薬	87,700	3,015.00	264,415,500	
小野薬品工業	392,500	3,207.00	1,258,747,500	
久光製薬	45,200	6,180.00	279,336,000	貸付有価証券 100株
持田製薬	23,700	3,885.00	92,074,500	
参天製薬	318,500	1,653.00	526,480,500	貸付有価証券 300株
扶桑薬品工業	6,000	2,780.00	16,680,000	
日本ケミファ	2,300	2,211.00	5,085,300	
ツムラ	52,900	3,065.00	162,138,500	
日医工	48,400	952.00	46,076,800	貸付有価証券 3,000株（2,700株）
キッセイ薬品工業	30,200	2,241.00	67,678,200	
生化学工業	33,200	997.00	33,100,400	
栄研化学	30,000	2,059.00	61,770,000	貸付有価証券 200株

日水製薬	7,200	954.00	6,868,800	
鳥居薬品	10,700	3,215.00	34,400,500	
J C R ファーマ	48,200	2,353.00	113,414,600	
東和薬品	21,900	1,922.00	42,091,800	
富士製薬工業	11,600	1,208.00	14,012,800	貸付有価証券 100株
沢井製薬	35,100	4,670.00	163,917,000	
ゼリア新薬工業	31,000	1,907.00	59,117,000	貸付有価証券 900株
第一三共	1,467,200	3,465.00	5,083,848,000	貸付有価証券 48,000株
キョーリン製薬ホールディングス	37,700	1,934.00	72,911,800	
大幸薬品	21,000	1,614.00	33,894,000	貸付有価証券 8,300株
ダイト	10,900	3,685.00	40,166,500	
大塚ホールディングス	355,200	4,474.00	1,589,164,800	
大正製薬ホールディングス	36,100	6,950.00	250,895,000	
ペプチドリーム	86,900	5,270.00	457,963,000	貸付有価証券 2,700株
日本コークス工業	144,400	85.00	12,274,000	貸付有価証券 200株
ニチレキ	20,200	1,574.00	31,794,800	
ユシロ化学工業	9,600	1,095.00	10,512,000	
ビーピー・カストロール	6,100	1,293.00	7,887,300	
富士石油	45,600	171.00	7,797,600	
MORESCO	6,200	1,004.00	6,224,800	
出光興産	189,700	2,235.00	423,979,500	
ENEOSホールディングス	2,571,000	365.90	940,728,900	
コスモエネルギーホールディングス	49,500	1,804.00	89,298,000	
横浜ゴム	99,000	1,578.00	156,222,000	
TOYO TIRE	90,000	1,580.00	142,200,000	
ブリヂストン	454,400	3,433.00	1,559,955,200	
住友ゴム工業	153,500	910.00	139,685,000	貸付有価証券 100株
藤倉コンポジット	14,900	368.00	5,483,200	

オカモト	10,400	3,940.00	40,976,000	
フコク	7,500	683.00	5,122,500	貸付有価証券 1,300株
ニッタ	19,300	2,262.00	43,656,600	
住友理工	33,100	620.00	20,522,000	
三ツ星ベルト	22,500	1,698.00	38,205,000	
バンドー化学	30,100	640.00	19,264,000	
日東紡績	25,400	4,460.00	113,284,000	貸付有価証券 1,500株
A G C	156,900	3,700.00	580,530,000	
日本板硝子	81,800	459.00	37,546,200	貸付有価証券 15,000株(10,100株)
石塚硝子	3,100	1,907.00	5,911,700	
日本山村硝子	7,100	850.00	6,035,000	貸付有価証券 100株
日本電気硝子	63,400	2,280.00	144,552,000	貸付有価証券 100株
オハラ	6,800	1,636.00	11,124,800	貸付有価証券 1,200株(300株)
住友大阪セメント	32,300	3,010.00	97,223,000	
太平洋セメント	107,900	2,553.00	275,468,700	
日本ヒューム	17,100	809.00	13,833,900	
日本コンクリート工業	36,800	307.00	11,297,600	
三谷セキサン	8,000	4,415.00	35,320,000	
アジアパイルホールディングス	24,300	467.00	11,348,100	
東海カーボン	167,100	1,277.00	213,386,700	貸付有価証券 40,100株(4,900株)
日本カーボン	9,400	4,055.00	38,117,000	貸付有価証券 100株
東洋炭素	10,000	2,056.00	20,560,000	
ノリタケカンパニーリミテド	9,500	3,015.00	28,642,500	
T O T O	122,100	6,100.00	744,810,000	
日本碍子	205,200	1,560.00	320,112,000	貸付有価証券 300株
日本特殊陶業	130,000	1,756.00	228,280,000	
ダントーホールディングス	12,700	463.00	5,880,100	貸付有価証券 6,800株
M A R U W A	6,600	11,670.00	77,022,000	

品川リフラクトリーズ	4,500	2,500.00	11,250,000	
黒崎播磨	3,400	3,960.00	13,464,000	
ヨータイ	13,600	850.00	11,560,000	貸付有価証券 500株
イソライト工業	8,800	487.00	4,285,600	
東京窯業	21,700	349.00	7,573,300	
ニッカトー	7,700	757.00	5,828,900	
フジミインコーポレー テッド	15,200	3,800.00	57,760,000	
クニミネ工業	6,900	1,077.00	7,431,300	貸付有価証券 100株
エーアンドエーマテリア ル	2,900	1,007.00	2,920,300	
ニチアス	46,800	2,405.00	112,554,000	
ニチハ	23,800	3,245.00	77,231,000	
日本製鉄	756,400	1,335.00	1,009,794,000	
神戸製鋼所	309,300	545.00	168,568,500	貸付有価証券 9,000株
中山製鋼所	23,400	382.00	8,938,800	
合同製鐵	9,100	1,946.00	17,708,600	
ジェイ エフ イー ホールディングス	456,400	1,010.00	460,964,000	貸付有価証券 200株
東京製鐵	82,300	681.00	56,046,300	貸付有価証券 800株
共英製鋼	19,100	1,443.00	27,561,300	貸付有価証券 9,800株
大和工業	35,900	2,757.00	98,976,300	
東京鐵鋼	7,000	1,998.00	13,986,000	
大阪製鐵	9,000	1,259.00	11,331,000	
淀川製鋼所	22,800	2,105.00	47,994,000	
丸一鋼管	54,900	2,289.00	125,666,100	
モリ工業	5,100	2,367.00	12,071,700	
大同特殊鋼	27,700	4,295.00	118,971,500	
日本高周波鋼業	6,200	324.00	2,008,800	
日本冶金工業	14,000	1,737.00	24,318,000	貸付有価証券 200株
山陽特殊製鋼	11,600	1,259.00	14,604,400	
愛知製鋼	9,500	2,756.00	26,182,000	
日立金属	182,100	1,600.00	291,360,000	貸付有価証券

				100株
日本金属	3,900	1,480.00	5,772,000	貸付有価証券 1,800株
大平洋金属	11,400	2,176.00	24,806,400	貸付有価証券 400株
新日本電工	109,000	293.00	31,937,000	貸付有価証券 18,000株(4,000株)
栗本鐵工所	8,300	1,610.00	13,363,000	
虹技	2,500	1,055.00	2,637,500	
日本鑄鉄管	1,700	1,216.00	2,067,200	
三菱製鋼	12,500	624.00	7,800,000	貸付有価証券 100株
日亜鋼業	24,700	293.00	7,237,100	
日本精線	2,800	3,715.00	10,402,000	
エンビプロ・ホールディングス	7,200	650.00	4,680,000	
シンニッタン	26,300	198.00	5,207,400	貸付有価証券 400株
新家工業	3,800	1,220.00	4,636,000	
大紀アルミニウム工業所	27,800	769.00	21,378,200	
日本軽金属ホールディングス	42,800	1,893.00	81,020,400	
三井金属鉱業	45,600	3,775.00	172,140,000	
東邦亜鉛	8,700	2,352.00	20,462,400	
三菱マテリアル	111,600	2,213.00	246,970,800	
住友金属鉱山	216,000	4,579.00	989,064,000	
DOWAホールディングス	42,800	3,740.00	160,072,000	
古河機械金属	30,000	1,224.00	36,720,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	17,600	838.00	14,748,800	貸付有価証券 5,300株(300株)
東邦チタニウム	30,300	898.00	27,209,400	
UACJ	25,600	1,877.00	48,051,200	
CKサンエツ	3,500	3,850.00	13,475,000	
古河電気工業	52,500	2,758.00	144,795,000	
住友電気工業	631,900	1,392.00	879,604,800	
フジクラ	204,100	470.00	95,927,000	貸付有価証券 200株
昭和電線ホールディング	19,600	1,699.00	33,300,400	

ス				
東京特殊電線	2,500	2,394.00	5,985,000	
タツタ電線	33,500	719.00	24,086,500	
カナレ電気	2,800	1,811.00	5,070,800	貸付有価証券 1,500株
平河ヒューテック	8,400	1,224.00	10,281,600	
リョービ	20,800	1,243.00	25,854,400	貸付有価証券 400株
アーレスティ	22,100	338.00	7,469,800	
アサヒホールディングス	29,600	3,560.00	105,376,000	
稲葉製作所	9,500	1,378.00	13,091,000	貸付有価証券 5,100株
宮地エンジニアリンググループ	5,100	2,395.00	12,214,500	
トーカロ	46,900	1,421.00	66,644,900	
アルファC o	6,000	991.00	5,946,000	
SUMCO	216,300	2,188.00	473,264,400	
川田テクノロジーズ	3,500	4,130.00	14,455,000	
RS Technologies	5,500	5,600.00	30,800,000	
ジェイテックコーポレーション	1,200	3,515.00	4,218,000	
信和	9,700	673.00	6,528,100	
東洋製罐グループホールディングス	107,600	1,160.00	124,816,000	
ホッカンホールディングス	9,300	1,416.00	13,168,800	
コロナ	9,300	945.00	8,788,500	
横河ブリッジホールディングス	31,400	2,162.00	67,886,800	
駒井ハルテック	3,200	2,169.00	6,940,800	
高田機工	1,500	2,517.00	3,775,500	
三和ホールディングス	159,300	1,199.00	191,000,700	
文化シャッター	49,800	953.00	47,459,400	貸付有価証券 100株
三協立山	21,800	803.00	17,505,400	
アルインコ	12,300	930.00	11,439,000	
東洋シャッター	4,100	720.00	2,952,000	
LIXIL	249,400	2,236.00	557,658,400	貸付有価証券

				8,000株
日本ファイルコン	11,800	505.00	5,959,000	
ノーリツ	35,000	1,644.00	57,540,000	
長府製作所	17,200	2,080.00	35,776,000	貸付有価証券 8,100株
リンナイ	32,900	12,050.00	396,445,000	
ダイニチ工業	9,100	927.00	8,435,700	
日東精工	21,200	454.00	9,624,800	
三洋工業	2,200	1,860.00	4,092,000	
岡部	34,300	758.00	25,999,400	貸付有価証券 16,200株
ジーテクト	21,000	1,529.00	32,109,000	貸付有価証券 300株
東プレ	31,500	1,570.00	49,455,000	
高周波熱錬	32,500	483.00	15,697,500	貸付有価証券 16,700株
東京製綱	12,100	737.00	8,917,700	貸付有価証券 600株
サンコール	12,700	466.00	5,918,200	
モリテック スチール	13,200	479.00	6,322,800	貸付有価証券 6,200株
パイオラックス	25,000	1,602.00	40,050,000	
エイチワン	16,600	835.00	13,861,000	
日本発條	181,300	712.00	129,085,600	貸付有価証券 100株
中央発條	2,000	2,963.00	5,926,000	
アドバネクス	2,400	1,308.00	3,139,200	
立川ブラインド工業	7,400	1,304.00	9,649,600	貸付有価証券 3,500株
三益半導体工業	13,200	2,561.00	33,805,200	
日本ドライケミカル	4,200	1,576.00	6,619,200	
日本製鋼所	51,300	2,954.00	151,540,200	貸付有価証券 600株
三浦工業	73,100	5,580.00	407,898,000	
タクマ	57,300	1,837.00	105,260,100	
ツガミ	35,000	1,581.00	55,335,000	
オークマ	19,700	5,570.00	109,729,000	
芝浦機械	19,100	2,330.00	44,503,000	
アマダ	209,600	1,095.00	229,512,000	

アイダエンジニアリング	44,200	948.00	41,901,600	
滝澤鉄工所	5,200	985.00	5,122,000	
F U J I	72,700	2,666.00	193,818,200	貸付有価証券 600株
牧野フライス製作所	19,800	3,750.00	74,250,000	貸付有価証券 100株
オーエスジー	83,400	1,936.00	161,462,400	貸付有価証券 1,000株
ダイジェット工業	1,900	1,409.00	2,677,100	
旭ダイヤモンド工業	44,300	439.00	19,447,700	
D M G 森精機	106,900	1,584.00	169,329,600	貸付有価証券 100株
ソディック	36,800	890.00	32,752,000	貸付有価証券 400株
ディスコ	22,900	33,800.00	774,020,000	
日東工器	9,300	1,745.00	16,228,500	
日進工具	6,600	2,607.00	17,206,200	
パンチ工業	15,300	414.00	6,334,200	
富士ダイス	7,400	642.00	4,750,800	
豊和工業	9,300	914.00	8,500,200	
O K K	6,900	407.00	2,808,300	
東洋機械金属	12,100	405.00	4,900,500	
津田駒工業	3,300	815.00	2,689,500	
エンシュウ	4,000	886.00	3,544,000	
島精機製作所	26,600	1,691.00	44,980,600	
オプトラン	21,200	2,138.00	45,325,600	
N C ホールディングス	5,100	540.00	2,754,000	
イワキポンプ	10,700	810.00	8,667,000	
フリュー	16,500	1,107.00	18,265,500	
ヤマシンフィルタ	37,800	1,095.00	41,391,000	貸付有価証券 2,000株
日阪製作所	20,800	844.00	17,555,200	
やまびこ	32,800	1,338.00	43,886,400	
平田機工	8,000	7,590.00	60,720,000	貸付有価証券 400株
ペガサスミシン製造	17,100	331.00	5,660,100	貸付有価証券 300株
マルマエ	6,200	1,283.00	7,954,600	

タツモ	7,200	1,382.00	9,950,400	
ナブテスコ	99,600	4,520.00	450,192,000	貸付有価証券 200株
三井海洋開発	18,000	1,895.00	34,110,000	貸付有価証券 200株
レオン自動機	16,600	1,250.00	20,750,000	
S M C	53,600	63,290.00	3,392,344,000	
ホソカワミクロン	5,900	6,260.00	36,934,000	
ユニオンツール	6,300	3,140.00	19,782,000	
オイレス工業	21,800	1,644.00	35,839,200	
日精エー・エス・ビー機 械	4,900	5,700.00	27,930,000	
サトーホールディングス	24,100	2,225.00	53,622,500	
技研製作所	14,900	4,270.00	63,623,000	
日本エアテック	5,500	1,674.00	9,207,000	貸付有価証券 100株
カワタ	5,000	959.00	4,795,000	貸付有価証券 2,500株
日精樹脂工業	14,200	881.00	12,510,200	
オカダアイヨン	5,300	1,078.00	5,713,400	
ワイエイシイホールディ ングス	7,200	1,056.00	7,603,200	貸付有価証券 100株
小松製作所	774,100	2,771.50	2,145,418,150	
住友重機械工業	97,800	2,470.00	241,566,000	貸付有価証券 400株
日立建機	68,500	2,862.00	196,047,000	
日工	23,300	719.00	16,752,700	
巴工業	6,700	1,991.00	13,339,700	
井関農機	17,100	1,367.00	23,375,700	
T O W A	17,300	1,955.00	33,821,500	
丸山製作所	3,500	1,488.00	5,208,000	
北川鉄工所	7,700	1,361.00	10,479,700	
ローツェ	7,500	6,450.00	48,375,000	
タカキタ	5,900	752.00	4,436,800	
クボタ	897,800	2,259.50	2,028,579,100	
荏原実業	4,300	4,115.00	17,694,500	
三菱化工機	5,900	2,956.00	17,440,400	
月島機械	31,500	1,407.00	44,320,500	

帝国電機製作所	14,100	1,213.00	17,103,300	貸付有価証券 100株
東京機械製作所	6,900	255.00	1,759,500	
新東工業	40,500	794.00	32,157,000	
澁谷工業	14,900	3,605.00	53,714,500	
アイチ コーポレーショ ン	29,500	916.00	27,022,000	
小森コーポレーション	43,300	702.00	30,396,600	
鶴見製作所	13,100	1,799.00	23,566,900	
住友精密工業	2,500	1,916.00	4,790,000	
日本ギア工業	6,800	289.00	1,965,200	
酒井重工業	3,200	2,337.00	7,478,400	
荏原製作所	70,900	3,345.00	237,160,500	
石井鐵工所	2,200	2,855.00	6,281,000	
西島製作所	17,200	876.00	15,067,200	
北越工業	17,600	1,066.00	18,761,600	
ダイキン工業	217,700	22,795.00	4,962,471,500	貸付有価証券 4,600株
オルガノ	6,100	6,020.00	36,722,000	
トーヨーカネツ	7,400	2,077.00	15,369,800	
栗田工業	92,500	3,960.00	366,300,000	
椿本チエイン	24,400	2,740.00	66,856,000	
大同工業	8,100	735.00	5,953,500	
木村化工機	14,200	588.00	8,349,600	貸付有価証券 300株
アネスト岩田	26,600	1,066.00	28,355,600	
ダイフク	87,300	12,610.00	1,100,853,000	貸付有価証券 100株
サムコ	4,300	3,755.00	16,146,500	貸付有価証券 1,000株（800株）
加藤製作所	9,300	971.00	9,030,300	
油研工業	2,900	1,514.00	4,390,600	
タダノ	82,500	880.00	72,600,000	貸付有価証券 2,600株
フジテック	62,100	2,169.00	134,694,900	
C K D	46,800	2,202.00	103,053,600	
キトー	12,900	1,474.00	19,014,600	
平和	47,700	1,420.00	67,734,000	

理想科学工業	15,100	1,363.00	20,581,300	
SANKYO	38,000	2,793.00	106,134,000	
日本金銭機械	18,900	500.00	9,450,000	
マースグループホールディングス	10,800	1,555.00	16,794,000	
フクシマガリレイ	10,500	4,430.00	46,515,000	
オーイズミ	7,200	404.00	2,908,800	
ダイコク電機	7,800	844.00	6,583,200	
竹内製作所	28,600	2,395.00	68,497,000	
アマノ	44,700	2,435.00	108,844,500	貸付有価証券 400株
JUKI	23,800	522.00	12,423,600	
蛇の目マシン工業	15,500	923.00	14,306,500	貸付有価証券 1,000株
マックス	26,100	1,440.00	37,584,000	
グローリー	43,900	2,092.00	91,838,800	
新晃工業	15,900	1,715.00	27,268,500	
大和冷機工業	27,400	1,062.00	29,098,800	貸付有価証券 700株
セガサミーホールディングス	169,500	1,648.00	279,336,000	貸付有価証券 100株
日本ピストンリング	6,200	911.00	5,648,200	
リケン	7,900	2,182.00	17,237,800	
TPR	23,000	1,445.00	33,235,000	貸付有価証券 200株
ツバキ・ナカシマ	32,700	1,118.00	36,558,600	
ホシザキ	53,800	9,520.00	512,176,000	
大豊工業	13,900	731.00	10,160,900	
日本精工	321,800	899.00	289,298,200	貸付有価証券 1,500株
NTN	395,500	264.00	104,412,000	貸付有価証券 2,500株
ジェイテクト	163,900	804.00	131,775,600	
不二越	15,900	4,285.00	68,131,500	
日本トムソン	50,700	388.00	19,671,600	
THK	106,500	3,250.00	346,125,000	
ユーシン精機	13,200	940.00	12,408,000	
前澤給装工業	6,200	2,328.00	14,433,600	

イーグル工業	21,100	1,000.00	21,100,000	
前澤工業	11,400	449.00	5,118,600	
日本ピラー工業	17,300	1,528.00	26,434,400	
キット	62,400	629.00	39,249,600	
マキタ	222,900	5,150.00	1,147,935,000	貸付有価証券 100株
日立造船	135,500	591.00	80,080,500	貸付有価証券 1,300株
三菱重工業	286,400	3,046.00	872,374,400	貸付有価証券 1,200株
I H I	123,100	1,928.00	237,336,800	
スター精密	26,300	1,630.00	42,869,000	
日清紡ホールディングス	104,500	773.00	80,778,500	貸付有価証券 300株
イビデン	104,600	4,805.00	502,603,000	貸付有価証券 500株
コニカミノルタ	373,400	387.00	144,505,800	貸付有価証券 13,700株
ブラザー工業	208,700	2,123.00	443,070,100	貸付有価証券 1,000株
ミネベアミツミ	317,300	2,028.00	643,484,400	貸付有価証券 100株
日立製作所	821,200	4,045.00	3,321,754,000	貸付有価証券 21,100株
三菱電機	1,709,000	1,572.50	2,687,402,500	貸付有価証券 53,400株
富士電機	103,000	3,640.00	374,920,000	貸付有価証券 400株
東洋電機製造	6,200	1,147.00	7,111,400	
安川電機	184,000	5,110.00	940,240,000	
シンフォニアテクノロジー	22,100	1,398.00	30,895,800	
明電舎	31,400	2,233.00	70,116,200	貸付有価証券 100株
オリジン	4,600	1,304.00	5,998,400	
山洋電気	8,300	5,300.00	43,990,000	
デンヨー	14,600	2,079.00	30,353,400	
東芝テック	21,400	3,725.00	79,715,000	
芝浦メカトロニクス	3,000	4,245.00	12,735,000	
マブチモーター	47,300	4,465.00	211,194,500	

日本電産	411,300	12,920.00	5,313,996,000	貸付有価証券 14,300株
ユー・エム・シー・エレ クトロニクス	10,200	415.00	4,233,000	貸付有価証券 500株(100株)
トレックス・セミコンダ クター	9,800	1,326.00	12,994,800	
東光高岳	9,500	1,625.00	15,437,500	
ダブル・スコープ	28,300	895.00	25,328,500	貸付有価証券 13,300株(100株)
ダイヘン	18,700	4,930.00	92,191,000	
ヤーマン	27,900	1,851.00	51,642,900	
JVCケンウッド	139,200	161.00	22,411,200	貸付有価証券 100株
ミマキエンジニアリング	15,300	464.00	7,099,200	貸付有価証券 200株
I - P E X	7,900	1,941.00	15,333,900	貸付有価証券 3,200株
日新電機	40,100	1,164.00	46,676,400	
大崎電気工業	34,000	572.00	19,448,000	貸付有価証券 400株
オムロン	153,200	9,150.00	1,401,780,000	
日東工業	25,100	2,027.00	50,877,700	
I D E C	24,700	1,760.00	43,472,000	
正興電機製作所	4,000	2,124.00	8,496,000	貸付有価証券 1,900株
不二電機工業	2,800	1,314.00	3,679,200	
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	57,100	2,957.00	168,844,700	貸付有価証券 1,500株
サクサホールディングス	4,000	1,329.00	5,316,000	
メルコホールディングス	5,900	3,260.00	19,234,000	
テクノメディカ	3,800	1,604.00	6,095,200	
ダイヤモンドエレクト リックホールディング	3,700	1,134.00	4,195,800	貸付有価証券 100株
日本電気	207,300	5,430.00	1,125,639,000	
富士通	164,800	14,545.00	2,397,016,000	
沖電気工業	69,400	899.00	62,390,600	貸付有価証券 100株
岩崎通信機	7,500	839.00	6,292,500	
電気興業	8,200	2,642.00	21,664,400	
サンケン電気	18,600	4,370.00	81,282,000	

ナカヨ	3,300	1,427.00	4,709,100	
アイホン	9,700	1,697.00	16,460,900	貸付有価証券 100株
ルネサスエレクトロニクス	732,500	1,065.00	780,112,500	貸付有価証券 100株
セイコーエプソン	212,100	1,566.00	332,148,600	貸付有価証券 2,800株
ワコム	114,900	868.00	99,733,200	貸付有価証券 100株
アルバック	31,400	4,285.00	134,549,000	貸付有価証券 200株
アクセル	7,100	699.00	4,962,900	
E I Z O	13,300	3,630.00	48,279,000	
日本信号	43,500	930.00	40,455,000	貸付有価証券 300株
京三製作所	40,000	423.00	16,920,000	貸付有価証券 100株
能美防災	22,600	2,191.00	49,516,600	
ホーチキ	12,400	1,288.00	15,971,200	貸付有価証券 100株
星和電機	8,400	685.00	5,754,000	
エレコム	19,600	5,270.00	103,292,000	
パナソニック	1,952,600	1,174.00	2,292,352,400	貸付有価証券 66,400株
シャープ	197,800	1,503.00	297,293,400	貸付有価証券 71,200株（13,100株）
アンリツ	110,100	2,264.00	249,266,400	貸付有価証券 58,100株（500株）
富士通ゼネラル	46,400	2,850.00	132,240,000	貸付有価証券 100株
ソニー	1,070,600	10,180.00	10,898,708,000	貸付有価証券 22,400株（100株）
T D K	82,500	15,290.00	1,261,425,000	貸付有価証券 1,300株
帝国通信工業	7,500	1,039.00	7,792,500	
タムラ製作所	57,100	573.00	32,718,300	
アルプスアルパイン	151,300	1,371.00	207,432,300	
池上通信機	5,400	826.00	4,460,400	
日本電波工業	15,400	599.00	9,224,600	貸付有価証券 3,600株（200株）

鈴木	8,400	1,195.00	10,038,000	貸付有価証券 500株
日本トリム	2,300	4,170.00	9,591,000	
ローランド ディー ジー	10,100	1,886.00	19,048,600	貸付有価証券 4,900株
フォスター電機	17,900	1,231.00	22,034,900	
S M K	4,400	3,015.00	13,266,000	
ヨコオ	11,100	3,060.00	33,966,000	
ティアック	12,300	103.00	1,266,900	
ホシデン	46,700	988.00	46,139,600	
ヒロセ電機	26,300	15,340.00	403,442,000	
日本航空電子工業	39,200	1,576.00	61,779,200	貸付有価証券 200株
T O A	18,300	835.00	15,280,500	
マクセルホールディング ス	36,800	1,229.00	45,227,200	
古野電気	22,000	1,172.00	25,784,000	
ユニデンホールディング ス	4,700	2,211.00	10,391,700	
スミダコーポレーション	14,600	1,058.00	15,446,800	
アイコム	9,500	2,710.00	25,745,000	貸付有価証券 100株
リオン	7,200	3,405.00	24,516,000	
本多通信工業	14,600	466.00	6,803,600	
船井電機	17,300	411.00	7,110,300	貸付有価証券 4,900株
横河電機	156,800	2,017.00	316,265,600	貸付有価証券 1,500株
新電元工業	6,000	2,489.00	14,934,000	
アズビル	107,900	5,420.00	584,818,000	
東亜ディーケーケー	8,400	843.00	7,081,200	
日本光電工業	70,600	3,680.00	259,808,000	
チノー	5,900	1,400.00	8,260,000	
共和電業	17,900	409.00	7,321,100	
日本電子材料	6,800	1,724.00	11,723,200	貸付有価証券 3,100株（1,800株）
堀場製作所	33,900	6,110.00	207,129,000	
アドバンテスト	127,100	7,520.00	955,792,000	貸付有価証券 2,000株

小野測器	7,100	515.00	3,656,500	
エスペック	15,100	2,000.00	30,200,000	
キーエンス	154,900	57,560.00	8,916,044,000	
日置電機	8,200	4,205.00	34,481,000	
シスメックス	122,200	12,230.00	1,494,506,000	
日本マイクロニクス	29,700	1,289.00	38,283,300	
メガチップス	15,900	2,846.00	45,251,400	貸付有価証券 100株
O B A R A G R O U P	10,000	3,835.00	38,350,000	貸付有価証券 4,800株（4,500株）
澤藤電機	2,100	2,121.00	4,454,100	
原田工業	8,100	848.00	6,868,800	
コーセル	22,700	1,259.00	28,579,300	
イリソ電子工業	14,300	4,375.00	62,562,500	貸付有価証券 100株
オブテックスグループ	28,000	1,863.00	52,164,000	
千代田インテグレ	7,200	1,745.00	12,564,000	貸付有価証券 100株
アイ・オー・データ機器	5,500	978.00	5,379,000	
レーザーテック	75,000	11,690.00	876,750,000	
スタンレー電気	119,800	3,350.00	401,330,000	
岩崎電気	6,600	1,443.00	9,523,800	
ウシオ電機	94,300	1,326.00	125,041,800	
岡谷電機産業	13,400	400.00	5,360,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	15,700	284.00	4,458,800	
エノモト	5,100	1,383.00	7,053,300	
日本セラミック	17,300	2,929.00	50,671,700	
遠藤照明	8,600	516.00	4,437,600	
古河電池	12,200	1,824.00	22,252,800	貸付有価証券 5,700株
双信電機	8,300	465.00	3,859,500	貸付有価証券 3,800株（300株）
山一電機	12,400	1,520.00	18,848,000	
図研	11,100	2,820.00	31,302,000	
日本電子	33,700	4,805.00	161,928,500	
カシオ計算機	151,200	1,816.00	274,579,200	
ファナック	160,700	25,220.00	4,052,854,000	貸付有価証券

				3,500株
日本シイエムケイ	40,200	395.00	15,879,000	
エンプラス	8,700	3,845.00	33,451,500	
大真空	6,200	2,552.00	15,822,400	貸付有価証券 900株
ローム	71,000	9,620.00	683,020,000	貸付有価証券 400株
浜松ホトニクス	122,600	5,960.00	730,696,000	
三井ハイテック	18,800	3,745.00	70,406,000	貸付有価証券 2,300株
新光電気工業	57,400	2,319.00	133,110,600	
京セラ	240,400	6,197.00	1,489,758,800	貸付有価証券 4,000株
太陽誘電	76,000	4,810.00	365,560,000	
村田製作所	502,000	9,320.00	4,678,640,000	貸付有価証券 300株
双葉電子工業	27,000	891.00	24,057,000	
北陸電気工業	6,900	904.00	6,237,600	
ニチコン	57,900	1,262.00	73,069,800	貸付有価証券 3,000株
日本ケミコン	13,700	1,868.00	25,591,600	
K O A	25,800	1,454.00	37,513,200	
市光工業	25,500	686.00	17,493,000	
小糸製作所	102,400	7,100.00	727,040,000	
ミツバ	31,400	448.00	14,067,200	貸付有価証券 100株
S C R E E Nホールディ ングス	29,600	7,300.00	216,080,000	貸付有価証券 200株
キャノン電子	15,700	1,507.00	23,659,900	貸付有価証券 200株
キャノン	849,300	2,023.50	1,718,558,550	貸付有価証券 100株
リコー	434,800	666.00	289,576,800	貸付有価証券 600株
象印マホービン	46,200	1,900.00	87,780,000	貸付有価証券 7,100株
M U T O Hホールディ ングス	2,100	1,453.00	3,051,300	
東京エレクトロン	108,400	37,380.00	4,051,992,000	貸付有価証券 600株

トヨタ紡織	49,800	1,675.00	83,415,000	貸付有価証券 800株
芦森工業	3,500	921.00	3,223,500	
ユニプレス	33,100	984.00	32,570,400	
豊田自動織機	138,300	8,150.00	1,127,145,000	
モリタホールディングス	29,900	1,742.00	52,085,800	
三櫻工業	21,700	943.00	20,463,100	貸付有価証券 10,200株
デンソー	376,300	6,044.00	2,274,357,200	貸付有価証券 8,500株
東海理化電機製作所	45,000	1,720.00	77,400,000	
三井E & Sホールディングス	61,700	369.00	22,767,300	
川崎重工業	133,000	2,263.00	300,979,000	貸付有価証券 800株
名村造船所	55,000	166.00	9,130,000	貸付有価証券 1,300株
サノヤスホールディングス	20,800	162.00	3,369,600	貸付有価証券 700株
日本車輛製造	6,200	2,401.00	14,886,200	
三菱ロジスネクスト	22,600	1,197.00	27,052,200	
近畿車輛	2,600	1,310.00	3,406,000	
日産自動車	2,015,600	551.80	1,112,208,080	貸付有価証券 8,000株
いすゞ自動車	495,200	967.00	478,858,400	貸付有価証券 3,000株
トヨタ自動車	1,906,900	7,898.00	15,060,696,200	貸付有価証券 32,000株
日野自動車	213,400	908.00	193,767,200	貸付有価証券 1,000株
三菱自動車工業	632,600	206.00	130,315,600	貸付有価証券 200,100株(61,100株)
エフテック	11,900	635.00	7,556,500	貸付有価証券 2,600株
レシップホールディングス	6,700	485.00	3,249,500	
G M B	3,100	749.00	2,321,900	
ファルテック	3,000	604.00	1,812,000	
武蔵精密工業	38,000	1,641.00	62,358,000	
日産車体	33,400	842.00	28,122,800	

新明和工業	46,000	887.00	40,802,000	貸付有価証券 1,000株
極東開発工業	31,700	1,410.00	44,697,000	
トピー工業	14,100	1,189.00	16,764,900	貸付有価証券 200株
ティラド	6,200	1,319.00	8,177,800	
タチエス	28,100	1,202.00	33,776,200	貸付有価証券 14,300株
N O K	91,900	1,127.00	103,571,300	
フタバ産業	47,500	521.00	24,747,500	貸付有価証券 400株
K Y B	19,100	2,327.00	44,445,700	
大同メタル工業	32,800	505.00	16,564,000	
プレス工業	84,700	315.00	26,680,500	
ミクニ	21,700	266.00	5,772,200	貸付有価証券 100株
太平洋工業	35,800	1,101.00	39,415,800	貸付有価証券 700株
河西工業	23,100	374.00	8,639,400	
アイシン精機	140,700	3,100.00	436,170,000	貸付有価証券 1,100株
マツダ	502,900	690.00	347,001,000	貸付有価証券 2,200株
今仙電機製作所	15,900	730.00	11,607,000	貸付有価証券 1,000株
本田技研工業	1,345,600	2,921.50	3,931,170,400	
スズキ	338,800	4,802.00	1,626,917,600	貸付有価証券 10,000株
S U B A R U	530,600	2,004.00	1,063,322,400	貸付有価証券 3,300株
安永	8,200	1,181.00	9,684,200	貸付有価証券 100株
ヤマハ発動機	241,500	2,143.00	517,534,500	
T B K	20,300	445.00	9,033,500	
エクセディ	23,200	1,277.00	29,626,400	貸付有価証券 200株
豊田合成	55,200	3,030.00	167,256,000	貸付有価証券 100株
愛三工業	26,800	480.00	12,864,000	
盟和産業	2,600	874.00	2,272,400	

日本プラスト	13,400	489.00	6,552,600	貸付有価証券 100株
ヨロズ	16,000	1,038.00	16,608,000	
エフ・シー・シー	27,900	1,788.00	49,885,200	
シマノ	64,000	24,350.00	1,558,400,000	
テイ・エス テック	39,700	3,255.00	129,223,500	
ジャムコ	8,600	593.00	5,099,800	貸付有価証券 300株
テルモ	483,600	4,230.00	2,045,628,000	貸付有価証券 6,500株
クリエートメディック	5,600	1,006.00	5,633,600	
日機装	55,200	1,001.00	55,255,200	
日本エム・ディ・エム	9,800	2,443.00	23,941,400	
島津製作所	204,200	3,960.00	808,632,000	
J M S	14,400	894.00	12,873,600	
クボテック	4,400	366.00	1,610,400	貸付有価証券 2,000株
長野計器	12,400	990.00	12,276,000	
ブイ・テクノロジー	8,000	5,620.00	44,960,000	
東京計器	10,900	925.00	10,082,500	
愛知時計電機	2,300	4,455.00	10,246,500	
インターアクション	9,200	1,847.00	16,992,400	貸付有価証券 900株(100株)
オーバル	15,300	312.00	4,773,600	貸付有価証券 7,100株
東京精密	31,000	4,845.00	150,195,000	
マニー	68,100	2,724.00	185,504,400	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
ニコン	261,000	633.00	165,213,000	貸付有価証券 300株
トプコン	86,100	1,241.00	106,850,100	貸付有価証券 3,800株
オリンパス	945,700	2,215.50	2,095,198,350	
理研計器	15,100	3,025.00	45,677,500	
タムロン	13,800	1,854.00	25,585,200	貸付有価証券 100株
H O Y A	339,100	14,265.00	4,837,261,500	
シード	7,300	601.00	4,387,300	
ノーリツ鋼機	11,500	2,362.00	27,163,000	

エー・アンド・デイ	15,600	1,200.00	18,720,000	貸付有価証券 100株
朝日インテック	193,600	3,710.00	718,256,000	貸付有価証券 400株
シチズン時計	200,200	294.00	58,858,800	貸付有価証券 600株
リズム	5,300	632.00	3,349,600	
大研医器	11,800	537.00	6,336,600	貸付有価証券 1,200株
メニコン	24,200	6,300.00	152,460,000	
シンシア	1,800	648.00	1,166,400	
松風	7,700	1,878.00	14,460,600	貸付有価証券 100株
セイコーホールディングス	24,200	1,326.00	32,089,200	貸付有価証券 2,600株
ニプロ	118,300	1,182.00	139,830,600	
中本パックス	4,300	1,599.00	6,875,700	
スノーピーク	10,100	1,838.00	18,563,800	貸付有価証券 3,600株
パラマウントベッドホールディングス	18,000	4,640.00	83,520,000	貸付有価証券 200株
トランザクション	9,400	922.00	8,666,800	貸付有価証券 100株
粧美堂	5,000	391.00	1,955,000	
ニホンフラッシュ	16,000	1,292.00	20,672,000	
前田工織	18,800	2,686.00	50,496,800	
永大産業	22,300	274.00	6,110,200	
アートネイチャー	18,200	656.00	11,939,200	貸付有価証券 200株
バンダイナムコホールディングス	176,700	8,883.00	1,569,626,100	貸付有価証券 3,600株
アイフィスジャパン	4,300	795.00	3,418,500	貸付有価証券 2,000株
共立印刷	28,500	114.00	3,249,000	
SHOEI	15,000	4,115.00	61,725,000	
フランスベッドホールディングス	24,200	905.00	21,901,000	
パイロットコーポレーション	30,200	2,998.00	90,539,600	貸付有価証券 200株
萩原工業	9,500	1,467.00	13,936,500	

トッパン・フォームズ	36,600	1,049.00	38,393,400	
フジシールインターナショナル	38,300	2,045.00	78,323,500	
タカラトミー	76,600	884.00	67,714,400	貸付有価証券 200株
廣濟堂	11,900	691.00	8,222,900	
エステールホールディングス	4,600	609.00	2,801,400	
タカノ	6,700	595.00	3,986,500	貸付有価証券 3,500株
プロネクサス	14,700	1,013.00	14,891,100	
ホクシン	10,500	108.00	1,134,000	
ウッドワン	5,700	1,108.00	6,315,600	
大建工業	11,500	1,806.00	20,769,000	
凸版印刷	241,200	1,440.00	347,328,000	
大日本印刷	223,700	1,856.00	415,187,200	貸付有価証券 6,900株
共同印刷	5,300	2,889.00	15,311,700	
N I S S H A	35,100	1,460.00	51,246,000	貸付有価証券 600株
光村印刷	1,500	1,784.00	2,676,000	
TAKARA & COMPANY	8,200	1,703.00	13,964,600	貸付有価証券 900株
アシックス	151,100	2,014.00	304,315,400	貸付有価証券 1,100株
ツツミ	5,300	2,096.00	11,108,800	
小松ウオール工業	5,200	1,742.00	9,058,400	
ヤマハ	101,600	5,900.00	599,440,000	
河合楽器製作所	5,300	3,025.00	16,032,500	
クリナップ	15,900	482.00	7,663,800	貸付有価証券 100株
ピジョン	109,700	4,365.00	478,840,500	貸付有価証券 9,500株
オリバー	3,600	2,308.00	8,308,800	貸付有価証券 400株
兼松サステック	1,100	1,668.00	1,834,800	
キングジム	14,200	849.00	12,055,800	
リンテック	40,600	2,260.00	91,756,000	
イトーキ	33,900	352.00	11,932,800	

任天堂	104,800	65,880.00	6,904,224,000	
三菱鉛筆	28,100	1,392.00	39,115,200	
タカスタンダード	35,300	1,534.00	54,150,200	
コクヨ	82,000	1,436.00	117,752,000	
ナカバヤシ	16,800	642.00	10,785,600	
グロープライド	7,600	4,065.00	30,894,000	
オカムラ	59,600	929.00	55,368,400	
美津濃	15,500	2,019.00	31,294,500	
東京電力ホールディングス	1,364,300	271.00	369,725,300	
中部電力	522,900	1,236.50	646,565,850	貸付有価証券 200株
関西電力	647,500	963.20	623,672,000	貸付有価証券 400株
中国電力	246,500	1,215.00	299,497,500	貸付有価証券 900株
北陸電力	156,200	675.00	105,435,000	貸付有価証券 100株
東北電力	426,900	849.00	362,438,100	貸付有価証券 400株
四国電力	153,900	668.00	102,805,200	貸付有価証券 100株
九州電力	352,300	892.00	314,251,600	
北海道電力	159,900	375.00	59,962,500	貸付有価証券 600株
沖縄電力	33,200	1,386.00	46,015,200	
電源開発	136,000	1,390.00	189,040,000	
エフオン	9,200	1,417.00	13,036,400	
イーレックス	24,800	2,141.00	53,096,800	貸付有価証券 4,000株（3,300株）
レノバ	28,700	3,790.00	108,773,000	貸付有価証券 13,400株（1,700株）
東京瓦斯	328,700	2,344.50	770,637,150	
大阪瓦斯	331,600	2,099.00	696,028,400	
東邦瓦斯	84,100	6,770.00	569,357,000	貸付有価証券 700株
北海道瓦斯	9,200	1,540.00	14,168,000	貸付有価証券 100株
広島ガス	35,200	377.00	13,270,400	
西部瓦斯	19,200	3,185.00	61,152,000	

静岡ガス	48,500	1,060.00	51,410,000	
メタウォーター	16,500	2,307.00	38,065,500	
SBSホールディングス	12,600	2,610.00	32,886,000	
東武鉄道	178,100	3,025.00	538,752,500	貸付有価証券 1,000株
相鉄ホールディングス	54,700	2,453.00	134,179,100	
東急	431,000	1,251.00	539,181,000	貸付有価証券 1,500株
京浜急行電鉄	219,500	1,758.00	385,881,000	貸付有価証券 3,800株
小田急電鉄	254,200	3,185.00	809,627,000	貸付有価証券 9,000株
京王電鉄	88,700	7,730.00	685,651,000	
京成電鉄	118,900	3,370.00	400,693,000	貸付有価証券 100株
富士急行	23,300	4,540.00	105,782,000	貸付有価証券 2,600株
新京成電鉄	4,400	2,347.00	10,326,800	
東日本旅客鉄道	300,800	6,763.00	2,034,310,400	貸付有価証券 5,300株
西日本旅客鉄道	152,300	5,279.00	803,991,700	貸付有価証券 4,800株
東海旅客鉄道	142,100	14,145.00	2,010,004,500	貸付有価証券 600株
西武ホールディングス	223,100	979.00	218,414,900	貸付有価証券 100株
鴻池運輸	27,200	1,010.00	27,472,000	
西日本鉄道	47,400	2,973.00	140,920,200	
ハマキョウレックス	13,100	2,933.00	38,422,300	
サカイ引越センター	9,000	5,150.00	46,350,000	
近鉄グループホールディングス	161,900	4,415.00	714,788,500	貸付有価証券 100株
阪急阪神ホールディングス	215,900	3,355.00	724,344,500	貸付有価証券 100株
南海電気鉄道	76,700	2,578.00	197,732,600	
京阪ホールディングス	72,100	4,885.00	352,208,500	貸付有価証券 100株
神戸電鉄	3,800	3,555.00	13,509,000	貸付有価証券 100株
名古屋鉄道	133,100	2,640.00	351,384,000	貸付有価証券

				28,300株
山陽電気鉄道	11,600	1,953.00	22,654,800	
日本通運	56,000	6,860.00	384,160,000	
ヤマトホールディングス	268,000	2,631.00	705,108,000	
山九	45,000	3,880.00	174,600,000	
丸運	9,200	248.00	2,281,600	
丸全昭和運輸	13,100	3,540.00	46,374,000	
センコーグループホールディングス	89,200	1,014.00	90,448,800	貸付有価証券 2,300株
トナミホールディングス	3,900	6,020.00	23,478,000	
ニッコンホールディングス	57,900	2,055.00	118,984,500	
日本石油輸送	1,800	2,611.00	4,699,800	
福山通運	20,700	4,350.00	90,045,000	
セイノーホールディングス	121,200	1,456.00	176,467,200	
エスライン	4,900	894.00	4,380,600	
神奈川中央交通	4,000	3,965.00	15,860,000	
日立物流	29,700	3,075.00	91,327,500	貸付有価証券 200株
丸和運輸機関	17,100	4,395.00	75,154,500	貸付有価証券 7,100株
C & F ロジホールディングス	16,400	2,020.00	33,128,000	
九州旅客鉄道	141,900	2,168.00	307,639,200	
S Gホールディングス	339,800	2,841.00	965,371,800	貸付有価証券 400株
日本郵船	135,300	2,351.00	318,090,300	
商船三井	102,400	3,080.00	315,392,000	貸付有価証券 900株
川崎汽船	49,800	2,003.00	99,749,400	貸付有価証券 5,100株(5,100株)
N S ユナイテッド海運	8,900	1,378.00	12,264,200	
明治海運	17,200	393.00	6,759,600	
飯野海運	76,600	424.00	32,478,400	
共栄タンカー	2,800	848.00	2,374,400	
乾汽船	9,300	947.00	8,807,100	
日本航空	363,400	1,861.00	676,287,400	貸付有価証券 19,300株(12,600株)

ANAホールディングス	403,100	2,148.50	866,060,350	貸付有価証券 189,400株（60,000株）
パスコ	3,100	1,391.00	4,312,100	
トランコム	4,500	8,870.00	39,915,000	
日新	14,000	1,223.00	17,122,000	
三菱倉庫	51,300	3,015.00	154,669,500	
三井倉庫ホールディングス	18,500	2,226.00	41,181,000	
住友倉庫	58,200	1,304.00	75,892,800	
澁澤倉庫	8,900	2,397.00	21,333,300	
東陽倉庫	29,200	319.00	9,314,800	貸付有価証券 100株
日本トランスシティ	35,600	566.00	20,149,600	貸付有価証券 100株
ケイヒン	3,100	1,345.00	4,169,500	
中央倉庫	9,900	1,212.00	11,998,800	
川西倉庫	3,000	1,125.00	3,375,000	
安田倉庫	13,300	990.00	13,167,000	貸付有価証券 100株
ファイズホールディングス	3,400	1,005.00	3,417,000	貸付有価証券 500株
東洋埠頭	4,900	1,351.00	6,619,900	
宇徳	13,800	479.00	6,610,200	貸付有価証券 100株
上組	90,300	1,868.00	168,680,400	貸付有価証券 100株
サンリツ	3,800	643.00	2,443,400	
キムラユニティー	4,300	1,115.00	4,794,500	
キューソー流通システム	4,000	1,620.00	6,480,000	
近鉄エクスプレス	34,400	2,515.00	86,516,000	
東海運	9,200	306.00	2,815,200	
エーアイティー	11,400	937.00	10,681,800	
内外トランスライン	5,700	1,339.00	7,632,300	貸付有価証券 3,000株
日本コンセプト	5,200	1,650.00	8,580,000	
NECネットエスアイ	47,500	1,769.00	84,027,500	貸付有価証券 200株（200株）
クロスキャット	4,400	1,132.00	4,980,800	

システナ	59,800	2,070.00	123,786,000	貸付有価証券 2,000株
デジタルアーツ	8,200	9,470.00	77,654,000	
日鉄ソリューションズ	25,100	3,005.00	75,425,500	
キューブシステム	8,900	1,242.00	11,053,800	貸付有価証券 2,000株（1,000株）
エイジア	3,000	1,828.00	5,484,000	
コア	7,100	1,417.00	10,060,700	
ラクーンホールディングス	8,300	1,696.00	14,076,800	貸付有価証券 3,900株（800株）
ソリトンシステムズ	8,400	1,766.00	14,834,400	
ソフトクリエイティブホールディングス	7,300	2,736.00	19,972,800	
T I S	167,700	2,084.00	349,486,800	貸付有価証券 600株
J N Sホールディングス	6,700	520.00	3,484,000	
電算システム	6,300	3,090.00	19,467,000	貸付有価証券 100株
グリー	102,800	600.00	61,680,000	貸付有価証券 10,000株
コーエーテックモホールディングス	34,300	6,190.00	212,317,000	貸付有価証券 4,400株
三菱総合研究所	7,200	4,220.00	30,384,000	
ボルテージ	4,100	507.00	2,078,700	貸付有価証券 1,900株（1,200株）
電算	1,900	2,418.00	4,594,200	
A G S	9,500	925.00	8,787,500	
ファインデックス	14,100	1,189.00	16,764,900	貸付有価証券 300株
ブレインパッド	4,300	4,520.00	19,436,000	貸付有価証券 300株
K L a b	30,500	869.00	26,504,500	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	20,200	1,075.00	21,715,000	貸付有価証券 1,800株
イーブックイニシアティブジャパン	2,400	2,622.00	6,292,800	
ネクソン	423,100	3,175.00	1,343,342,500	
アイスタイル	46,900	410.00	19,229,000	貸付有価証券 2,500株
エムアップホールディン	4,800	2,462.00	11,817,600	

グス				
エイチーム	11,500	1,063.00	12,224,500	
エニグモ	15,800	1,178.00	18,612,400	貸付有価証券 200株
テクノスジャパン	13,000	646.00	8,398,000	
e n i s h	8,700	428.00	3,723,600	貸付有価証券 1,900株
コロプラ	55,000	1,054.00	57,970,000	貸付有価証券 16,500株
オルトプラス	10,200	380.00	3,876,000	貸付有価証券 4,100株（100株）
ブロードリーフ	83,100	707.00	58,751,700	貸付有価証券 45,600株
クロス・マーケティング グループ	7,400	351.00	2,597,400	
デジタルハーツホール ディングス	8,900	1,240.00	11,036,000	貸付有価証券 700株（300株）
システム情報	12,600	1,034.00	13,028,400	貸付有価証券 2,500株
メディアドゥ	5,400	6,960.00	37,584,000	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
じげん	41,500	380.00	15,770,000	
ブイキューブ	9,100	2,850.00	25,935,000	貸付有価証券 4,300株
エンカレッジ・テクノロ ジ	3,700	754.00	2,789,800	
サイバーリンクス	2,700	5,410.00	14,607,000	貸付有価証券 1,400株（300株）
ディー・エル・イー	13,500	298.00	4,023,000	貸付有価証券 6,900株（4,900株）
フィックスターズ	17,800	928.00	16,518,400	
C A R T A H O L D I N G S	6,800	1,275.00	8,670,000	貸付有価証券 3,700株（3,700株）
オブティム	8,800	2,744.00	24,147,200	貸付有価証券 2,200株
セレス	5,500	2,673.00	14,701,500	貸付有価証券 100株
S H I F T	7,500	13,730.00	102,975,000	貸付有価証券 600株
ティーガイア	14,900	1,946.00	28,995,400	
セック	2,400	2,753.00	6,607,200	

日本アジアグループ	17,700	769.00	13,611,300	貸付有価証券 700株（700株）
テクマトリックス	23,600	2,044.00	48,238,400	貸付有価証券 200株
プロシップ	4,900	1,506.00	7,379,400	貸付有価証券 100株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	40,400	2,357.00	95,222,800	
GMOペイメントゲート ウェイ	35,500	13,370.00	474,635,000	
ザッパラス	7,200	518.00	3,729,600	貸付有価証券 100株
システムリサーチ	4,400	1,700.00	7,480,000	
インターネットイニシア ティブ	24,800	4,040.00	100,192,000	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
さくらインターネット	18,000	644.00	11,592,000	貸付有価証券 4,000株
ヴィンクス	4,700	1,136.00	5,339,200	貸付有価証券 100株
GMOグローバルサイ ン・ホールディングス	3,700	8,440.00	31,228,000	貸付有価証券 1,600株（1,200株）
SRAホールディングス	8,900	2,539.00	22,597,100	
システムインテグレータ	5,300	600.00	3,180,000	貸付有価証券 100株
朝日ネット	11,900	821.00	9,769,900	貸付有価証券 200株
eBASE	20,000	1,000.00	20,000,000	
アバント	16,000	1,121.00	17,936,000	貸付有価証券 100株
アドソル日進	6,000	3,265.00	19,590,000	
フリービット	8,700	897.00	7,803,900	貸付有価証券 400株
コムチュア	18,800	2,808.00	52,790,400	貸付有価証券 300株（300株）
サイバーコム	3,000	1,647.00	4,941,000	
アステリア	10,200	1,070.00	10,914,000	貸付有価証券 3,000株
アイル	9,300	1,563.00	14,535,900	貸付有価証券 200株
マークラインズ	7,000	2,515.00	17,605,000	
メディカル・データ・ピ	19,100	2,813.00	53,728,300	

ジョン				
g u m i	21,500	790.00	16,985,000	貸付有価証券 200株
ショーケース	3,600	1,097.00	3,949,200	貸付有価証券 1,600株
モバイルファクトリー	3,700	921.00	3,407,700	貸付有価証券 1,200株
テラスカイ	6,100	3,910.00	23,851,000	貸付有価証券 3,200株(1,000株)
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,600	1,561.00	10,302,600	貸付有価証券 100株
P C Iホールディングス	6,300	1,699.00	10,703,700	
パイブドHD	2,200	1,509.00	3,319,800	貸付有価証券 100株
アイビーシー	2,700	1,062.00	2,867,400	
ネオジャパン	3,200	1,996.00	6,387,200	貸付有価証券 1,100株
P R T I M E S	2,900	3,435.00	9,961,500	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
ランドコンピュータ	2,500	1,108.00	2,770,000	
ダブルスタンダード	2,200	4,100.00	9,020,000	貸付有価証券 1,000株(100株)
オーブンドア	8,300	1,349.00	11,196,700	貸付有価証券 3,900株(1,100株)
マイネット	5,500	848.00	4,664,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
アカツキ	6,000	3,960.00	23,760,000	
ベネフィットジャパン	1,300	1,694.00	2,202,200	
U b i c o mホールディングス	3,700	3,660.00	13,542,000	貸付有価証券 100株
カナミックネットワーク	15,300	716.00	10,954,800	
ノムラシステムコーポレーション	7,300	356.00	2,598,800	貸付有価証券 3,100株
チェンジ	11,700	7,420.00	86,814,000	貸付有価証券 5,400株(1,200株)
シンクロ・フード	7,100	286.00	2,030,600	
オークネット	8,900	1,465.00	13,038,500	貸付有価証券 4,200株
セグエグループ	4,300	1,344.00	5,779,200	貸付有価証券 100株
エイトレッド	2,800	2,507.00	7,019,600	

AOI TYO Holdings	16,900	437.00	7,385,300	貸付有価証券 100株
マクロミル	34,200	642.00	21,956,400	
ビーグリー	3,300	1,821.00	6,009,300	貸付有価証券 1,500株(300株)
オロ	5,300	4,210.00	22,313,000	
ユーザーローカル	1,700	3,745.00	6,366,500	
テモナ	3,600	1,017.00	3,661,200	
ニーズウェル	3,200	663.00	2,121,600	
サインポスト	3,600	818.00	2,944,800	貸付有価証券 500株(500株)
ソルクシーズ	6,400	968.00	6,195,200	貸付有価証券 3,000株(1,300株)
フェイス	5,900	796.00	4,696,400	貸付有価証券 600株(600株)
プロトコーポレーション	15,000	1,036.00	15,540,000	貸付有価証券 300株
ハイマックス	4,000	1,146.00	4,584,000	
野村総合研究所	237,700	3,650.00	867,605,000	
サイバネットシステム	11,900	946.00	11,257,400	
CEホールディングス	8,800	546.00	4,804,800	
日本システム技術	2,700	1,424.00	3,844,800	
インテージホールディングス	20,900	1,133.00	23,679,700	貸付有価証券 9,900株
東邦システムサイエンス	4,400	917.00	4,034,800	
ソースネクスト	79,500	259.00	20,590,500	貸付有価証券 20,400株(15,600株)
インフォコム	18,300	3,290.00	60,207,000	
HEROZ	2,400	2,427.00	5,824,800	貸付有価証券 400株
ラクスル	13,500	4,420.00	59,670,000	貸付有価証券 5,100株
FIG	18,100	284.00	5,140,400	貸付有価証券 8,600株
システムサポート	3,800	1,642.00	6,239,600	貸付有価証券 100株
イーソル	9,100	1,200.00	10,920,000	貸付有価証券 4,300株
アルテリア・ネットワークス	18,600	1,497.00	27,844,200	

EduLab	1,500	6,240.00	9,360,000	
東海ソフト	1,200	1,040.00	1,248,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	2,800	1,407.00	3,939,600	
東名	900	1,060.00	954,000	
ヴィッツ	600	2,332.00	1,399,200	貸付有価証券 200株(200株)
トピラスシステムズ	1,700	1,270.00	2,159,000	貸付有価証券 100株
Link-U	1,100	1,157.00	1,272,700	貸付有価証券 400株(100株)
フォーカスシステムズ	10,400	889.00	9,245,600	
クレスコ	10,200	1,290.00	13,158,000	
フジ・メディア・ホールディングス	161,500	1,102.00	177,973,000	
オービック	58,100	20,660.00	1,200,346,000	
ジャストシステム	27,300	6,870.00	187,551,000	貸付有価証券 100株
TDCソフト	14,700	992.00	14,582,400	貸付有価証券 100株
Zホールディングス	2,303,100	618.00	1,423,315,800	貸付有価証券 133,800株
トレンドマイクロ	89,500	5,940.00	531,630,000	
IDホールディングス	6,400	1,258.00	8,051,200	
日本オラクル	34,000	13,230.00	449,820,000	
アルファシステムズ	5,200	3,510.00	18,252,000	
フューチャー	20,200	1,731.00	34,966,200	貸付有価証券 100株
CAC Holdings	10,900	1,440.00	15,696,000	
SBテクノロジー	6,000	3,365.00	20,190,000	
トーセ	4,500	802.00	3,609,000	
オービックビジネスコンサルタント	17,100	6,990.00	119,529,000	貸付有価証券 8,200株
伊藤忠テクノソリューションズ	76,400	3,695.00	282,298,000	貸付有価証券 200株
アイティフォー	20,300	903.00	18,330,900	
東計電算	2,500	4,395.00	10,987,500	貸付有価証券 1,100株
エクスネット	2,600	965.00	2,509,000	

大塚商会	90,700	5,460.00	495,222,000	貸付有価証券 100株
サイボウズ	19,600	2,507.00	49,137,200	
ソフトブレーン	4,900	867.00	4,248,300	貸付有価証券 1,100株(900株)
電通国際情報サービス	10,400	6,310.00	65,624,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
A C C E S S	15,700	708.00	11,115,600	貸付有価証券 300株
デジタルガレージ	30,200	4,205.00	126,991,000	貸付有価証券 2,200株
E Mシステムズ	23,700	949.00	22,491,300	
ウェザーニューズ	5,700	5,330.00	30,381,000	貸付有価証券 3,000株
C I J	11,400	908.00	10,351,200	貸付有価証券 900株
ビジネスエンジニアリン グ	1,900	3,185.00	6,051,500	貸付有価証券 800株
日本エンタープライズ	17,000	199.00	3,383,000	貸付有価証券 1,500株
WOWOW	8,000	2,834.00	22,672,000	
スカラ	11,200	813.00	9,105,600	貸付有価証券 2,800株
インテリジェント ウェ イブ	9,800	667.00	6,536,600	
I M A G I C A G R O U P	14,200	335.00	4,757,000	
ネットワンシステムズ	63,900	3,610.00	230,679,000	
システムソフト	36,100	86.00	3,104,600	
アルゴグラフィックス	14,200	3,200.00	45,440,000	貸付有価証券 100株
マーベラス	25,600	868.00	22,220,800	
エイベックス	28,800	1,078.00	31,046,400	
日本ユニシス	52,400	3,980.00	208,552,000	
兼松エレクトロニクス	9,100	4,045.00	36,809,500	
都築電気	5,300	1,586.00	8,405,800	貸付有価証券 200株
T B S ホールディングス	102,000	1,811.00	184,722,000	貸付有価証券 600株
日本テレビホールディン グス	140,000	1,135.00	158,900,000	

朝日放送グループホールディングス	16,600	693.00	11,503,800	
テレビ朝日ホールディングス	46,100	1,710.00	78,831,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	110,300	503.00	55,480,900	貸付有価証券 200株
テレビ東京ホールディングス	13,700	2,315.00	31,715,500	
日本BS放送	5,700	1,080.00	6,156,000	
ビジョン	20,800	975.00	20,280,000	貸付有価証券 1,000株
スマートバリュー	4,400	945.00	4,158,000	貸付有価証券 2,000株
USEN - NEXT HOLDINGS	6,400	1,312.00	8,396,800	
ワイヤレスゲート	6,900	538.00	3,712,200	貸付有価証券 2,700株
コネクシオ	9,500	1,470.00	13,965,000	
日本通信	130,700	173.00	22,611,100	貸付有価証券 32,500株（31,800株）
クロップス	3,100	766.00	2,374,600	
日本電信電話	2,241,800	2,644.50	5,928,440,100	貸付有価証券 97,500株
KDDI	1,222,600	3,063.00	3,744,823,800	貸付有価証券 12,800株
ソフトバンク	1,524,100	1,292.00	1,969,137,200	貸付有価証券 9,400株
光通信	17,300	24,050.00	416,065,000	
エムティーアイ	16,200	825.00	13,365,000	
GMOインターネット	60,100	2,863.00	172,066,300	
ファイバーゲート	5,400	2,540.00	13,716,000	貸付有価証券 1,000株（800株）
アйдママーケティングコミュニケーション	5,000	446.00	2,230,000	
KADOKAWA	45,100	3,645.00	164,389,500	
学研ホールディングス	22,500	1,740.00	39,150,000	
ゼンリン	33,400	1,233.00	41,182,200	
昭文社ホールディングス	7,700	445.00	3,426,500	貸付有価証券 200株
インプレスホールディングス	13,900	167.00	2,321,300	

アイネット	8,600	1,584.00	13,622,400	
松竹	11,100	13,880.00	154,068,000	貸付有価証券 600株
東宝	99,000	4,310.00	426,690,000	貸付有価証券 400株
東映	6,300	16,730.00	105,399,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	446,500	1,363.00	608,579,500	
ピー・シー・エー	2,900	4,380.00	12,702,000	貸付有価証券 900株
ビジネスブレイン太田昭 和	5,700	1,633.00	9,308,100	
D T S	37,500	2,126.00	79,725,000	貸付有価証券 400株
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	71,500	6,160.00	440,440,000	貸付有価証券 3,100株
シーイーシー	18,000	1,480.00	26,640,000	
カブコン	79,100	6,660.00	526,806,000	
アイ・エス・ピー	3,900	3,000.00	11,700,000	貸付有価証券 100株
ジャステック	10,700	1,319.00	14,113,300	
S C S K	38,700	5,860.00	226,782,000	貸付有価証券 100株
日本システムウエア	5,500	2,088.00	11,484,000	
アイネス	16,500	1,361.00	22,456,500	
T K C	14,200	7,610.00	108,062,000	
富士ソフト	17,900	5,120.00	91,648,000	貸付有価証券 300株（300株）
N S D	53,900	2,218.00	119,550,200	
コナミホールディングス	60,900	5,800.00	353,220,000	
福井コンピュータホール ディングス	6,600	3,840.00	25,344,000	貸付有価証券 100株
J B C C ホールディング ス	11,300	1,433.00	16,192,900	
ミロク情報サービス	14,800	2,061.00	30,502,800	貸付有価証券 400株
ソフトバンクグループ	1,330,700	7,706.00	10,254,374,200	貸付有価証券 10,200株
ハウスイ	1,300	980.00	1,274,000	
高千穂交易	6,500	1,200.00	7,800,000	

カワニシホールディングス	2,000	1,458.00	2,916,000	
伊藤忠食品	4,100	5,520.00	22,632,000	
エレマテック	15,700	1,051.00	16,500,700	貸付有価証券 200株
JALUX	4,700	1,304.00	6,128,800	
あらた	13,400	4,795.00	64,253,000	
トーメンデバイス	2,500	3,260.00	8,150,000	
東京エレクトロン デバイス	6,100	3,065.00	18,696,500	
フィールズ	12,900	467.00	6,024,300	貸付有価証券 800株
双日	929,700	231.00	214,760,700	
アルフレッサ ホールディングス	187,100	1,886.00	352,870,600	
横浜冷凍	44,000	864.00	38,016,000	
神栄	2,300	811.00	1,865,300	貸付有価証券 100株
ラサ商事	8,900	911.00	8,107,900	
アルコニックス	17,900	1,438.00	25,740,200	
神戸物産	116,100	3,170.00	368,037,000	貸付有価証券 2,500株
ハイパー	2,500	610.00	1,525,000	
あい ホールディングス	24,000	2,043.00	49,032,000	
ディービーエックス	6,000	1,026.00	6,156,000	貸付有価証券 2,100株
ダイワボウホールディングス	14,300	8,950.00	127,985,000	貸付有価証券 1,000株
マクニカ・富士エレホールディングス	40,100	1,969.00	78,956,900	貸付有価証券 20,500株
ラクト・ジャパン	7,300	2,846.00	20,775,800	貸付有価証券 100株
グリムス	3,800	2,167.00	8,234,600	貸付有価証券 1,700株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,700	826.00	26,184,200	
八洲電機	13,000	993.00	12,909,000	
メディアスホールディングス	9,500	799.00	7,590,500	
レスターホールディング	17,600	2,163.00	38,068,800	

ス				
ジューテックホールディングス	3,800	1,042.00	3,959,600	
大光	7,100	654.00	4,643,400	
OCHIホールディングス	4,900	1,288.00	6,311,200	
TOKAIホールディングス	88,900	1,020.00	90,678,000	
黒谷	4,600	734.00	3,376,400	
Cominix	2,900	716.00	2,076,400	
三洋貿易	16,900	976.00	16,494,400	
ビューティガレージ	2,700	2,659.00	7,179,300	
ウイン・パートナーズ	12,100	1,240.00	15,004,000	貸付有価証券 6,200株
ミタチ産業	5,000	574.00	2,870,000	
シップヘルスケアホールディングス	27,000	5,670.00	153,090,000	貸付有価証券 3,900株
明治電機工業	5,300	1,407.00	7,457,100	
デリカフーズホールディングス	5,900	640.00	3,776,000	
スターティアホールディングス	3,800	880.00	3,344,000	
コメダホールディングス	36,700	1,859.00	68,225,300	貸付有価証券 200株
ピーバンドットコム	1,700	897.00	1,524,900	
アセンテック	3,600	1,780.00	6,408,000	貸付有価証券 1,100株
富士興産	5,100	944.00	4,814,400	
協栄産業	1,900	1,330.00	2,527,000	
小野建	15,100	1,261.00	19,041,100	貸付有価証券 1,300株（1,200株）
南陽	3,700	1,619.00	5,990,300	
佐鳥電機	11,400	742.00	8,458,800	
エコトレーディング	3,800	650.00	2,470,000	
伯東	10,200	1,064.00	10,852,800	
コンドーテック	13,000	1,106.00	14,378,000	
中山福	9,700	518.00	5,024,600	
ナガイレーベン	22,300	2,918.00	65,071,400	貸付有価証券 100株
三菱食品	18,500	2,875.00	53,187,500	

松田産業	12,300	1,777.00	21,857,100	
第一興商	25,100	3,500.00	87,850,000	貸付有価証券 400株
メディカルホールディングス	181,600	1,929.00	350,306,400	貸付有価証券 3,700株
S P K	7,200	1,286.00	9,259,200	
萩原電気ホールディングス	6,200	2,438.00	15,115,600	貸付有価証券 100株
アズワン	11,000	16,940.00	186,340,000	
スズデン	5,800	1,230.00	7,134,000	
尾家産業	4,900	1,362.00	6,673,800	
シモジマ	10,300	1,457.00	15,007,100	
ドウシヤ	15,900	1,926.00	30,623,400	貸付有価証券 100株
小津産業	3,700	1,894.00	7,007,800	
高速	10,000	1,650.00	16,500,000	
たけびし	5,900	1,625.00	9,587,500	
リックス	3,800	1,635.00	6,213,000	
丸文	14,900	505.00	7,524,500	
ハビネット	14,000	1,572.00	22,008,000	
橋本総業ホールディングス	3,400	2,654.00	9,023,600	
日本ライフライン	49,900	1,581.00	78,891,900	
タカショー	10,900	859.00	9,363,100	貸付有価証券 5,000株
マルカ	5,400	1,933.00	10,438,200	
I D O M	45,400	529.00	24,016,600	
進和	9,900	2,137.00	21,156,300	
エスケイジャパン	3,600	485.00	1,746,000	貸付有価証券 1,900株
ダイトロン	7,100	1,598.00	11,345,800	
シークス	21,400	1,542.00	32,998,800	貸付有価証券 10,100株
田中商事	5,200	699.00	3,634,800	
オーハシテクニカ	8,600	1,451.00	12,478,600	
白銅	6,000	1,465.00	8,790,000	
ダイコー通産	1,100	1,433.00	1,576,300	
伊藤忠商事	1,177,300	2,935.50	3,455,964,150	貸付有価証券

				25,500株
丸紅	1,752,100	683.30	1,197,209,930	
高島	2,700	1,592.00	4,298,400	
長瀬産業	94,600	1,524.00	144,170,400	
蝶理	10,700	1,524.00	16,306,800	
豊田通商	187,900	4,095.00	769,450,500	
三共生興	25,500	486.00	12,393,000	
兼松	62,800	1,311.00	82,330,800	
ツカモトコーポレーション	3,000	1,482.00	4,446,000	
三井物産	1,457,400	1,898.00	2,766,145,200	貸付有価証券 40,400株
日本紙パルプ商事	9,600	3,610.00	34,656,000	
カメイ	21,900	1,169.00	25,601,100	
東都水産	2,100	4,005.00	8,410,500	貸付有価証券 900株
OUGホールディングス	2,700	2,868.00	7,743,600	
スターゼン	6,200	4,150.00	25,730,000	
山善	65,700	1,052.00	69,116,400	
椿本興業	3,100	3,900.00	12,090,000	
住友商事	1,062,000	1,346.00	1,429,452,000	貸付有価証券 51,400株
内田洋行	6,600	4,145.00	27,357,000	貸付有価証券 2,200株
三菱商事	1,103,700	2,546.50	2,810,572,050	貸付有価証券 30,200株
第一実業	8,200	4,135.00	33,907,000	
キャノンマーケティング ジャパン	41,700	2,342.00	97,661,400	
西華産業	9,500	1,345.00	12,777,500	
佐藤商事	13,900	895.00	12,440,500	
菱洋エレクトロ	17,100	3,010.00	51,471,000	貸付有価証券 200株
東京産業	15,200	599.00	9,104,800	
ユアサ商事	16,000	3,315.00	53,040,000	
神鋼商事	4,200	1,808.00	7,593,600	
トルク	10,000	257.00	2,570,000	
阪和興業	31,400	2,739.00	86,004,600	
正栄食品工業	10,900	3,615.00	39,403,500	貸付有価証券

				1,300株
カナデン	13,700	1,315.00	18,015,500	
菱電商事	12,100	1,540.00	18,634,000	
フルサト工業	9,300	1,300.00	12,090,000	
岩谷産業	43,500	6,400.00	278,400,000	
ナイス	7,200	1,614.00	11,620,800	
昭光通商	5,400	592.00	3,196,800	
ニチモウ	2,600	1,931.00	5,020,600	
極東貿易	4,800	1,355.00	6,504,000	
イワキ	22,100	505.00	11,160,500	
三愛石油	41,400	1,126.00	46,616,400	貸付有価証券 500株
稲畑産業	37,100	1,449.00	53,757,900	
G S Iクレオス	4,100	1,714.00	7,027,400	
明和産業	15,500	446.00	6,913,000	貸付有価証券 700株
クワザワホールディングス	6,000	594.00	3,564,000	
ヤマエ久野	12,300	1,135.00	13,960,500	
ワキタ	35,900	1,060.00	38,054,000	
東邦ホールディングス	54,000	1,814.00	97,956,000	
サンゲツ	45,400	1,543.00	70,052,200	
ミツウロコグループホールディングス	24,800	1,373.00	34,050,400	
シナネンホールディングス	6,900	2,939.00	20,279,100	
伊藤忠エネクス	37,200	1,018.00	37,869,600	
サンリオ	47,300	1,383.00	65,415,900	貸付有価証券 13,300株(5,600株)
サンワテクノス	11,900	980.00	11,662,000	
リョーサン	18,600	1,879.00	34,949,400	
新光商事	25,200	757.00	19,076,400	
トーヨー	7,600	1,991.00	15,131,600	
三信電気	9,000	2,096.00	18,864,000	貸付有価証券 100株
東陽テクニカ	18,000	1,156.00	20,808,000	貸付有価証券 100株
モスフードサービス	22,100	2,906.00	64,222,600	
加賀電子	16,800	2,392.00	40,185,600	

ソーダニッカ	17,400	542.00	9,430,800	
立花エレテック	12,400	1,687.00	20,918,800	
フォーバル	7,400	809.00	5,986,600	
PALTAC	27,000	5,590.00	150,930,000	
三谷産業	22,100	429.00	9,480,900	
太平洋興発	6,600	607.00	4,006,200	
西本Wismettac ホールディングス	3,800	2,223.00	8,447,400	貸付有価証券 2,000株
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,500	1,422.00	2,133,000	
コア商事ホールディン グス	3,200	1,445.00	4,624,000	
国際紙パルプ商事	39,800	237.00	9,432,600	貸付有価証券 200株
ヤマタネ	8,400	1,365.00	11,466,000	貸付有価証券 100株
丸紅建材リース	1,600	1,659.00	2,654,400	
日鉄物産	12,000	3,750.00	45,000,000	
泉州電業	4,700	3,170.00	14,899,000	
トラスコ中山	38,500	2,956.00	113,806,000	
オートボックスセブン	62,400	1,422.00	88,732,800	
モリト	12,300	606.00	7,453,800	
加藤産業	24,300	3,485.00	84,685,500	
北恵	4,200	908.00	3,813,600	
イノテック	8,700	1,010.00	8,787,000	
イエローハット	31,800	1,650.00	52,470,000	
J Kホールディングス	15,200	887.00	13,482,400	貸付有価証券 7,800株
日伝	15,200	2,286.00	34,747,200	
北沢産業	12,600	274.00	3,452,400	
杉本商事	9,100	2,456.00	22,349,600	
因幡電機産業	47,900	2,560.00	122,624,000	
東テク	5,600	2,866.00	16,049,600	
ミスミグループ本社	211,000	3,385.00	714,235,000	貸付有価証券 100株
アルテック	12,300	291.00	3,579,300	
タキヒヨー	5,100	1,935.00	9,868,500	
蔵王産業	3,200	1,327.00	4,246,400	

スズケン	71,300	3,690.00	263,097,000	貸付有価証券 900株
ジェコス	11,600	968.00	11,228,800	
グローセル	16,800	443.00	7,442,400	
ローソン	42,600	4,835.00	205,971,000	
サンエー	14,000	4,335.00	60,690,000	貸付有価証券 100株
カワチ薬品	13,000	2,910.00	37,830,000	
エービーシー・マート	26,300	5,570.00	146,491,000	
ハードオフコーポレーション	6,700	705.00	4,723,500	
アスクル	17,600	3,775.00	66,440,000	
ゲオホールディングス	30,300	1,217.00	36,875,100	
アダストリア	23,300	1,909.00	44,479,700	貸付有価証券 8,500株
ジーフット	10,200	395.00	4,029,000	貸付有価証券 3,700株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,400	345.00	828,000	
くら寿司	9,900	6,240.00	61,776,000	貸付有価証券 300株
キャンドゥ	8,000	1,848.00	14,784,000	
パルグループホールディングス	17,200	1,180.00	20,296,000	
エディオン	77,300	1,042.00	80,546,600	貸付有価証券 17,300株（10,400株）
サーラコーポレーション	34,200	569.00	19,459,800	貸付有価証券 14,800株
ワッツ	7,400	843.00	6,238,200	貸付有価証券 200株
ハローズ	6,300	3,510.00	22,113,000	
フジオフードグループ本 社	14,200	1,319.00	18,729,800	貸付有価証券 3,000株
あみやき亭	3,600	2,790.00	10,044,000	
ひらまつ	30,900	158.00	4,882,200	貸付有価証券 100株
大黒天物産	4,000	6,610.00	26,440,000	
ハニーズホールディングス	14,800	1,013.00	14,992,400	
ファーマライズホール	4,100	798.00	3,271,800	

ディングス				
アルペン	12,900	2,269.00	29,270,100	貸付有価証券 6,900株
ハブ	4,800	533.00	2,558,400	貸付有価証券 100株（100株）
クオールホールディングス	24,800	1,129.00	27,999,200	
ジンスホールディングス	8,900	6,720.00	59,808,000	貸付有価証券 200株
ピックカメラ	99,800	1,142.00	113,971,600	
D C Mホールディングス	103,000	1,189.00	122,467,000	貸付有価証券 100株
M o n o t a R O	119,700	5,370.00	642,789,000	貸付有価証券 5,200株
東京一番フーズ	4,300	588.00	2,528,400	
D Dホールディングス	6,600	532.00	3,511,200	貸付有価証券 3,500株（100株）
きちりホールディングス	4,500	603.00	2,713,500	貸付有価証券 2,300株
アークランドサービス ホールディングス	14,000	2,166.00	30,324,000	貸付有価証券 7,500株（100株）
J . フロント リテイ リング	201,000	794.00	159,594,000	貸付有価証券 300株
ドトール・日レスホール ディングス	24,200	1,461.00	35,356,200	
マツモトキヨシホール ディングス	69,600	4,425.00	307,980,000	
ブロンコビリー	8,800	2,339.00	20,583,200	貸付有価証券 4,700株
Z O Z O	115,800	2,463.00	285,215,400	貸付有価証券 1,900株
トレジャー・ファクト リー	4,900	687.00	3,366,300	
物語コーポレーション	4,500	12,530.00	56,385,000	貸付有価証券 2,100株
ココカラファイン	17,600	7,640.00	134,464,000	貸付有価証券 4,000株
三越伊勢丹ホールディ ングス	294,400	591.00	173,990,400	
H a m e e	6,000	1,877.00	11,262,000	貸付有価証券 2,800株
ウエルシアホールディ ングス	100,100	3,890.00	389,389,000	貸付有価証券

グス				200株
クリエイトSDホールディングス	28,400	3,780.00	107,352,000	
丸善CHIホールディングス	19,600	375.00	7,350,000	
ミサワ	3,400	622.00	2,114,800	貸付有価証券 1,500株
ティーライフ	2,500	1,130.00	2,825,000	貸付有価証券 200株
エー・ピーホールディングス	3,200	380.00	1,216,000	
チムニー	5,100	1,140.00	5,814,000	
シュッピン	11,400	841.00	9,587,400	貸付有価証券 100株
オイシックス・ラ・大地	16,600	3,020.00	50,132,000	貸付有価証券 1,700株(200株)
ネクステージ	28,700	1,280.00	36,736,000	
ジョイフル本田	49,300	1,474.00	72,668,200	
鳥貴族	4,900	1,413.00	6,923,700	貸付有価証券 2,300株
ホットランド	12,600	1,246.00	15,699,600	貸付有価証券 5,900株
すかいらーくホールディングス	188,600	1,602.00	302,137,200	貸付有価証券 101,200株(500株)
SFPホールディングス	9,600	1,233.00	11,836,800	貸付有価証券 1,100株
綿半ホールディングス	12,600	1,354.00	17,060,400	
ヨシックス	2,700	1,798.00	4,854,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	48,900	1,140.00	55,746,000	貸付有価証券 200株
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,700	906.00	7,882,200	貸付有価証券 4,100株
B E E N O S	7,800	2,969.00	23,158,200	
あさひ	12,500	1,583.00	19,787,500	貸付有価証券 5,900株(500株)
日本調剤	10,200	1,487.00	15,167,400	
コスモス薬品	14,900	16,650.00	248,085,000	
トーエル	8,100	811.00	6,569,100	
オンリー	2,900	429.00	1,244,100	貸付有価証券 200株(100株)
セブン&アイ・ホール	658,500	3,663.00	2,412,085,500	

ディングス				
クリエイト・レストランツ・ホールディング	90,500	618.00	55,929,000	貸付有価証券 42,200株（1,800株）
ツルハホールディングス	36,700	14,630.00	536,921,000	
サンマルクホールディングス	13,300	1,387.00	18,447,100	
フェリシモ	3,700	1,485.00	5,494,500	
トリドールホールディングス	41,600	1,392.00	57,907,200	貸付有価証券 4,300株（4,300株）
TOKYO BASE	15,200	508.00	7,721,600	貸付有価証券 5,400株（3,000株）
ウイルプラスホールディングス	2,100	712.00	1,495,200	
JMホールディングス	12,700	2,287.00	29,044,900	
サツドラホールディングス	2,500	2,028.00	5,070,000	
アレンザホールディングス	8,400	1,234.00	10,365,600	
串カツ田中ホールディングス	4,400	1,432.00	6,300,800	貸付有価証券 1,800株
パロックジャパンリミテッド	11,700	654.00	7,651,800	
クスリのアオキホールディングス	15,100	8,950.00	135,145,000	貸付有価証券 2,400株
力の源ホールディングス	7,600	534.00	4,058,400	貸付有価証券 2,000株
スシローグローバルホールディングス	92,400	3,745.00	346,038,000	
メディカルシステムネットワーク	16,300	635.00	10,350,500	貸付有価証券 7,300株
はるやまホールディングス	7,900	686.00	5,419,400	貸付有価証券 4,000株
ノジマ	29,900	2,810.00	84,019,000	
カップ・クリエイト	23,600	1,449.00	34,196,400	貸付有価証券 100株（100株）
ライトオン	12,600	600.00	7,560,000	貸付有価証券 4,000株（3,100株）
ジーンズメイト	5,100	303.00	1,545,300	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
良品計画	223,500	2,027.00	453,034,500	貸付有価証券 1,600株
三城ホールディングス	17,800	292.00	5,197,600	

アドヴァン	25,700	1,216.00	31,251,200	貸付有価証券 400株
アルビス	6,400	2,500.00	16,000,000	
コナカ	19,800	281.00	5,563,800	貸付有価証券 1,000株
ハウス オブ ローゼ	2,100	1,654.00	3,473,400	貸付有価証券 200株（200株）
G - 7ホールディングス	9,900	2,293.00	22,700,700	
イオン北海道	22,200	946.00	21,001,200	
コジマ	28,900	685.00	19,796,500	貸付有価証券 12,200株
ヒマラヤ	5,900	1,029.00	6,071,100	
コーナン商事	23,900	3,185.00	76,121,500	貸付有価証券 300株
エコス	6,200	2,058.00	12,759,600	
ワタミ	19,900	845.00	16,815,500	貸付有価証券 9,300株（2,900株）
マルシェ	4,400	472.00	2,076,800	
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	370,100	2,352.00	870,475,200	
西松屋チェーン	36,900	1,400.00	51,660,000	貸付有価証券 5,300株（3,800株）
ゼンショーホールディン グス	80,600	2,663.00	214,637,800	貸付有価証券 2,900株
幸楽苑ホールディングス	10,700	1,617.00	17,301,900	貸付有価証券 1,000株（700株）
ハークスレイ	3,500	879.00	3,076,500	
サイゼリヤ	25,000	1,914.00	47,850,000	貸付有価証券 100株
V Tホールディングス	69,700	423.00	29,483,100	
魚力	4,700	1,807.00	8,492,900	
ポブラ	4,400	388.00	1,707,200	貸付有価証券 700株
フジ・コーポレーション	4,500	2,188.00	9,846,000	
ユナイテッドアローズ	17,600	1,489.00	26,206,400	貸付有価証券 700株
ハイデイ日高	24,300	1,730.00	42,039,000	
京都きもの友禅	10,700	206.00	2,204,200	
コロワイド	55,900	1,602.00	89,551,800	貸付有価証券 29,900株（1,600株）

ピーシーデポコーポレーション	22,300	553.00	12,331,900	貸付有価証券 3,800株
壱番屋	11,900	5,080.00	60,452,000	
トップカルチャー	6,100	350.00	2,135,000	
P L A N T	4,300	744.00	3,199,200	貸付有価証券 100株
スギホールディングス	33,600	6,820.00	229,152,000	
薬王堂ホールディングス	7,300	2,350.00	17,155,000	
スクロール	25,900	737.00	19,088,300	貸付有価証券 6,200株（2,000株）
ヨンドシーホールディングス	17,100	1,961.00	33,533,100	
木曽路	22,000	2,361.00	51,942,000	
S R S ホールディングス	19,800	801.00	15,859,800	貸付有価証券 10,500株
千趣会	30,400	339.00	10,305,600	貸付有価証券 16,300株
タカキュー	13,000	128.00	1,664,000	貸付有価証券 6,200株（300株）
リテールパートナーズ	22,300	1,455.00	32,446,500	
ケーヨー	34,600	711.00	24,600,600	
上新電機	19,800	2,701.00	53,479,800	
日本瓦斯	26,600	5,420.00	144,172,000	
ロイヤルホールディングス	29,400	1,888.00	55,507,200	貸付有価証券 15,700株（300株）
東天紅	1,200	868.00	1,041,600	貸付有価証券 500株
いなげや	20,800	1,785.00	37,128,000	貸付有価証券 800株（800株）
島忠	31,700	5,490.00	174,033,000	貸付有価証券 5,700株（3,900株）
チヨダ	17,700	904.00	16,000,800	
ライフコーポレーション	12,800	3,595.00	46,016,000	貸付有価証券 400株（400株）
リンガーハット	20,700	2,232.00	46,202,400	貸付有価証券 9,700株（1,000株）
MrMaxHD	23,100	777.00	17,948,700	貸付有価証券 100株
テンアライド	15,500	305.00	4,727,500	貸付有価証券 7,300株
A O K I ホールディング	33,700	503.00	16,951,100	貸付有価証券

ス				4,500株
オークワ	26,400	1,291.00	34,082,400	
コメリ	26,000	2,864.00	74,464,000	貸付有価証券 100株
青山商事	34,800	527.00	18,339,600	貸付有価証券 5,400株
しまむら	19,600	10,340.00	202,664,000	
はせがわ	8,900	285.00	2,536,500	
高島屋	122,600	845.00	103,597,000	貸付有価証券 500株
松屋	33,900	750.00	25,425,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	79,700	678.00	54,036,600	貸付有価証券 300株
近鉄百貨店	6,400	3,110.00	19,904,000	貸付有価証券 1,200株
丸井グループ	154,300	1,740.00	268,482,000	貸付有価証券 200株
アクシアル リテイリン グ	14,000	5,020.00	70,280,000	
井筒屋	9,100	162.00	1,474,200	
イオン	647,700	3,298.00	2,136,114,600	貸付有価証券 2,200株
イズミ	34,200	3,680.00	125,856,000	
平和堂	34,200	2,203.00	75,342,600	
フジ	20,300	1,982.00	40,234,600	貸付有価証券 9,500株
ヤオコー	19,100	7,220.00	137,902,000	貸付有価証券 4,400株(700株)
ゼビオホールディングス	20,300	815.00	16,544,500	貸付有価証券 300株
ケーズホールディングス	162,400	1,413.00	229,471,200	貸付有価証券 100株
O l y m p i cグループ	8,700	887.00	7,716,900	貸付有価証券 4,600株(2,600株)
日産東京販売ホールディ ングス	24,800	270.00	6,696,000	
シルバーライフ	2,300	2,190.00	5,037,000	貸付有価証券 400株
一家ダイニングプロジェ クト	1,700	499.00	848,300	
Genky Drug S	7,400	4,070.00	30,118,000	貸付有価証券

t o r e s				100株
ナルミヤ・インターナショナル	3,800	757.00	2,876,600	
ブックオフグループホールディングス	9,800	830.00	8,134,000	貸付有価証券 4,800株
ギフト	1,600	1,667.00	2,667,200	
アインホールディングス	20,700	6,430.00	133,101,000	
元気寿司	4,200	2,233.00	9,378,600	
ヤマダホールディングス	512,900	532.00	272,862,800	貸付有価証券 700株
アークランドサカモト	26,300	1,660.00	43,658,000	貸付有価証券 7,200株（7,200株）
ニトリホールディングス	72,900	21,540.00	1,570,266,000	貸付有価証券 300株
グルメ杵屋	12,000	973.00	11,676,000	
愛眼	13,400	231.00	3,095,400	
ケーユーホールディングス	8,800	802.00	7,057,600	
吉野家ホールディングス	55,300	1,875.00	103,687,500	貸付有価証券 18,100株（12,300株）
松屋フーズホールディングス	8,100	3,375.00	27,337,500	
サガミホールディングス	22,500	1,190.00	26,775,000	
関西スーパーマーケット	14,000	1,236.00	17,304,000	
王将フードサービス	12,400	5,760.00	71,424,000	
プレナス	18,800	1,735.00	32,618,000	貸付有価証券 8,300株
ミニストップ	12,500	1,396.00	17,450,000	
アークス	34,400	2,322.00	79,876,800	
パローホールディングス	37,200	2,654.00	98,728,800	貸付有価証券 900株
藤久	3,600	768.00	2,764,800	貸付有価証券 1,900株
ベルク	8,300	6,270.00	52,041,000	
大庄	9,000	964.00	8,676,000	貸付有価証券 900株（600株）
ファーストリテイリング	22,500	86,900.00	1,955,250,000	貸付有価証券 100株
サンドラッグ	63,300	4,165.00	263,644,500	
サックスパー ホール	14,300	522.00	7,464,600	

ディングス				
ヤマザワ	3,900	1,746.00	6,809,400	
やまや	3,500	2,187.00	7,654,500	
ベルーナ	36,100	1,072.00	38,699,200	貸付有価証券 200株
島根銀行	4,400	592.00	2,604,800	
じもとホールディングス	11,400	818.00	9,325,200	
めぶきフィナンシャルグループ	875,900	204.00	178,683,600	貸付有価証券 3,100株
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,800	1,103.00	25,148,400	
九州フィナンシャルグループ	368,800	429.00	158,215,200	貸付有価証券 16,400株
ゆうちょ銀行	477,600	841.00	401,661,600	貸付有価証券 257,600株
富山第一銀行	40,200	285.00	11,457,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	962,800	362.00	348,533,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	112,200	668.00	74,949,600	貸付有価証券 1,700株
関西みらいフィナンシャルグループ	98,900	499.00	49,351,100	貸付有価証券 1,100株
三十三フィナンシャルグループ	15,600	1,261.00	19,671,600	
第四北越フィナンシャルグループ	29,300	2,249.00	65,895,700	
ひろぎんホールディングス	248,600	587.00	145,928,200	貸付有価証券 1,600株
新生銀行	123,700	1,271.00	157,222,700	
あおぞら銀行	100,400	1,916.00	192,366,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,530,800	457.20	5,271,881,760	
りそなホールディングス	1,832,600	356.90	654,054,940	貸付有価証券 1,200株
三井住友トラスト・ホールディングス	318,600	3,159.00	1,006,457,400	貸付有価証券 100株
三井住友フィナンシャルグループ	1,165,800	3,182.00	3,709,575,600	
千葉銀行	562,500	567.00	318,937,500	
群馬銀行	323,800	320.00	103,616,000	
武蔵野銀行	25,100	1,497.00	37,574,700	

千葉興業銀行	46,200	245.00	11,319,000	
筑波銀行	70,100	184.00	12,898,400	
七十七銀行	56,900	1,409.00	80,172,100	
青森銀行	13,100	2,431.00	31,846,100	
秋田銀行	10,800	1,369.00	14,785,200	
山形銀行	18,900	1,033.00	19,523,700	
岩手銀行	11,000	1,978.00	21,758,000	
東邦銀行	150,700	212.00	31,948,400	貸付有価証券 200株
東北銀行	8,100	1,069.00	8,658,900	
みちのく銀行	10,800	986.00	10,648,800	
ふくおかフィナンシャル グループ	142,000	1,852.00	262,984,000	貸付有価証券 1,900株
静岡銀行	410,500	756.00	310,338,000	
十六銀行	21,100	1,884.00	39,752,400	
スルガ銀行	172,400	336.00	57,926,400	
八十二銀行	406,800	344.00	139,939,200	貸付有価証券 200株
山梨中央銀行	19,600	756.00	14,817,600	
大垣共立銀行	33,300	2,116.00	70,462,800	
福井銀行	14,400	1,883.00	27,115,200	
北國銀行	16,800	2,648.00	44,486,400	
清水銀行	6,900	1,713.00	11,819,700	
富山銀行	3,200	2,944.00	9,420,800	
滋賀銀行	33,800	2,112.00	71,385,600	
南都銀行	28,000	1,736.00	48,608,000	貸付有価証券 300株
百五銀行	151,700	297.00	45,054,900	貸付有価証券 100株
京都銀行	60,400	5,460.00	329,784,000	
紀陽銀行	59,700	1,487.00	88,773,900	
ほくほくフィナンシャル グループ	112,200	977.00	109,619,400	
山陰合同銀行	100,000	503.00	50,300,000	
中国銀行	145,100	835.00	121,158,500	
鳥取銀行	5,700	1,122.00	6,395,400	
伊予銀行	240,500	648.00	155,844,000	貸付有価証券 1,000株

百十四銀行	17,900	1,522.00	27,243,800	
四国銀行	25,600	679.00	17,382,400	
阿波銀行	27,500	2,349.00	64,597,500	
大分銀行	9,700	2,125.00	20,612,500	
宮崎銀行	11,200	2,206.00	24,707,200	
佐賀銀行	10,200	1,321.00	13,474,200	
沖縄銀行	15,400	2,782.00	42,842,800	貸付有価証券 200株
琉球銀行	38,900	765.00	29,758,500	
セブン銀行	563,200	217.00	122,214,400	貸付有価証券 24,700株
みずほフィナンシャルグループ	2,290,500	1,303.00	2,984,521,500	貸付有価証券 46,000株
高知銀行	6,100	737.00	4,495,700	
山口フィナンシャルグループ	210,400	588.00	123,715,200	
長野銀行	5,500	1,415.00	7,782,500	
名古屋銀行	12,600	2,561.00	32,268,600	
北洋銀行	254,100	224.00	56,918,400	
愛知銀行	6,100	2,912.00	17,763,200	
中京銀行	6,900	1,972.00	13,606,800	
大光銀行	5,800	1,290.00	7,482,000	
愛媛銀行	23,500	991.00	23,288,500	貸付有価証券 300株
トマト銀行	6,500	1,060.00	6,890,000	
京葉銀行	71,900	421.00	30,269,900	
栃木銀行	81,400	170.00	13,838,000	
北日本銀行	5,200	1,966.00	10,223,200	
東和銀行	29,600	628.00	18,588,800	
福島銀行	15,900	198.00	3,148,200	貸付有価証券 4,800株
大東銀行	8,800	641.00	5,640,800	
トモニホールディングス	130,300	314.00	40,914,200	
フィデアホールディングス	163,600	106.00	17,341,600	
池田泉州ホールディングス	193,800	146.00	28,294,800	貸付有価証券 100株
F P G	52,000	483.00	25,116,000	貸付有価証券 4,000株（800株）

ジャパンインベストメントアドバイザー	8,500	1,280.00	10,880,000	貸付有価証券 4,000株
マーキュリアインベストメント	6,500	673.00	4,374,500	
S B Iホールディングス	193,500	2,476.00	479,106,000	貸付有価証券 800株
日本アジア投資	14,200	211.00	2,996,200	
ジャフコ グループ	25,900	4,925.00	127,557,500	
大和証券グループ本社	1,352,600	460.60	623,007,560	貸付有価証券 700株
野村ホールディングス	2,966,000	539.30	1,599,563,800	貸付有価証券 33,200株
岡三証券グループ	143,600	370.00	53,132,000	貸付有価証券 100株
丸三証券	50,100	445.00	22,294,500	貸付有価証券 26,800株
東洋証券	60,300	131.00	7,899,300	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	193,600	302.00	58,467,200	貸付有価証券 2,100株
光世証券	4,000	598.00	2,392,000	
水戸証券	48,800	222.00	10,833,600	
いちよし証券	31,500	454.00	14,301,000	
松井証券	96,300	797.00	76,751,100	貸付有価証券 100株
マネックスグループ	123,700	385.00	47,624,500	貸付有価証券 33,100株（31,800株）
極東証券	22,600	675.00	15,255,000	貸付有価証券 600株
岩井コスモホールディングス	15,900	1,281.00	20,367,900	
藍澤証券	30,300	727.00	22,028,100	貸付有価証券 100株
マネーパートナーズグループ	17,900	203.00	3,633,700	
スパークス・グループ	77,800	249.00	19,372,200	
小林洋行	4,800	270.00	1,296,000	貸付有価証券 100株
かんぽ生命保険	59,700	2,045.00	122,086,500	
S O M P Oホールディングス	316,900	4,157.00	1,317,353,300	
アニコム ホールディング	56,000	1,068.00	59,808,000	貸付有価証券

グス				600株
MS & A Dインシュアランスグループホール	440,700	3,082.00	1,358,237,400	
第一生命ホールディングス	953,900	1,538.00	1,467,098,200	貸付有価証券 54,300株
東京海上ホールディングス	596,000	5,281.00	3,147,476,000	貸付有価証券 500株
T & Dホールディングス	503,800	1,200.00	604,560,000	
アドバンスクリエイト	3,500	1,940.00	6,790,000	
全国保証	47,500	4,590.00	218,025,000	貸付有価証券 100株
ジェイリース	4,700	625.00	2,937,500	
イントラスト	5,900	838.00	4,944,200	
日本モーゲージサービス	7,000	1,131.00	7,917,000	貸付有価証券 200株(200株)
C a s a	5,900	1,020.00	6,018,000	
アルヒ	26,800	1,797.00	48,159,600	貸付有価証券 12,700株
プレミアグループ	9,200	2,266.00	20,847,200	貸付有価証券 100株
クレディセゾン	118,100	1,161.00	137,114,100	貸付有価証券 100株
芙蓉総合リース	17,700	6,760.00	119,652,000	
みずほリース	26,000	3,065.00	79,690,000	
東京センチュリー	33,900	8,140.00	275,946,000	貸付有価証券 1,500株
日本証券金融	74,300	523.00	38,858,900	貸付有価証券 200株
アイフル	257,100	245.00	62,989,500	貸付有価証券 6,700株
リコーリース	13,300	3,040.00	40,432,000	貸付有価証券 200株
イオンフィナンシャルサービス	103,200	1,219.00	125,800,800	
アコム	338,800	438.00	148,394,400	貸付有価証券 400株
ジャックス	18,600	1,824.00	33,926,400	
オリエントコーポレーション	456,000	114.00	51,984,000	貸付有価証券 1,300株
日立キャピタル	39,700	2,500.00	99,250,000	
オリックス	1,045,800	1,575.50	1,647,657,900	貸付有価証券

				6,900株
三菱UFJリース	427,800	496.00	212,188,800	貸付有価証券 4,200株
九州リースサービス	8,300	603.00	5,004,900	
日本取引所グループ	483,800	2,640.00	1,277,232,000	貸付有価証券 1,400株
イー・ギャランティ	19,300	2,183.00	42,131,900	
アサックス	8,700	714.00	6,211,800	貸付有価証券 4,700株
NECキャピタルソ リューション	6,900	1,892.00	13,054,800	
いちご	214,500	306.00	65,637,000	
日本駐車場開発	166,400	152.00	25,292,800	
スター・マイカ・ホール ディングス	8,700	1,347.00	11,718,900	
ADワークスグループ	31,900	161.00	5,135,900	貸付有価証券 14,900株
ヒューリック	357,600	1,140.00	407,664,000	貸付有価証券 7,600株
三栄建築設計	6,800	1,690.00	11,492,000	貸付有価証券 100株
野村不動産ホールディ ングス	102,400	2,229.00	228,249,600	
三重交通グループホール ディングス	34,200	485.00	16,587,000	
サムティ	23,900	1,769.00	42,279,100	貸付有価証券 3,100株
ディア・ライフ	23,800	404.00	9,615,200	貸付有価証券 200株
コーセーアールイー	5,000	632.00	3,160,000	
日本商業開発	10,700	1,706.00	18,254,200	貸付有価証券 5,000株
プレサンスコーポレー ション	27,700	1,777.00	49,222,900	貸付有価証券 13,000株(2,200株)
ハウスコム	2,900	1,290.00	3,741,000	
日本管理センター	9,100	1,188.00	10,810,800	
サンセイランディック	4,900	753.00	3,689,700	
エストラスト	2,300	678.00	1,559,400	
フージャースホールディ ングス	33,600	662.00	22,243,200	貸付有価証券 300株
オープンハウス	53,100	3,840.00	203,904,000	

東急不動産ホールディングス	458,300	544.00	249,315,200	貸付有価証券 500株
飯田グループホールディングス	140,600	2,118.00	297,790,800	
イーランド	2,700	781.00	2,108,700	
ムゲンエステート	10,300	469.00	4,830,700	
ビーロット	7,900	699.00	5,522,100	貸付有価証券 3,700株
ファーストブラザーズ	3,100	865.00	2,681,500	
ハウズドゥ	8,300	1,142.00	9,478,600	
シーアールイー	4,300	1,210.00	5,203,000	貸付有価証券 2,100株
プロパティエージェント	2,700	1,462.00	3,947,400	
ケイアイスター不動産	5,300	2,538.00	13,451,400	貸付有価証券 100株
アグレ都市デザイン	2,700	648.00	1,749,600	
グッドコムアセット	8,100	1,280.00	10,368,000	貸付有価証券 600株
ジェイ・エス・ビー	3,100	3,480.00	10,788,000	
テンポイノベーション	3,800	848.00	3,222,400	貸付有価証券 1,700株
グローバル・リンク・マネジメント	2,800	912.00	2,553,600	貸付有価証券 1,300株
パーク24	90,500	1,716.00	155,298,000	貸付有価証券 100株
パラカ	4,400	1,600.00	7,040,000	
三井不動産	819,400	2,141.50	1,754,745,100	
三菱地所	1,181,100	1,622.00	1,915,744,200	
平和不動産	30,900	3,690.00	114,021,000	貸付有価証券 900株
東京建物	166,500	1,435.00	238,927,500	
ダイビル	43,400	1,320.00	57,288,000	
京阪神ビルディング	27,000	1,862.00	50,274,000	貸付有価証券 9,100株（3,800株）
住友不動産	378,900	3,160.00	1,197,324,000	貸付有価証券 12,800株
テーオーシー	33,100	710.00	23,501,000	
東京楽天地	2,800	4,270.00	11,956,000	
レオパレス21	220,900	118.00	26,066,200	貸付有価証券 117,900株（44,700

				株)
スターツコーポレーション	22,900	2,887.00	66,112,300	
フジ住宅	19,600	650.00	12,740,000	貸付有価証券 500株
空港施設	16,900	470.00	7,943,000	貸付有価証券 200株
明和地所	9,200	553.00	5,087,600	
ゴールドクレスト	13,300	1,624.00	21,599,200	貸付有価証券 400株
エスリード	6,600	1,436.00	9,477,600	
日神グループホールディングス	24,900	415.00	10,333,500	
日本エスコン	30,500	855.00	26,077,500	
タカラレーベン	77,000	307.00	23,639,000	
A V A N T I A	9,500	837.00	7,951,500	
イオンモール	84,500	1,672.00	141,284,000	貸付有価証券 100株
毎日コムネット	4,300	694.00	2,984,200	
ファースト住建	7,200	1,038.00	7,473,600	貸付有価証券 1,700株
カチタス	41,700	3,345.00	139,486,500	貸付有価証券 500株
トーセイ	23,200	1,176.00	27,283,200	
穴吹興産	3,700	1,655.00	6,123,500	
サンフロンティア不動産	23,300	901.00	20,993,300	
エフ・ジェー・ネクスト	14,700	993.00	14,597,100	貸付有価証券 2,400株
インテリックス	4,700	509.00	2,392,300	
ランドビジネス	5,700	320.00	1,824,000	
サンネクスタグループ	5,300	976.00	5,172,800	
グランディハウス	13,100	395.00	5,174,500	貸付有価証券 400株
日本空港ビルデング	53,800	6,010.00	323,338,000	貸付有価証券 18,700株(6,500株)
明豊ファシリティワークス	7,500	650.00	4,875,000	
日本工営	11,000	2,797.00	30,767,000	
L I F U L L	57,000	363.00	20,691,000	
ミクシィ	31,100	2,525.00	78,527,500	

ジェイエシーリクルートメント	11,000	1,873.00	20,603,000	
日本M&Aセンター	125,000	6,650.00	831,250,000	貸付有価証券 2,400株
メンバーズ	4,800	2,309.00	11,083,200	
中広	2,200	326.00	717,200	貸付有価証券 100株
UTグループ	25,700	3,105.00	79,798,500	貸付有価証券 5,300株(4,900株)
アイティメディア	6,500	2,162.00	14,053,000	貸付有価証券 1,000株(100株)
タケエイ	17,900	1,266.00	22,661,400	貸付有価証券 5,600株
E・Jホールディングス	6,300	1,031.00	6,495,300	
ビーネックスグループ	20,500	1,263.00	25,891,500	貸付有価証券 300株
コシダカホールディングス	39,300	433.00	17,016,900	貸付有価証券 3,300株
アルトナー	3,900	892.00	3,478,800	
パソナグループ	17,700	2,105.00	37,258,500	貸付有価証券 1,300株
CDS	4,000	1,354.00	5,416,000	
リンクアンドモチベーション	30,000	576.00	17,280,000	貸付有価証券 16,100株(5,400株)
GCA	21,200	739.00	15,666,800	
エス・エム・エス	50,800	3,740.00	189,992,000	
サニーサイドアップグループ	5,600	609.00	3,410,400	貸付有価証券 400株(300株)
パーソルホールディングス	163,300	1,861.00	303,901,300	貸付有価証券 900株
リニカル	7,900	690.00	5,451,000	貸付有価証券 400株
クックパッド	51,300	305.00	15,646,500	貸付有価証券 1,000株
エスクリ	5,100	318.00	1,621,800	
アイ・ケイ・ケイ	7,900	580.00	4,582,000	
学情	5,800	1,411.00	8,183,800	貸付有価証券 1,100株
スタジオアリス	8,200	1,913.00	15,686,600	貸付有価証券 4,300株
シミックホールディング	8,000	1,307.00	10,456,000	貸付有価証券

ス				200株
エプロ	4,000	963.00	3,852,000	
N J S	4,000	2,055.00	8,220,000	
総合警備保障	65,000	5,270.00	342,550,000	貸付有価証券 500株
カカクコム	120,600	2,768.00	333,820,800	
セントケア・ホールディング	10,600	862.00	9,137,200	
サイネックス	2,700	635.00	1,714,500	
ルネサンス	9,100	882.00	8,026,200	
ディップ	22,300	2,719.00	60,633,700	貸付有価証券 10,100株(4,700株)
デジタルホールディングス	11,400	1,727.00	19,687,800	貸付有価証券 200株
新日本科学	17,700	657.00	11,628,900	貸付有価証券 6,900株(2,500株)
ツクイホールディングス	38,400	530.00	20,352,000	
キャリアデザインセンター	3,700	938.00	3,470,600	
ベネフィット・ワン	59,400	3,040.00	180,576,000	
エムスリー	360,100	9,424.00	3,393,582,400	
ツカダ・グローバルホールディング	13,000	250.00	3,250,000	貸付有価証券 6,100株
プラス	2,100	530.00	1,113,000	
アウトソーシング	93,500	1,363.00	127,440,500	貸付有価証券 44,400株
ウェルネット	16,500	424.00	6,996,000	
ワールドホールディングス	5,600	2,056.00	11,513,600	貸付有価証券 200株
ディー・エヌ・エー	69,100	1,824.00	126,038,400	貸付有価証券 400株
博報堂D Yホールディングス	227,100	1,425.00	323,617,500	
ぐるなび	28,400	512.00	14,540,800	貸付有価証券 3,600株
タカミヤ	17,300	525.00	9,082,500	
ジャパンベストレスキューシステム	12,900	889.00	11,468,100	
ファンコミュニケーションズ	44,900	436.00	19,576,400	貸付有価証券 200株

ライク	5,400	1,962.00	10,594,800	
ビジネス・ブレイクスルー	6,800	457.00	3,107,600	
エスプール	41,900	716.00	30,000,400	
W D Bホールディングス	7,500	2,648.00	19,860,000	
手間いらず	1,000	5,020.00	5,020,000	
ティア	9,500	402.00	3,819,000	
C D G	1,700	1,534.00	2,607,800	
バリューコマース	11,000	3,160.00	34,760,000	
インフォマート	165,200	950.00	156,940,000	貸付有価証券 8,200株
J Pホールディングス	51,300	270.00	13,851,000	貸付有価証券 600株
E P Sホールディングス	22,100	958.00	21,171,800	貸付有価証券 400株
レッグス	4,000	1,896.00	7,584,000	貸付有価証券 2,100株
プレステージ・インターナショナル	61,200	895.00	54,774,000	
アミューズ	8,900	2,495.00	22,205,500	
ドリームインキュベータ	5,000	1,252.00	6,260,000	
クイック	10,100	1,029.00	10,392,900	
T A C	9,800	243.00	2,381,400	
ケネディクス	140,500	747.00	104,953,500	貸付有価証券 26,000株(10,300株)
電通グループ	183,600	3,165.00	581,094,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,200	554.00	3,434,800	
ぴあ	4,700	2,696.00	12,671,200	貸付有価証券 2,100株(1,400株)
イオンファンタジー	6,300	2,399.00	15,113,700	貸付有価証券 1,500株
シーティーエス	18,400	933.00	17,167,200	
ネクシィーズグループ	5,000	850.00	4,250,000	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
H . U . グループホールディングス	45,700	2,703.00	123,527,100	貸付有価証券 100株
アルプス技研	14,400	2,107.00	30,340,800	貸付有価証券 100株
ダイオーズ	3,200	932.00	2,982,400	

日本空調サービス	17,100	763.00	13,047,300	
オリエンタルランド	173,700	16,620.00	2,886,894,000	貸付有価証券 100株
ダスキン	40,600	2,898.00	117,658,800	
明光ネットワークジャパン	20,700	544.00	11,260,800	貸付有価証券 5,700株(3,000株)
ファルコホールディングス	9,000	1,628.00	14,652,000	
秀英予備校	3,600	418.00	1,504,800	
ラウンドワン	45,600	889.00	40,538,400	貸付有価証券 3,200株
リゾートトラスト	74,900	1,429.00	107,032,100	
ビー・エム・エル	21,000	3,250.00	68,250,000	
ワタベウェディング	2,100	272.00	571,200	貸付有価証券 1,100株
りらいあコミュニケーションズ	28,400	1,307.00	37,118,800	貸付有価証券 1,100株
リソー教育	74,600	297.00	22,156,200	
早稲田アカデミー	7,100	991.00	7,036,100	貸付有価証券 200株(100株)
ユー・エス・エス	182,800	2,074.00	379,127,200	
東京個別指導学院	5,800	606.00	3,514,800	
サイバーエージェント	100,600	7,020.00	706,212,000	貸付有価証券 300株
楽天	761,200	971.00	739,125,200	貸付有価証券 1,200株
クリーク・アンド・リバー社	8,500	1,059.00	9,001,500	
モーニングスター	17,800	443.00	7,885,400	
テー・オー・ダブリュー	26,000	271.00	7,046,000	
山田コンサルティンググループ	10,600	963.00	10,207,800	
セントラルスポーツ	6,100	2,122.00	12,944,200	
フルキャストホールディングス	14,300	1,630.00	23,309,000	貸付有価証券 100株
エン・ジャパン	29,000	3,095.00	89,755,000	
リソルホールディングス	1,800	3,750.00	6,750,000	貸付有価証券 200株
テクノプロ・ホールディングス	32,600	8,400.00	273,840,000	

アトラ	3,800	323.00	1,227,400	貸付有価証券 2,000株
インターワークス	3,100	346.00	1,072,600	
アイ・アールジャパン ホールディングス	6,600	15,970.00	105,402,000	貸付有価証券 600株
Keep'er 技研	12,000	2,104.00	25,248,000	貸付有価証券 100株
ファーストロジック	3,100	720.00	2,232,000	貸付有価証券 200株
三機サービス	3,100	965.00	2,991,500	
Gunosy	10,200	690.00	7,038,000	
デザインワン・ジャパン	4,800	193.00	926,400	
イー・ガーディアン	7,200	2,936.00	21,139,200	
リブセンス	9,000	224.00	2,016,000	
ジャパンマテリアル	50,200	1,403.00	70,430,600	
ベクトル	20,300	915.00	18,574,500	貸付有価証券 9,800株
ウチヤマホールディング ス	8,000	300.00	2,400,000	
チャーム・ケア・コーポ レーション	13,900	1,244.00	17,291,600	
キャリアリンク	5,300	2,125.00	11,262,500	貸付有価証券 2,700株
I B J	13,400	757.00	10,143,800	貸付有価証券 6,200株
アサンテ	6,500	1,438.00	9,347,000	貸付有価証券 100株
N・フィールド	11,200	850.00	9,520,000	貸付有価証券 6,000株
バリューHR	6,500	1,720.00	11,180,000	貸付有価証券 3,000株
M&Aキャピタルパート ナーズ	13,200	5,750.00	75,900,000	
ライドオンエクスプレス ホールディングス	6,300	1,814.00	11,428,200	貸付有価証券 3,300株（3,300株）
E R Iホールディングス	4,600	633.00	2,911,800	
アピスト	2,500	2,846.00	7,115,000	
シグマクシス	11,200	1,781.00	19,947,200	貸付有価証券 3,900株
ウィルグループ	10,700	965.00	10,325,500	貸付有価証券 100株

エスクロー・エージェント・ジャパン	24,100	310.00	7,471,000	貸付有価証券 100株
メドピア	7,700	7,660.00	58,982,000	
レアジョブ	1,500	2,126.00	3,189,000	貸付有価証券 700株
リクルートホールディングス	1,169,900	4,198.00	4,911,240,200	貸付有価証券 37,600株
エラン	11,300	3,020.00	34,126,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
土木管理総合試験所	7,900	329.00	2,599,100	
ネットマーケティング	6,300	661.00	4,164,300	
日本郵政	1,338,500	791.50	1,059,422,750	貸付有価証券 400株
ベルシステム24ホールディングス	27,400	1,581.00	43,319,400	
鎌倉新書	12,300	1,100.00	13,530,000	貸付有価証券 3,600株
S M N	3,500	730.00	2,555,000	
一蔵	1,800	334.00	601,200	
L I T A L I C O	5,600	3,840.00	21,504,000	
グローバルキッズCOMPANY	2,900	942.00	2,731,800	
エアトリ	8,800	1,203.00	10,586,400	貸付有価証券 1,700株(100株)
アトラエ	5,000	2,618.00	13,090,000	貸付有価証券 100株
ストライク	6,200	4,870.00	30,194,000	
ソラスト	45,100	1,560.00	70,356,000	
セラク	5,100	2,181.00	11,123,100	貸付有価証券 2,300株
インソース	6,800	3,250.00	22,100,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
ベイカレント・コンサルティング	9,900	16,420.00	162,558,000	
Orchestra Holdings	3,400	2,172.00	7,384,800	
アイモバイル	5,800	1,226.00	7,110,800	貸付有価証券 1,800株(1,700株)
キャリアインデックス	6,700	622.00	4,167,400	貸付有価証券 3,100株(700株)
M S - J a p a n	5,300	1,047.00	5,549,100	

船場	3,200	870.00	2,784,000	
グレイステクノロジー	7,500	6,910.00	51,825,000	貸付有価証券 800株
ジャパンエレベーター サービスホールディング	18,800	5,010.00	94,188,000	貸付有価証券 900株（900株）
フルテック	2,300	1,530.00	3,519,000	貸付有価証券 1,000株
グリーンズ	4,100	440.00	1,804,000	貸付有価証券 1,900株
ツナググループ・ホール ディングス	2,700	297.00	801,900	貸付有価証券 400株
GameWith	4,900	612.00	2,998,800	
ソウルドアウト	3,900	1,442.00	5,623,800	貸付有価証券 100株（100株）
MS&Consulting	3,000	583.00	1,749,000	
エル・ティー・エス	1,200	4,010.00	4,812,000	貸付有価証券 500株（400株）
ミダック	2,100	3,045.00	6,394,500	
日総工産	10,900	650.00	7,085,000	貸付有価証券 200株
キュービーネットホール ディングス	6,800	1,396.00	9,492,800	
RPAホールディングス	12,400	615.00	7,626,000	貸付有価証券 3,100株（3,100株）
スプリックス	4,600	755.00	3,473,000	貸付有価証券 2,100株（400株）
マネジメントソリューションズ	8,000	1,801.00	14,408,000	
プロレド・パートナーズ	2,200	3,515.00	7,733,000	
and factory	1,600	656.00	1,049,600	
テノ・ホールディングス	1,300	1,328.00	1,726,400	貸付有価証券 600株
フロンティア・マネジメ ント	1,400	4,650.00	6,510,000	
ピアラ	800	2,216.00	1,772,800	貸付有価証券 400株
コプロ・ホールディング ス	1,000	3,750.00	3,750,000	
ギークス	1,700	1,046.00	1,778,200	
カーブスホールディング	44,800	764.00	34,227,200	貸付有価証券

ス				2,200株(2,200株)
フォーラムエンジニアリング	8,500	826.00	7,021,000	
ダイレクトマーケティングミックス	6,400	2,536.00	16,230,400	
アドバンテッジリスクマネジメント	8,300	635.00	5,270,500	
リログループ	89,300	2,507.00	223,875,100	貸付有価証券 16,400株
東祥	10,200	1,567.00	15,983,400	貸付有価証券 100株
エイチ・アイ・エス	23,700	1,583.00	37,517,100	貸付有価証券 11,200株(4,000株)
ラックランド	4,600	2,402.00	11,049,200	貸付有価証券 2,200株
共立メンテナンス	27,100	3,710.00	100,541,000	貸付有価証券 200株
イチネンホールディングス	18,300	1,263.00	23,112,900	
建設技術研究所	10,500	2,390.00	25,095,000	
スペース	10,600	803.00	8,511,800	貸付有価証券 1,300株
長大	6,500	1,498.00	9,737,000	
燦ホールディングス	7,100	1,257.00	8,924,700	
スバル興業	1,000	8,770.00	8,770,000	
東京テアトル	6,400	1,240.00	7,936,000	
タナベ経営	3,100	1,318.00	4,085,800	
ナガワ	5,200	9,790.00	50,908,000	
よみうりランド	3,500	6,020.00	21,070,000	
東京都競馬	10,700	4,630.00	49,541,000	貸付有価証券 5,000株
常磐興産	6,500	1,357.00	8,820,500	
カナモト	28,800	2,203.00	63,446,400	
東京ドーム	66,100	1,297.00	85,731,700	貸付有価証券 31,400株
西尾レントオール	15,100	2,129.00	32,147,900	
トランス・コスモス	15,500	2,553.00	39,571,500	貸付有価証券 600株
乃村工藝社	70,000	813.00	56,910,000	
藤田観光	6,500	1,378.00	8,957,000	貸付有価証券

				3,000株
KNT - CTホールディングス	10,200	931.00	9,496,200	貸付有価証券 5,000株
日本管財	17,500	2,056.00	35,980,000	貸付有価証券 8,600株
トーカイ	15,800	2,036.00	32,168,800	
白洋舎	1,900	2,460.00	4,674,000	貸付有価証券 900株
セコム	173,300	9,321.00	1,615,329,300	貸付有価証券 3,400株
セントラル警備保障	7,900	3,510.00	27,729,000	
丹青社	30,800	801.00	24,670,800	貸付有価証券 400株
メイテック	20,000	5,210.00	104,200,000	
応用地質	19,000	1,255.00	23,845,000	貸付有価証券 200株
船井総研ホールディングス	33,700	2,432.00	81,958,400	貸付有価証券 400株
進学会ホールディングス	6,400	431.00	2,758,400	
オオバ	11,600	732.00	8,491,200	貸付有価証券 100株(100株)
いであ	4,000	1,810.00	7,240,000	貸付有価証券 1,900株
学究社	4,800	1,280.00	6,144,000	
ベネッセホールディングス	54,400	2,004.00	109,017,600	貸付有価証券 100株
イオンディライト	20,100	2,643.00	53,124,300	貸付有価証券 300株
ナック	9,000	931.00	8,379,000	貸付有価証券 2,600株
ダイセキ	27,400	3,060.00	83,844,000	
ステップ	6,000	1,578.00	9,468,000	
小計	銘柄数：2,155 組入時価比率：98.1%		423,207,842,020 100.0%	
合計			423,207,842,020	

(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證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12月28日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年12月28日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	8,168,666,250	-	8,235,150,000	66,255,060
合計	8,168,666,250	-	8,235,150,000	66,255,060

（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12月28日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	5,214,785,641
コール・ローン	429,306,467
株式	768,837,633,633
投資証券	17,246,686,999
派生商品評価勘定	119,335,702
未収入金	7,510,585
未収配当金	607,595,083
差入委託証拠金	4,490,863,945
流動資産合計	796,953,718,055
資産合計	796,953,718,055
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	997,678
未払解約金	580,983,589
未払利息	216
その他未払費用	5,883,700
流動負債合計	587,865,183
負債合計	587,865,183
純資産の部	
元本等	
元本	238,838,088,958
剰余金	

(2020年12月28日現在)

期末剰余金又は期末欠損金（ ）	557,527,763,914
元本等合計	796,365,852,872
純資産合計	796,365,852,872
負債純資産合計	796,953,718,055

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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12月28日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	

1口当たり純資産額	3,3343円
(10,000口当たり純資産額)	(33,343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12月27日

至 2020年12月28日

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年12月28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12月28日現在		
期首		2019年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額		216,536,356,000円
同期中における追加設定元本額		62,373,550,292円
同期中における一部解約元本額		40,071,817,334円
期末元本額		238,838,088,958円
期末元本額の内訳*		
バランスセレクト30		43,051,338円
バランスセレクト50		129,598,666円
バランスセレクト70		142,388,591円
野村外国株式インデックスファンド		486,189,257円
野村世界6資産分散投信（安定コース）		4,166,870,789円
野村世界6資産分散投信（分配コース）		5,306,503,588円
野村世界6資産分散投信（成長コース）		4,214,935,714円
野村資産設計ファンド2015		13,352,687円
野村資産設計ファンド2020		13,508,632円
野村資産設計ファンド2025		25,117,601円
野村資産設計ファンド2030		33,111,672円
野村資産設計ファンド2035		26,394,533円
野村資産設計ファンド2040		51,746,885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）		41,336,589,607円
のむらっぴ・ファンド（保守型）		893,873,852円
のむらっぴ・ファンド（普通型）		7,564,310,015円
のむらっぴ・ファンド（積極型）		5,794,762,699円
野村資産設計ファンド2045		7,795,562円
野村インデックスファンド・外国株式		5,391,587,676円
マイ・ロード		1,184,038,011円
ネクストコア		29,902,113円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		129,293,192円
野村外国株インデックスBコース（野村SMA・EW向け）		1,936,794,730円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）		941,490,456円
野村資産設計ファンド2050		13,292,872円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		4,460,557円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		2,232,515円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		1,858,116円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		1,233,608円
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）		197,027,513円
のむらっぴ・ファンド（やや積極型）		493,581,248円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		2,286,497円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		2,904,789円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		19,572,531円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		6,815,507円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		28,974,510円
野村6資産均等バランス		896,858,134円
野村つみたて外国株投信		6,407,127,978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）		3,928,768,755円

世界6資産分散ファンド	48,049,158円
野村資産設計ファンド2060	5,478,203円
野村スリーゼロ先進国株式投信	106,094,691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	1,038,533,104円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	1,318,511,987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)	201,869,170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)	111,980,904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)	935,239,216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)	1,851,785,359円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	1,995,473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)	6,529,086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)	1,041,144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)	2,159,381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)	35,010,191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)	11,379,905円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	11,015,592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)	35,732,867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)	131,305,798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)	2,755,026,082円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	36,252,206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)	230,667,699円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	14,517,051,394円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	1,234,750円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	1,854,482円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	10,080,556円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	11,330,307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)	72,085,416,159円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,597,400,924円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	9,124,062,038円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	8,290,794,941円
マイバランスDC30	901,178,638円
マイバランスDC50	1,952,101,625円
マイバランスDC70	1,551,479,094円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	25,231,930,556円
野村DC運用戦略ファンド	538,775,680円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	42,375,464円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	332,855,481円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	276,005,694円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	240,362,156円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	13,481,065円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	6,635,546円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	31,261,820円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	4,799,270円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	3,869,624円

野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	3,466,746円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	125,950,765円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	91,954,267円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	46,231,019円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	56,513,000円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	1,775,685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12月28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	111,000	21.01	2,332,110.00	
		HALLIBURTON CO	138,000	19.21	2,650,980.00	
		SCHLUMBERGER LTD	224,000	21.64	4,847,360.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	64,000	16.94	1,084,160.00	
		CHENIERE ENERGY INC	36,400	57.90	2,107,560.00	
		CHEVRON CORP	312,700	85.33	26,682,691.00	
		CONCHO RESOURCES INC	31,000	57.46	1,781,260.00	
		CONOCOPHILLIPS	175,100	39.49	6,914,699.00	
		EOG RESOURCES INC	93,800	49.60	4,652,480.00	
		EXXON MOBIL CORP	687,000	41.60	28,579,200.00	
		HESS CORP	43,200	53.54	2,312,928.00	
		KINDER MORGAN INC	328,000	13.83	4,536,240.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	106,000	41.21	4,368,260.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	142,000	17.67	2,509,140.00	
		ONEOK INC	74,000	38.80	2,871,200.00	
		PHILLIPS 66	71,100	68.73	4,886,703.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	26,100	112.49	2,935,989.00	
		VALERO ENERGY CORP	65,400	55.68	3,641,472.00	
		WILLIAMS COS	195,000	20.74	4,044,300.00	
		AIR PRODUCTS	36,200	268.35	9,714,270.00	
ALBEMARLE CORP	16,700	149.64	2,498,988.00			
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	36,000	28.76	1,035,360.00			

CELANESE CORP-SERIES A	19,500	129.85	2,532,075.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	35,300	36.81	1,299,393.00
CORTEVA INC	120,500	39.50	4,759,750.00
DOW INC	119,800	54.79	6,563,842.00
DUPONT DE NEMOURS INC	119,900	69.55	8,339,045.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	23,000	101.31	2,330,130.00
ECOLAB INC	41,700	216.12	9,012,204.00
FMC CORP	21,200	114.43	2,425,916.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	13,600	110.06	1,496,816.00
LINDE PLC	84,800	256.62	21,761,376.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	42,600	90.61	3,859,986.00
MOSAIC CO/THE	56,000	21.96	1,229,760.00
PPG INDUSTRIES	38,100	145.00	5,524,500.00
RPM INTERNATIONAL INC	21,100	90.06	1,900,266.00
SHERWIN-WILLIAMS	13,390	733.90	9,826,921.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	10,500	275.05	2,888,025.00
VULCAN MATERIALS CO	22,300	143.22	3,193,806.00
AMCOR PLC	247,000	11.64	2,875,080.00
AVERY DENNISON CORP	13,400	153.40	2,055,560.00
BALL CORP	52,500	92.34	4,847,850.00
CROWN HOLDINGS INC	22,800	98.60	2,248,080.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	60,100	49.76	2,990,576.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	16,100	136.10	2,191,210.00
SEALED AIR CORP	26,500	46.10	1,221,650.00
WESTROCK CO	43,200	44.48	1,921,536.00
FREEMONT-MCMORAN INC	236,000	24.79	5,850,440.00
NEWMONT CORP	131,300	60.48	7,941,024.00
NUCOR CORP	50,900	52.44	2,669,196.00
STEEL DYNAMICS	33,400	36.38	1,215,092.00
BOEING CO	87,300	217.15	18,957,195.00
GENERAL DYNAMICS	39,400	149.01	5,870,994.00
HEICO CORP	6,300	131.20	826,560.00
HEICO CORP-CLASS A	12,300	118.28	1,454,844.00
HOWMET AEROSPACE INC	66,000	27.38	1,807,080.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	6,500	165.40	1,075,100.00

L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	34,900	185.16	6,462,084.00
LOCKHEED MARTIN	40,740	351.97	14,339,257.80
NORTHROP GRUMMAN CORP	25,900	299.60	7,759,640.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	246,200	70.27	17,300,474.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,810	383.48	2,228,018.80
TEXTRON INC	37,900	48.07	1,821,853.00
TRANSDIGM GROUP INC	8,280	606.71	5,023,558.80
ALLEGION PLC	14,800	113.03	1,672,844.00
CARRIER GLOBAL CORP	132,700	37.89	5,028,003.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	23,400	89.07	2,084,238.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	120,100	45.93	5,516,193.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,700	273.43	1,558,551.00
MASCO CORP	42,500	56.79	2,413,575.00
OWENS CORNING INC	16,800	78.40	1,317,120.00
SMITH (A.O.) CORP	21,800	55.48	1,209,464.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	38,600	143.66	5,545,276.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	21,300	107.28	2,285,064.00
AMETEK INC	37,300	119.04	4,440,192.00
EATON CORP PLC	65,400	118.07	7,721,778.00
EMERSON ELEC	97,700	79.98	7,814,046.00
GENERAC HOLDINGS INC	10,200	233.20	2,378,640.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	18,600	248.63	4,624,518.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	24,500	52.23	1,279,635.00
SUNRUN INC	18,500	68.62	1,269,470.00
3M CORP	93,300	174.52	16,282,716.00
GENERAL ELEC CO	1,417,000	10.65	15,091,050.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	113,800	209.53	23,844,514.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	35,400	55.52	1,965,408.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	40,300	24.81	999,843.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	16,900	420.12	7,100,028.00
CATERPILLAR INC DEL	87,700	179.56	15,747,412.00
CUMMINS INC	23,800	226.53	5,391,414.00
DEERE & COMPANY	47,900	269.21	12,895,159.00
DOVER CORP	24,300	124.02	3,013,686.00

FORTIVE CORP	48,300	69.64	3,363,612.00
IDEX CORP	12,300	196.56	2,417,688.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	50,800	202.44	10,283,952.00
INGERSOLL-RAND INC	58,000	46.03	2,669,740.00
NORDSON CORP	8,700	198.95	1,730,865.00
OTIS WORLDWIDE CORP	65,900	65.79	4,335,561.00
PACCAR	55,700	86.11	4,796,327.00
PARKER HANNIFIN CORP	20,700	269.45	5,577,615.00
PENTAIR PLC	27,500	52.59	1,446,225.00
SNAP-ON INC	8,400	169.77	1,426,068.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	25,900	179.92	4,659,928.00
WABTEC CORP	28,800	73.31	2,111,328.00
XYLEM INC	30,300	100.25	3,037,575.00
FASTENAL CO	91,800	49.52	4,545,936.00
GRAINGER(W.W.) INC	7,440	415.57	3,091,840.80
HD SUPPLY HOLDINGS INC	26,800	55.99	1,500,532.00
UNITED RENTALS INC	12,200	232.62	2,837,964.00
CINTAS CORP	14,300	338.40	4,839,120.00
COPART INC	33,700	123.71	4,169,027.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	36,100	95.63	3,452,243.00
ROLLINS INC	35,850	40.05	1,435,792.50
WASTE CONNECTIONS INC	42,100	101.49	4,272,729.00
WASTE MANAGEMENT INC	69,000	117.00	8,073,000.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	22,000	94.66	2,082,520.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	27,100	94.64	2,564,744.00
FEDEX CORPORATION	40,700	268.82	10,940,974.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	114,700	172.19	19,750,193.00
XPO LOGISTICS INC	14,300	119.14	1,703,702.00
DELTA AIR LINES INC	25,200	39.73	1,001,196.00
SOUTHWEST AIRLINES	24,900	46.28	1,152,372.00
AMERCO	1,720	447.89	770,370.80
CSX CORP	123,000	90.05	11,076,150.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	13,200	137.42	1,813,944.00
KANSAS CITY SOUTHERN	15,000	199.73	2,995,950.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	20,800	42.21	877,968.00

HOLDINGS INC				
NORFOLK SOUTHERN CORP	41,200	234.39	9,656,868.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	15,300	198.25	3,033,225.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	155,900	52.88	8,243,992.00	
UNION PAC CORP	109,500	203.39	22,271,205.00	
APTIV PLC	43,200	128.42	5,547,744.00	
AUTOLIV INC	14,000	92.56	1,295,840.00	
BORGWARNER INC	40,400	38.96	1,573,984.00	
LEAR CORP	9,700	159.86	1,550,642.00	
FORD MOTOR COMPANY	631,000	8.86	5,590,660.00	
GENERAL MOTORS CO	210,800	41.58	8,765,064.00	
TESLA INC	120,630	661.77	79,829,315.10	
DR HORTON INC	56,100	71.85	4,030,785.00	
GARMIN LTD	24,200	120.21	2,909,082.00	
LENNAR CORP-A	43,700	80.43	3,514,791.00	
MOHAWK INDUSTRIES	10,200	138.72	1,414,944.00	
NEWELL BRANDS INC	66,000	21.22	1,400,520.00	
NVR INC	559	4,216.39	2,356,962.01	
PULTEGROUP INC	43,000	45.20	1,943,600.00	
WHIRLPOOL CORP	10,300	193.20	1,989,960.00	
HASBRO INC	21,400	93.15	1,993,410.00	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	31,100	162.72	5,060,592.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	20,000	351.42	7,028,400.00	
NIKE INC-B	201,000	141.60	28,461,600.00	
V F CORP	53,200	83.90	4,463,480.00	
ARAMARK	39,000	37.64	1,467,960.00	
CARNIVAL CORP	85,000	20.84	1,771,400.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,280	1,412.55	6,045,714.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	22,000	117.89	2,593,580.00	
DOMINOS PIZZA INC	6,310	396.73	2,503,366.30	
DRAFTKINGS INC - CL A	27,700	52.11	1,443,447.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	44,600	106.89	4,767,294.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	54,300	57.01	3,095,643.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	44,500	128.75	5,729,375.00	
MCDONALD'S CORP	120,700	211.39	25,514,773.00	
	34,000	18.55	630,700.00	

MELCO RESORTS & ENTERT-ADR				
MGM RESORTS INTERNATIONAL	73,000	30.74	2,244,020.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	29,300	70.66	2,070,338.00	
STARBUCKS CORP	190,300	102.01	19,412,503.00	
VAIL RESORTS INC	6,700	275.15	1,843,505.00	
WYNN RESORTS LTD	15,500	114.39	1,773,045.00	
YUM BRANDS INC	48,500	107.54	5,215,690.00	
GENUINE PARTS CO	23,200	99.36	2,305,152.00	
LKQ CORP	49,000	36.26	1,776,740.00	
POOL CORP	6,500	364.73	2,370,745.00	
AMAZON.COM INC	68,900	3,172.69	218,598,341.00	
BOOKING HOLDINGS INC	6,630	2,088.35	13,845,760.50	
CHEWY INC - CLASS A	12,300	104.01	1,279,323.00	
EBAY INC	113,500	50.12	5,688,620.00	
ETSY INC	19,400	190.31	3,692,014.00	
EXPEDIA GROUP INC	22,300	126.96	2,831,208.00	
MERCADOLIBRE INC	7,200	1,690.48	12,171,456.00	
WAYFAIR INC - CLASS A	10,400	252.82	2,629,328.00	
DOLLAR GENERAL CORP	40,200	211.28	8,493,456.00	
DOLLAR TREE INC	38,100	109.03	4,154,043.00	
TARGET CORP	81,000	175.19	14,190,390.00	
ADVANCE AUTO PARTS	10,900	160.68	1,751,412.00	
AUTOZONE	3,730	1,204.22	4,491,740.60	
BEST BUY COMPANY INC	37,200	102.55	3,814,860.00	
BURLINGTON STORES INC	10,500	247.88	2,602,740.00	
CARMAX INC	26,100	92.30	2,409,030.00	
CARVANA CO	10,200	274.71	2,802,042.00	
HOME DEPOT	174,000	270.92	47,140,080.00	
LOWES COS INC	123,000	162.77	20,020,710.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	11,970	461.76	5,527,267.20	
ROSS STORES INC	57,500	118.02	6,786,150.00	
TIFFANY & CO	18,400	131.16	2,413,344.00	
TJX COS INC	193,000	66.98	12,927,140.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	19,500	146.88	2,864,160.00	
ULTA BEAUTY INC	8,600	264.64	2,275,904.00	
	71,710	364.58	26,144,031.80	

COSTCO WHOLESALE CORPORATION				
KROGER CO	124,000	31.53	3,909,720.00	
SYSCO CORP	77,800	72.42	5,634,276.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	120,000	39.62	4,754,400.00	
WALMART INC	228,700	143.50	32,818,450.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	49,400	78.03	3,854,682.00	
COCA COLA CO	659,200	53.44	35,227,648.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	32,600	47.74	1,556,324.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	27,100	215.81	5,848,451.00	
KEURIG DR PEPPER INC	92,000	31.88	2,932,960.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	31,400	45.47	1,427,758.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	63,700	89.81	5,720,897.00	
PEPSICO INC	223,600	145.06	32,435,416.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	89,400	49.44	4,419,936.00	
BUNGE LIMITED	22,000	64.33	1,415,260.00	
CAMPBELL SOUP CO	30,900	48.55	1,500,195.00	
CONAGRA BRANDS INC	82,100	36.38	2,986,798.00	
GENERAL MILLS	97,900	59.13	5,788,827.00	
HERSHEY CO/THE	23,500	149.95	3,523,825.00	
HORMEL FOODS CORP	50,000	47.17	2,358,500.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,600	116.09	2,159,274.00	
KELLOGG CO	43,300	61.78	2,675,074.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	109,000	34.98	3,812,820.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	23,900	77.65	1,855,835.00	
MCCORMICK & CO INC.	40,200	93.47	3,757,494.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	229,900	57.85	13,299,715.00	
TYSON FOODS INC-CL A	46,500	64.79	3,012,735.00	
ALTRIA GROUP INC	299,100	41.72	12,478,452.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	251,200	82.51	20,726,512.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	39,800	86.86	3,457,028.00	
COLOROX CO	20,200	203.80	4,116,760.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	131,000	85.04	11,140,240.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	55,200	133.89	7,390,728.00	
PROCTER & GAMBLE CO	402,500	137.72	55,432,300.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	36,800	260.95	9,602,960.00	

ABBOTT LABORATORIES	287,600	108.35	31,161,460.00
ABIOMED INC	7,200	303.41	2,184,552.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	12,080	528.03	6,378,602.40
BAXTER INTERNATIONAL INC.	82,200	79.59	6,542,298.00
BECTON,DICKINSON	46,600	247.99	11,556,334.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	233,900	34.59	8,090,601.00
DANAHER CORP	103,000	221.49	22,813,470.00
DENTSPLY SIRONA INC	35,200	51.82	1,824,064.00
DEXCOM INC	15,500	355.02	5,502,810.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	101,400	88.63	8,987,082.00
HOLOGIC INC	43,400	74.77	3,245,018.00
IDEXX LABORATORIES INC	13,720	497.14	6,820,760.80
INSULET CORP	10,600	257.28	2,727,168.00
INTUITIVE SURGICAL INC	18,850	807.00	15,211,950.00
MASIMO CORP	8,200	265.94	2,180,708.00
MEDTRONIC PLC	216,800	114.03	24,721,704.00
NOVOCURE LTD	14,000	171.97	2,407,580.00
RESMED INC	23,200	212.42	4,928,144.00
STERIS PLC	13,800	186.19	2,569,422.00
STRYKER CORP	54,400	237.06	12,896,064.00
TELEFLEX INC	7,560	405.06	3,062,253.60
THE COOPER COMPANIES, INC.	8,400	358.37	3,010,308.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	15,300	174.77	2,673,981.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	12,400	282.96	3,508,704.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	33,300	149.25	4,970,025.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	25,700	96.97	2,492,129.00
ANTHEM INC	40,700	308.67	12,562,869.00
CARDINAL HEALTH INC	47,200	53.80	2,539,360.00
CENTENE CORP	93,500	58.02	5,424,870.00
CIGNA CORP	59,400	198.83	11,810,502.00
CVS HEALTH CORP	211,800	67.97	14,396,046.00
DAVITA INC	12,500	115.13	1,439,125.00
HCA HEALTHCARE INC	43,700	164.24	7,177,288.00
HENRY SCHEIN INC	23,100	65.83	1,520,673.00
HUMANA INC	21,650	404.83	8,764,569.50
	15,800	203.87	3,221,146.00

LABORATORY CRP OF AMER HLDGS				
MCKESSON CORP	26,000	170.78	4,440,280.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	9,700	207.10	2,008,870.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	21,900	120.23	2,633,037.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	153,600	340.79	52,345,344.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	13,000	136.93	1,780,090.00	
ABBVIE INC	285,000	103.26	29,429,100.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	35,100	152.63	5,357,313.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	18,700	137.56	2,572,372.00	
AMGEN INC	95,000	222.93	21,178,350.00	
BIOGEN INC	25,500	248.89	6,346,695.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	30,600	88.66	2,712,996.00	
EXACT SCIENCES CORP	25,800	139.56	3,600,648.00	
GILEAD SCIENCES INC	201,700	57.07	11,511,019.00	
INCYTE CORP	31,200	87.37	2,725,944.00	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	21,400	59.68	1,277,152.00	
MODERNA INC	44,300	123.39	5,466,177.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,200	97.67	1,386,914.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	17,010	488.93	8,316,699.30	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	12,600	175.03	2,205,378.00	
SEAGEN INC	19,300	190.61	3,678,773.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	42,500	234.46	9,964,550.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	366,700	61.15	22,423,705.00	
CATALENT INC	24,800	105.31	2,611,688.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	66,000	30.54	2,015,640.00	
ELI LILLY & CO.	138,900	166.66	23,149,074.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	35,900	68.92	2,474,228.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	9,000	157.28	1,415,520.00	
JOHNSON & JOHNSON	425,700	152.47	64,906,479.00	
MERCK & CO INC	408,500	80.14	32,737,190.00	
PERRIGO CO PLC	23,500	44.01	1,034,235.00	
PFIZER INC	898,000	37.27	33,468,460.00	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	18,500	48.90	904,650.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	173,000	9.83	1,700,590.00	
VIATRIS INC	200,722	17.77	3,566,829.94	

ZOETIS INC	76,500	160.72	12,295,080.00
BANK OF AMERICA CORP	1,260,000	29.96	37,749,600.00
CITIGROUP	335,700	60.57	20,333,349.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	70,000	35.12	2,458,400.00
FIFTH THIRD BANCORP	120,000	27.58	3,309,600.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	27,300	140.53	3,836,469.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	172,000	12.35	2,124,200.00
JPMORGAN CHASE & CO	492,700	124.52	61,351,004.00
KEYCORP	158,000	16.19	2,558,020.00
M & T BANK CORP	21,700	124.96	2,711,632.00
PNC FINANCIAL	69,400	146.15	10,142,810.00
REGIONS FINANCIAL CORP	162,000	15.95	2,583,900.00
SVB FINANCIAL GROUP	8,700	375.99	3,271,113.00
TRUIST FINANCIAL CORP	216,500	46.99	10,173,335.00
US BANCORP	222,100	46.49	10,325,429.00
WELLS FARGO CO	634,000	29.84	18,918,560.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	226,500	226.53	51,309,045.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	69,000	25.10	1,731,900.00
VOYA FINANCIAL INC	21,700	57.40	1,245,580.00
AFLAC INC	109,900	43.84	4,818,016.00
ALLEGHANY CORP	2,300	598.15	1,375,745.00
ALLSTATE CORP	50,700	107.19	5,434,533.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,500	87.57	1,094,625.00
AMERICAN INTL GROUP	139,000	37.37	5,194,430.00
AON PLC	37,800	210.61	7,961,058.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	65,000	34.86	2,265,900.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	31,900	123.42	3,937,098.00
ASSURANT INC	10,200	132.62	1,352,724.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,200	42.38	898,456.00
BROWN & BROWN INC	38,800	46.31	1,796,828.00
CHUBB LTD	72,600	150.83	10,950,258.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	24,600	85.23	2,096,658.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	4,400	243.25	1,070,300.00
EVEREST RE GROUP LTD	6,200	229.18	1,420,916.00
FNF GROUP	45,400	38.53	1,749,262.00
GLOBE LIFE INC	15,700	92.87	1,458,059.00

HARTFORD FINANCIAL SERVICES	58,900	48.41	2,851,349.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	29,900	49.74	1,487,226.00	
LOEWS CORP	43,100	44.00	1,896,400.00	
MARKEL CORP	2,330	990.90	2,308,797.00	
MARSH & MCLENNAN COS	81,800	115.13	9,417,634.00	
METLIFE INC	124,600	46.31	5,770,226.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	44,400	48.48	2,152,512.00	
PROGRESSIVE CO	95,800	98.31	9,418,098.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	63,700	76.74	4,888,338.00	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	10,500	113.58	1,192,590.00	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	7,800	161.35	1,258,530.00	
TRAVELERS COS INC/THE	40,800	138.49	5,650,392.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	20,600	211.81	4,363,286.00	
WR BERKLEY CORP	23,900	66.10	1,579,790.00	
ACCENTURE PLC-CL A	103,200	257.30	26,553,360.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	27,400	107.46	2,944,404.00	
AUTOMATIC DATA PROCESS	69,200	176.56	12,217,952.00	
BLACK KNIGHT INC	24,200	87.96	2,128,632.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	22,600	87.37	1,974,562.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	19,400	150.01	2,910,194.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	88,300	81.07	7,158,481.00	
EPAM SYSTEMS INC	8,950	356.34	3,189,243.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	99,800	140.79	14,050,842.00	
FISERV INC	91,500	112.63	10,305,645.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	13,300	270.49	3,597,517.00	
GARTNER INC	14,100	158.63	2,236,683.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	49,000	205.55	10,071,950.00	
GODADDY INC - CLASS A	26,900	84.96	2,285,424.00	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	144,600	124.69	18,030,174.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	12,700	157.69	2,002,663.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	21,500	104.24	2,241,160.00	
MASTERCARD INC	144,400	336.00	48,518,400.00	
MONGODB INC	8,100	378.48	3,065,688.00	
OKTA INC	19,500	275.60	5,374,200.00	
	52,000	94.71	4,924,920.00	

PAYCHEX INC				
PAYPAL HOLDINGS INC	180,300	238.64	43,026,792.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	4,800	323.04	1,550,592.00	
SQUARE INC - A	60,400	228.28	13,788,112.00	
TWILIO INC - A	21,200	362.88	7,693,056.00	
VERISIGN INC	16,400	214.59	3,519,276.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	272,600	208.70	56,891,620.00	
WESTERN UNION CO	66,000	21.86	1,442,760.00	
WIX.COM LTD	8,400	267.10	2,243,640.00	
ADOBE INC	77,500	499.86	38,739,150.00	
ANSYS INC	13,800	364.17	5,025,546.00	
AUTODESK INC.	35,200	301.39	10,608,928.00	
AVALARA INC	13,100	180.51	2,364,681.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	45,000	134.00	6,030,000.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	21,600	110.06	2,377,296.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	18,700	134.75	2,519,825.00	
CITRIX SYSTEMS INC	19,800	132.57	2,624,886.00	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	25,100	84.98	2,132,998.00	
COUPA SOFTWARE INC	10,700	356.74	3,817,118.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	22,900	221.12	5,063,648.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	7,100	161.17	1,144,307.00	
DATADOG INC - CLASS A	24,700	106.28	2,625,116.00	
DOCUSIGN INC	28,100	244.93	6,882,533.00	
DROPBOX INC-CLASS A	51,000	24.65	1,257,150.00	
DYNATRACE INC	29,000	43.18	1,252,220.00	
FAIR ISAAC CORP	4,630	518.45	2,400,423.50	
FORTINET INC	22,400	149.79	3,355,296.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	13,600	127.21	1,730,056.00	
HUBSPOT INC	7,040	414.76	2,919,910.40	
INTUIT INC	42,200	381.16	16,084,952.00	
MICROSOFT CORP	1,163,500	222.75	259,169,625.00	
NORTONLIFELOCK INC	91,000	21.04	1,914,640.00	
ORACLE CORPORATION	324,500	64.96	21,079,520.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	15,500	367.14	5,690,670.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,100	462.13	3,743,253.00	

PTC INC	18,700	119.85	2,241,195.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	11,900	398.51	4,742,269.00
SALESFORCE.COM INC	147,800	225.78	33,370,284.00
SERVICENOW INC	30,910	553.89	17,120,739.90
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	59,800	42.65	2,550,470.00
SPLUNK INC	25,600	180.20	4,613,120.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	36,700	71.69	2,631,023.00
SYNOPSYS INC	24,400	256.28	6,253,232.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	6,860	931.77	6,391,942.20
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,520	434.26	2,831,375.20
VMWARE INC - CLASS A	14,200	142.90	2,029,180.00
WORKDAY INC-CLASS A	29,100	248.76	7,238,916.00
ZENDESK INC	18,800	142.83	2,685,204.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	28,150	375.17	10,561,035.50
ZSCALER INC	11,900	205.27	2,442,713.00
ARISTA NETWORKS INC	9,600	288.84	2,772,864.00
CISCO SYSTEMS	686,000	44.54	30,554,440.00
F5 NETWORKS INC	10,400	175.61	1,826,344.00
JUNIPER NETWORKS INC	53,000	22.40	1,187,200.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	27,400	168.47	4,616,078.00
APPLE INC	2,768,000	131.97	365,292,960.00
DELL TECHNOLOGIES-C	40,700	72.99	2,970,693.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	202,000	11.76	2,375,520.00
HP INC	232,000	24.26	5,628,320.00
NETAPP INC	35,200	65.80	2,316,160.00
SEAGATE TECHNOLOGY	37,300	62.95	2,348,035.00
WESTERN DIGITAL CORP	47,600	49.92	2,376,192.00
AMPHENOL CORP-CL A	47,800	129.17	6,174,326.00
ARROW ELECTRS INC	12,100	97.12	1,175,152.00
CDW CORPORATION	23,900	129.23	3,088,597.00
COGNEX CORP	27,800	80.73	2,244,294.00
CORNING INC	122,500	36.27	4,443,075.00
IPG PHOTONICS CORP	5,900	220.97	1,303,723.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	30,400	130.95	3,980,880.00
TE CONNECTIVITY LTD	53,300	119.82	6,386,406.00

TRIMBLE INC	42,200	66.65	2,812,630.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	8,900	376.89	3,354,321.00
ADVANCED MICRO DEVICES	190,200	91.81	17,462,262.00
ANALOG DEVICES INC	60,300	144.47	8,711,541.00
APPLIED MATERIALS	147,700	85.33	12,603,241.00
BROADCOM INC	65,380	431.46	28,208,854.80
ENPHASE ENERGY INC	19,500	181.39	3,537,105.00
INTEL CORP	686,900	47.07	32,332,383.00
KLA CORP	25,100	259.08	6,502,908.00
LAM RESEARCH	23,790	480.34	11,427,288.60
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	107,100	47.05	5,039,055.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	42,500	86.58	3,679,650.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	41,100	136.77	5,621,247.00
MICRON TECHNOLOGY	178,800	70.58	12,619,704.00
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	6,900	357.07	2,463,783.00
NVIDIA CORP	99,740	519.75	51,839,865.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	45,200	157.33	7,111,316.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	68,000	31.99	2,175,320.00
QORVO INC	18,000	167.11	3,007,980.00
QUALCOMM INC	182,100	148.79	27,094,659.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	26,500	151.21	4,007,065.00
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	8,200	324.09	2,657,538.00
TERADYNE INC	27,200	118.88	3,233,536.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	148,800	161.64	24,052,032.00
XILINX INC	39,200	141.99	5,566,008.00
AT & T INC	1,151,000	28.69	33,022,190.00
CENTURYLINK INC	147,000	9.86	1,449,420.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	24.36	584,640.00
LIBERTY GLOBAL PLC-C	64,000	23.79	1,522,560.00
VERIZON COMMUNICATIONS	668,600	58.84	39,340,424.00
T-MOBILE US INC	89,600	132.92	11,909,632.00
ALLIANT ENERGY CORP	40,900	50.02	2,045,818.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	80,200	81.42	6,529,884.00
DUKE ENERGY CORP	118,200	89.67	10,598,994.00
EDISON INTERNATIONAL	61,200	62.19	3,806,028.00

ENTERGY CORP	33,600	95.35	3,203,760.00
EVERGY INC	35,900	53.43	1,918,137.00
EVERSOURCE ENERGY	56,400	84.15	4,746,060.00
EXELON CORPORATION	157,600	41.83	6,592,408.00
FIRSTENERGY CORP	86,600	29.68	2,570,288.00
NEXTERA ENERGY INC	317,700	74.98	23,821,146.00
NRG ENERGY INC	40,500	35.08	1,420,740.00
OGE ENERGY CORP	32,500	31.15	1,012,375.00
PG&E CORP	237,000	12.39	2,936,430.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	19,100	77.87	1,487,317.00
PPL CORPORATION	129,000	26.89	3,468,810.00
SOUTHERN CO.	169,700	59.80	10,148,060.00
XCEL ENERGY INC	84,800	64.63	5,480,624.00
ATMOS ENERGY CORP	20,200	92.77	1,873,954.00
UGI CORP	36,000	35.01	1,260,360.00
AMEREN CORPORATION	41,500	76.47	3,173,505.00
CENTERPOINT ENERGY INC	83,000	21.58	1,791,140.00
CMS ENERGY CORP	48,200	58.16	2,803,312.00
CONSOLIDATED EDISON INC	53,500	70.44	3,768,540.00
DOMINION ENERGY INC	135,000	74.23	10,021,050.00
DTE ENERGY COMPANY	30,800	119.72	3,687,376.00
NISOURCE INC	65,000	22.09	1,435,850.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	81,500	57.15	4,657,725.00
SEMPRA ENERGY	47,300	125.90	5,955,070.00
WEC ENERGY GROUP INC	50,800	89.43	4,543,044.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	29,100	149.14	4,339,974.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	39,600	45.47	1,800,612.00
ALLY FINANCIAL INC	63,000	34.54	2,176,020.00
AMERICAN EXPRESS CO	110,100	117.35	12,920,235.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	73,600	97.30	7,161,280.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	49,600	88.29	4,379,184.00
SYNCHRONY FINANCIAL	86,000	33.96	2,920,560.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	19,200	189.70	3,642,240.00
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	27,500	49.09	1,349,975.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	128,500	41.04	5,273,640.00

BLACKROCK INC	24,830	707.18	17,559,279.40
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	108,300	64.99	7,038,417.00
CARLYLE GROUP INC/THE	22,000	31.36	689,920.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	17,900	92.05	1,647,695.00
CME GROUP INC	58,700	178.48	10,476,776.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,400	327.43	2,095,552.00
FRANKLIN RESOURCES INC	51,000	24.80	1,264,800.00
GOLDMAN SACHS GROUP	52,600	256.16	13,474,016.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	87,600	112.69	9,871,644.00
INVESCO LTD	58,000	17.61	1,021,380.00
KKR & CO INC-A	79,600	39.84	3,171,264.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,130	573.08	3,512,980.40
MOODYS CORP	27,300	278.88	7,613,424.00
MORGAN STANLEY	218,300	68.09	14,864,047.00
MSCI INC	13,720	432.46	5,933,351.20
NASDAQ INC	18,400	128.62	2,366,608.00
NORTHERN TRUST CORP	32,100	91.59	2,940,039.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	19,600	92.92	1,821,232.00
S&P GLOBAL INC	38,800	316.58	12,283,304.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	246,000	52.06	12,806,760.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	56.51	1,079,341.00
STATE STREET CORP	56,300	71.78	4,041,214.00
T ROWE PRICE GROUP INC	36,700	148.28	5,441,876.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	13,000	63.39	824,070.00
AES CORP	110,000	23.27	2,559,700.00
VISTRA CORP	70,000	18.71	1,309,700.00
CERNER CORP	49,200	78.41	3,857,772.00
TELADOC HEALTH INC	18,100	207.95	3,763,895.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	21,800	287.58	6,269,244.00
10X GENOMICS INC-CLASS A	10,000	151.33	1,513,300.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	50,000	117.31	5,865,500.00
AVANTOR INC	84,000	27.07	2,273,880.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	3,640	575.07	2,093,254.80
ILLUMINA INC	23,400	367.29	8,594,586.00
IQVIA HOLDINGS INC	30,800	175.94	5,418,952.00

METTLER-TOLEDO INTL	3,880	1,140.19	4,423,937.20
PERKINELMER INC	18,800	139.71	2,626,548.00
PPD INC	20,000	34.85	697,000.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	63,880	458.09	29,262,789.20
WATERS CORP	10,500	247.09	2,594,445.00
COSTAR GROUP INC	6,350	906.63	5,757,100.50
EQUIFAX INC	19,700	193.96	3,821,012.00
IHS MARKIT LTD	61,200	86.37	5,285,844.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17,100	62.21	1,063,791.00
TRUNSION	31,100	100.97	3,140,167.00
VERISK ANALYTICS INC	24,700	201.23	4,970,381.00
CBRE GROUP INC	54,800	62.93	3,448,564.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	184,000	4.19	770,960.00
ALTICE USA INC-A	46,000	36.03	1,657,380.00
CABLE ONE INC	820	2,260.86	1,853,905.20
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	23,220	656.49	15,243,697.80
COMCAST CORP-CL A	736,500	50.38	37,104,870.00
DISCOVERY INC - A	24,500	28.57	699,965.00
DISCOVERY INC - C	56,000	25.14	1,407,840.00
DISH NETWORK CORP-A	38,400	31.06	1,192,704.00
FOX CORP-CLASS A	58,000	28.31	1,641,980.00
FOX CORP-CLASS B	25,400	28.00	711,200.00
INTERPUBRIC GROUP	67,000	23.52	1,575,840.00
LIBERTY BROADBAND CORP-A	4,000	158.75	635,000.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	25,900	159.43	4,129,237.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	29,900	42.79	1,279,421.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	42.68	550,572.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	67,000	17.82	1,193,940.00
OMNICOM GROUP	34,500	61.30	2,114,850.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	175,000	6.30	1,103,375.00
VIACOMCBS INC-CLASS B	90,000	35.99	3,239,100.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	126,200	90.96	11,479,152.00
DISNEY (WALT) CO	292,100	173.73	50,746,533.00
ELECTRONIC ARTS	46,600	141.81	6,608,346.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	34,000	41.67	1,416,780.00

	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	26,600	71.64	1,905,624.00	
	NETFLIX INC	71,250	513.97	36,620,362.50	
	ROKU INC	16,600	356.99	5,926,034.00	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	18,100	202.50	3,665,250.00	
	ALPHABET INC-CL A	48,600	1,734.16	84,280,176.00	
	ALPHABET INC-CL C	48,560	1,738.85	84,438,556.00	
	FACEBOOK INC-A	388,900	267.40	103,991,860.00	
	IAC/INTERACTIVE CORP	12,600	179.48	2,261,448.00	
	MATCH GROUP INC	39,700	152.08	6,037,576.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	75,300	71.04	5,349,312.00	
	SNAP INC-A	146,200	50.15	7,331,930.00	
	TWITTER INC	126,700	53.97	6,837,999.00	
	ZILLOW GROUP INC - A	9,800	143.86	1,409,828.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	22,600	138.64	3,133,264.00	
	小計銘柄数：594			5,310,390,402.85	
				(550,262,653,543)	
	組入時価比率：69.1%			71.5%	
カナダドル	TOPICUS.COM INC	5,951	0.00	0.00	
	CAMECO CORP	56,000	17.31	969,360.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	190,000	30.71	5,834,900.00	
	CENOVUS ENERGY INC	156,000	7.57	1,180,920.00	
	ENBRIDGE INC	332,000	41.25	13,695,000.00	
	IMPERIAL OIL	37,500	24.45	916,875.00	
	INTER PIPELINE LTD	75,000	12.27	920,250.00	
	KEYERA CORP	34,000	22.64	769,760.00	
	PARKLAND CORP	21,700	40.46	877,982.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	88,000	30.85	2,714,800.00	
	SUNCOR ENERGY INC	248,000	21.89	5,428,720.00	
	TC ENERGY CORP	151,800	52.96	8,039,328.00	
	NUTRIEN LTD	91,600	60.65	5,555,540.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	24,700	59.13	1,460,511.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	41,000	91.64	3,757,240.00	
	B2GOLD CORP	175,000	7.18	1,256,500.00	
	BARRICK GOLD	288,000	29.37	8,458,560.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	93,000	23.09	2,147,370.00	

FRANCO-NEVADA CORP	30,300	166.54	5,046,162.00
KINROSS GOLD CORP	217,000	9.46	2,052,820.00
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	42,700	53.79	2,296,833.00
LUNDIN MINING CORP	95,000	10.92	1,037,400.00
PAN AMERICAN SILVER CORP	35,300	42.22	1,490,366.00
SSR MINING INC	34,000	25.01	850,340.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	79,000	22.47	1,775,130.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	76,100	54.33	4,134,513.00
YAMANA GOLD INC	164,000	7.27	1,192,280.00
CAE INC	41,000	34.53	1,415,730.00
WSP GLOBAL INC	17,700	120.37	2,130,549.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	12,800	90.80	1,162,240.00
GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	30,000	36.14	1,084,200.00
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	18,300	91.13	1,667,679.00
AIR CANADA	20,400	22.87	466,548.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	114,200	140.70	16,067,940.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	22,000	440.63	9,693,860.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	44,700	90.56	4,048,032.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	31,800	36.09	1,147,662.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	46,000	77.85	3,581,100.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	10,200	167.01	1,703,502.00
DOLLARAMA INC	46,600	52.86	2,463,276.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	138,000	44.62	6,157,560.00
EMPIRE CO LTD A	26,000	35.07	911,820.00
LOBLAW COMPANIES	28,500	63.72	1,816,020.00
METRO INC	43,500	57.38	2,496,030.00
WESTON(GEORGE)LTD	12,300	95.68	1,176,864.00
SAPUTO INC	41,000	35.53	1,456,730.00
BAUSCH HEALTH COS INC	51,000	25.98	1,324,980.00
CANOPY GROWTH CORP	41,000	33.07	1,355,870.00
BANK OF MONTREAL	103,600	97.25	10,075,100.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	198,700	68.54	13,618,898.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	71,900	110.34	7,933,446.00
NATIONAL BANK OF CANADA	55,000	71.79	3,948,450.00

ROYAL BANK OF CANADA	230,700	104.91	24,202,737.00
TORONTO DOMINION BANK	292,000	71.86	20,983,120.00
ONEX CORPORATION	13,200	72.38	955,416.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,140	429.50	1,778,130.00
GREAT-WEST LIFECO INC	42,000	29.56	1,241,520.00
IA FINANCIAL CORP INC	18,300	54.83	1,003,389.00
INTACT FINANCIAL CORP	24,500	151.76	3,718,120.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	313,000	22.44	7,023,720.00
POWER CORPORATION OF CANADA	97,000	29.39	2,850,830.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	94,000	56.16	5,279,040.00
CGI INC	37,200	101.71	3,783,612.00
SHOPIFY INC - CLASS A	17,460	1,568.19	27,380,597.40
BLACKBERRY LTD	71,000	9.06	643,260.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,200	1,671.52	5,348,864.00
OPEN TEXT CORP	47,000	58.63	2,755,610.00
BCE INC	25,600	54.81	1,403,136.00
TELUS CORP	58,600	25.57	1,498,402.00
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	58,200	59.90	3,486,180.00
EMERA INC	42,500	53.96	2,293,300.00
FORTIS INC	75,300	52.49	3,952,497.00
HYDRO ONE LTD	55,000	28.65	1,575,750.00
ALTAGAS LTD	42,000	18.73	786,660.00
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	97,000	20.81	2,018,570.00
ATCO LTD CL1	13,000	36.46	473,980.00
CANADIAN UTILITIES LTD A	20,300	31.24	634,172.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	207,200	52.44	10,865,568.00
CI FINANCIAL CORP	33,600	15.91	534,576.00
IGM FINANCIAL INC	15,000	34.63	519,450.00
TMX GROUP LTD	9,500	127.63	1,212,485.00
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	18,750	74.90	1,404,375.00
NORTHLAND POWER INC	30,000	44.81	1,344,300.00
THOMSON REUTERS CORP	27,800	103.32	2,872,296.00
FIRSTSERVICE CORP	6,000	174.20	1,045,200.00
QUEBECOR INC-CL B	27,000	32.90	888,300.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	77,000	22.41	1,725,570.00

小計	銘柄数：87			332,246,278.40	
				(26,782,372,501)	
	組入時価比率：3.4%			3.5%	
ユーロ	TENARIS SA	71,000	6.71	476,694.00	
	ENI SPA	412,000	8.58	3,536,608.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	81,000	8.80	712,800.00	
	NESTE OYJ	68,600	58.08	3,984,288.00	
	OMV AG	25,000	32.88	822,000.00	
	REPSOL SA	236,000	8.34	1,969,656.00	
	REPSOL SA-RTS	258,000	0.28	73,478.40	
	TOTAL SE	407,500	35.89	14,625,175.00	
	VOPAK	11,400	42.80	487,920.00	
	AIR LIQUIDE SA	77,700	134.50	10,450,650.00	
	AKZO NOBEL	30,800	89.00	2,741,200.00	
	ARKEMA	11,600	94.42	1,095,272.00	
	BASF SE	147,700	64.69	9,554,713.00	
	COVESTRO AG	30,500	50.36	1,535,980.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	33,000	26.99	890,670.00	
	FUCHS PETROLUB SE -PFD	10,500	46.78	491,190.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	27,900	141.00	3,933,900.00	
	LANXESS	15,200	62.76	953,952.00	
	SOLVAY SA	13,100	97.12	1,272,272.00	
	SYMRISE AG	20,900	107.55	2,247,795.00	
	UMICORE	31,000	38.60	1,196,600.00	
	CRH PLC	127,700	34.91	4,458,007.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	24,900	61.78	1,538,322.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	35,300	38.24	1,349,872.00	
	ARCELORMITTAL	119,000	19.01	2,262,190.00	
	VOESTALPINE AG	20,000	29.34	586,800.00	
	STORA ENSO OYJ-R	96,000	15.29	1,468,320.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	84,000	29.85	2,507,400.00	
	AIRBUS SE	96,400	92.04	8,872,656.00	
	DASSAULT AVIATION SA	330	883.50	291,555.00	
	MTU AERO ENGINES AG	8,400	216.90	1,821,960.00	
	SAFRAN SA	51,900	118.65	6,157,935.00	
	THALES SA	16,300	75.38	1,228,694.00	

COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	82,600	37.37	3,086,762.00
KINGSPAN GROUP PLC	26,400	58.55	1,545,720.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	42,918	27.23	1,168,657.14
BOUYGUES	34,800	33.97	1,182,156.00
EIFFAGE SA	14,100	78.52	1,107,132.00
FERROVIAL SA	79,790	22.52	1,796,870.80
HOCHTIEF AG	3,800	78.45	298,110.00
VINCI	84,300	82.36	6,942,948.00
LEGRAND SA	42,400	72.30	3,065,520.00
PRYSMIAN SPA	43,000	28.20	1,212,600.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	87,100	116.95	10,186,345.00
SIEMENS ENERGY AG	66,000	28.21	1,861,860.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	38,000	31.65	1,202,700.00
SIEMENS AG	123,900	117.00	14,496,300.00
ALSTOM	39,390	45.95	1,809,970.50
CNH INDUSTRIAL NV	170,000	10.36	1,762,050.00
GEA GROUP AG	24,200	29.20	706,640.00
KION GROUP AG	11,000	71.70	788,700.00
KNORR-BREMSE AG	11,300	108.62	1,227,406.00
KONE OYJ	54,700	65.70	3,593,790.00
RATIONAL AG	830	727.00	603,410.00
WARTSILA OYJ	83,000	8.12	673,960.00
BRENNTAG AG	24,100	64.08	1,544,328.00
DEUTSCHE POST AG-REG	160,200	40.00	6,408,000.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	42,000	9.86	414,120.00
ADP	4,700	101.10	475,170.00
AENA SME SA	10,700	138.60	1,483,020.00
ATLANTIA SPA	79,000	14.58	1,152,215.00
GETLINK	72,000	14.30	1,029,600.00
CONTINENTAL AG	17,500	121.65	2,128,875.00
FAURECIA	15,000	41.81	627,150.00
MICHELIN (CGDE)	26,900	105.50	2,837,950.00
VALEO SA	37,300	32.48	1,211,504.00
BAYER MOTOREN WERK	53,300	73.38	3,911,154.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,200	55.70	568,140.00

DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	140,100	58.52	8,198,652.00	
FERRARI NV	20,200	186.65	3,770,330.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	178,000	14.69	2,615,176.00	
PEUGEOT CITROEN	97,000	22.74	2,205,780.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	25,400	57.42	1,458,468.00	
RENAULT SA	28,100	36.60	1,028,460.00	
VOLKSWAGEN AG	5,100	169.70	865,470.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	29,900	152.46	4,558,554.00	
SEB SA	3,800	146.40	556,320.00	
ADIDAS AG	31,200	293.60	9,160,320.00	
ESSILORLUXOTTICA	46,000	128.65	5,917,900.00	
HERMES INTERNATIONAL	5,100	851.40	4,342,140.00	
KERING SA	12,290	552.70	6,792,683.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	44,820	496.45	22,250,889.00	
MONCLER SPA	32,100	48.21	1,547,541.00	
PUMA SE	16,300	90.50	1,475,150.00	
ACCOR SA	32,000	29.33	938,560.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	26,600	166.80	4,436,880.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	15,400	35.73	550,242.00	
SODEXO	13,200	70.06	924,792.00	
DELIVERY HERO SE	20,900	118.45	2,475,605.00	
HELLOFRESH SE	24,000	58.15	1,395,600.00	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	20,600	90.40	1,862,240.00	
PROSUS NV	79,700	89.60	7,141,120.00	
ZALANDO SE	24,900	89.20	2,221,080.00	
INDITEX SA	176,000	25.95	4,567,200.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	95,000	13.64	1,295,800.00	
COLRUYT SA	8,700	48.80	424,560.00	
JERONIMO MARTINS	38,000	13.68	519,840.00	
KESKO OYJ-B SHS	44,000	20.92	920,480.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	178,000	23.46	4,175,880.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	124,700	58.25	7,263,775.00	
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	91,000	9.19	836,836.00	
HEINEKEN HOLDING NV	20,000	76.25	1,525,000.00	
HEINEKEN NV	41,500	89.66	3,720,890.00	

PERNOD RICARD SA	34,300	157.75	5,410,825.00
REMY COINTREAU	3,900	152.50	594,750.00
DANONE	99,800	53.64	5,353,272.00
JDE PEET'S BV	11,000	36.69	403,590.00
KERRY GROUP PLC-A	25,900	119.00	3,082,100.00
HENKEL AG & CO KGAA	18,000	78.15	1,406,700.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	28,900	90.48	2,614,872.00
BEIERSDORF AG	16,000	93.18	1,490,880.00
LOREAL-ORD	40,500	302.30	12,243,150.00
UNILEVER PLC	239,900	47.82	11,473,217.50
BIOMERIEUX	6,900	117.30	809,370.00
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	7,200	106.70	768,240.00
DIASORIN SPA	4,000	167.40	669,600.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	148,700	44.00	6,542,800.00
SARTORIUS AG-VORZUG	5,790	342.20	1,981,338.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	42,000	41.65	1,749,300.00
AMPLIFON SPA	20,300	33.24	674,772.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	33,600	68.00	2,284,800.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	67,300	38.21	2,571,533.00
ORPEA	9,300	107.30	997,890.00
ARGENX SE	7,000	250.80	1,755,600.00
GALAPAGOS NV	7,000	81.24	568,680.00
GRIFOLS SA	46,800	23.85	1,116,180.00
BAYER AG-REG	160,800	48.18	7,747,344.00
IPSEN	5,500	68.00	374,000.00
MERCK KGAA	21,100	136.40	2,878,040.00
ORION OYJ	16,500	37.10	612,150.00
RECORDATI SPA	16,800	44.29	744,072.00
SANOFI	182,600	78.34	14,304,884.00
UCB SA	20,600	84.68	1,744,408.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	70,000	8.18	572,600.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,074,000	4.10	4,403,400.00
BANCO SANTANDER SA	2,840,739	2.67	7,584,773.13
BNP PARIBAS	184,100	43.79	8,062,659.50
CAIXABANK	600,000	2.13	1,283,400.00

COMMERZBANK AG	158,000	5.36	847,196.00
CREDIT AGRICOLE SA	184,000	10.52	1,935,680.00
ERSTE GROUP BANK AG	43,000	24.94	1,072,420.00
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	101,000	13.23	1,336,735.00
ING GROEP NV	632,000	7.91	5,003,544.00
INTESA SANPAOLO	2,700,000	1.91	5,165,100.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROEP NV	40,900	58.56	2,395,104.00
MEDIOBANCA S.P.A.	107,000	7.53	805,924.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	20,100	16.86	338,886.00
SOCIETE GENERALE	129,000	17.27	2,228,346.00
UNICREDIT SPA	341,000	7.69	2,622,972.00
EURAZEO SE	5,953	56.00	333,368.00
EXOR NV	17,200	65.66	1,129,352.00
GROUPE BRUXELLES LAM	17,700	82.50	1,460,250.00
SOFINA SA	2,300	264.50	608,350.00
WENDEL	4,300	98.45	423,335.00
AEGON NV	293,000	3.17	931,447.00
AGEAS	28,900	43.84	1,266,976.00
ALLIANZ SE-REG	67,600	199.88	13,511,888.00
ASSICURAZIONI GENERALI	176,000	14.28	2,513,280.00
AXA SA	313,000	19.65	6,151,076.00
CNP ASSURANCES	28,000	13.48	377,440.00
HANNOVER RUECK SE	9,600	131.30	1,260,480.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	22,700	241.80	5,488,860.00
NN GROUP NV	47,000	35.95	1,689,650.00
POSTE ITALIANE SPA	88,000	8.36	736,384.00
SAMPO OYJ-A SHS	76,300	34.18	2,607,934.00
SCOR SE	23,200	26.64	618,048.00
ADYEN NV	2,920	1,969.50	5,750,940.00
AMADEUS IT GROUP SA	72,700	60.68	4,411,436.00
ATOS SE	15,300	74.98	1,147,194.00
BECHTLE AG	4,400	177.80	782,320.00
CAPGEMINI SA	27,300	122.50	3,344,250.00
EDENRED	38,200	46.94	1,793,108.00

NEXI SPA	74,000	16.35	1,209,900.00
WORLDLINE SA	38,699	77.16	2,986,014.84
DASSAULT SYSTEMES SA	21,100	163.35	3,446,685.00
NEMETSCHKE SE	9,200	61.15	562,580.00
SAP SE	168,400	103.76	17,473,184.00
TEAMVIEWER AG	25,200	43.85	1,105,020.00
NOKIA OYJ	923,000	3.17	2,934,217.00
ASML HOLDING NV	68,910	393.50	27,116,085.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	211,000	31.28	6,600,080.00
STMICROELECTRONICS NV	101,800	29.99	3,052,982.00
ALTICE EUROPE N.V.	99,000	5.33	527,670.00
CELLNEX TELECOM SA	51,200	49.35	2,526,720.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	546,000	14.80	8,080,800.00
ELISA OYJ	22,100	44.65	986,765.00
ILIAD SA	2,400	166.55	399,720.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	55,000	9.94	546,975.00
KONINKLIJKE KPN NV	560,000	2.51	1,410,080.00
ORANGE SA	325,000	9.75	3,168,750.00
PROXIMUS	26,000	16.53	429,780.00
TELECOM ITALIA SPA	1,170,000	0.38	446,706.00
TELECOM ITALIA-RNC	880,000	0.42	377,608.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	150,000	2.28	343,350.00
TELEFONICA SA	780,000	3.33	2,603,640.00
TELEFONICA SA-RTS	780,000	0.18	145,080.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	34.50	579,600.00
ELECTRICITE DE FRANCE	109,000	12.55	1,367,950.00
ELIA GROUP SA/NV	4,800	96.00	460,800.00
ENDESA S.A.	50,000	22.82	1,141,000.00
ENEL SPA	1,317,000	8.27	10,892,907.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	476,000	5.18	2,465,680.00
FORTUM OYJ	72,000	19.30	1,389,960.00
IBERDROLA SA	975,000	11.47	11,183,250.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	70,000	16.49	1,154,650.00
TERNA SPA	222,000	6.16	1,368,408.00
VERBUND AG	11,000	66.50	731,500.00

	ENAGAS SA	39,000	18.22	710,775.00	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	50,000	18.76	938,250.00	
	SNAM SPA	315,000	4.60	1,449,630.00	
	E.ON SE	358,000	8.96	3,210,544.00	
	ENGIE	294,000	12.60	3,704,400.00	
	RWE AG	102,800	33.80	3,474,640.00	
	SUEZ	52,000	16.26	845,520.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	87,000	19.85	1,727,385.00	
	AMUNDI SA	10,000	67.15	671,500.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	313,000	8.98	2,811,679.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG	30,600	138.20	4,228,920.00	
	NATIXIS	158,000	2.72	429,760.00	
	UNIPER SE	31,100	28.00	870,800.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	21,600	69.86	1,508,976.00	
	QIAGEN N.V.	39,400	42.60	1,678,440.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,540	292.60	1,328,404.00	
	BUREAU VERITAS SA	47,000	22.13	1,040,110.00	
	RANDSTAD NV	18,400	54.54	1,003,536.00	
	TELEPERFORMANCE	9,600	273.00	2,620,800.00	
	WOLTERS KLUWER	44,400	68.66	3,048,504.00	
	AROUNDTOWN SA	173,000	6.12	1,058,760.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	55,500	42.58	2,363,190.00	
	LEG IMMOBILIEN AG	11,000	124.78	1,372,580.00	
	VONOVIA SE	83,800	58.34	4,888,892.00	
	PUBLICIS GROUPE	38,000	41.37	1,572,060.00	
	SES FDR	56,000	7.78	436,128.00	
	BOLLORE	138,000	3.40	470,028.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	14,400	80.30	1,156,320.00	
	VIVENDI SA	140,000	25.93	3,630,200.00	
	SCOUT24 AG	17,100	67.35	1,151,685.00	
	小計銘柄数：238			679,230,546.81	
				(85,813,987,283)	
	組入時価比率：10.8%			11.2%	
英債券	BP PLC	3,320,000	2.63	8,731,600.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	672,000	13.27	8,921,472.00	

ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	607,000	12.85	7,799,950.00
CRODA INTERNATIONAL PLC	22,300	64.08	1,428,984.00
JOHNSON MATTHEY PLC	30,200	24.70	745,940.00
ANGLO AMERICAN PLC	198,000	24.35	4,821,300.00
ANTOFAGASTA PLC	59,000	14.40	849,600.00
BHP GROUP PLC	342,000	19.64	6,718,248.00
EVRAZ PLC	76,000	4.77	362,748.00
FRESNILLO PLC	30,000	11.39	341,850.00
GLENCORE PLC	1,610,000	2.35	3,783,500.00
RIO TINTO PLC-REG	180,600	55.74	10,066,644.00
MONDI PLC	75,000	17.09	1,281,750.00
BAE SYSTEMS PLC	512,000	5.04	2,580,480.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,380,000	1.15	1,597,350.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	850,000	1.78	1,521,075.00
DCC PLC	16,000	53.40	854,400.00
SMITHS GROUP PLC	61,000	15.22	928,725.00
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	11,600	111.55	1,293,980.00
ASHTED GROUP PLC	73,500	34.33	2,523,255.00
BUNZLE	55,000	24.08	1,324,400.00
FERGUSON PLC	36,300	88.02	3,195,126.00
RENTOKIL INTIAL PLC	318,000	5.08	1,616,076.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	159,000	6.88	1,093,920.00
PERSIMMON PLC	52,600	28.75	1,512,250.00
TAYLOR WIMPEY PLC	620,000	1.67	1,035,400.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	19,500	47.16	919,620.00
BURBERRY GROUP PLC	66,000	17.60	1,161,600.00
COMPASS GROUP PLC	288,000	13.87	3,996,000.00
ENTAIN PLC	87,000	11.45	996,585.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	28,800	46.27	1,332,576.00
WHITBREAD PLC	31,650	32.14	1,017,231.00
OCADO GROUP PLC	78,000	22.50	1,755,000.00
NEXT PLC	21,900	69.28	1,517,232.00
JD SPORTS FASHION PLC	76,000	8.48	644,936.00
KINGFISHER PLC	349,000	2.65	926,246.00
MORRISON SUPERMARKETS	370,000	1.76	652,310.00

SAINSBURY	299,000	2.26	677,833.00
TESCO PLC	1,580,000	2.32	3,679,820.00
COCA-COLA HBC AG-DI	34,000	23.90	812,600.00
DIAGEO PLC	376,500	29.14	10,971,210.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	54,100	22.96	1,242,136.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	369,000	27.30	10,073,700.00
IMPERIAL BRANDS PLC	150,000	15.44	2,316,000.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	116,400	64.94	7,559,016.00
UNILEVER PLC	186,700	43.10	8,046,770.00
SMITH & NEPHEW PLC	139,000	15.25	2,120,445.00
NMC HEALTH PLC	13,300	0.24	3,192.00
ASTRAZENECA PLC	211,700	72.23	15,291,091.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	808,000	13.32	10,767,408.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	29,600	25.51	755,096.00
BARCLAYS PLC	2,800,000	1.54	4,328,800.00
HSBC HOLDINGS PLC	3,300,000	3.86	12,738,000.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	11,480,000	0.38	4,431,854.00
NATWEST GROUP PLC	770,000	1.68	1,300,915.00
STANDARD CHARTERED PLC	443,000	4.72	2,093,618.00
M&G PLC	440,000	2.04	899,360.00
ADMIRAL GROUP PLC	30,800	29.23	900,284.00
AVIVA PLC	670,000	3.28	2,197,600.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	219,000	3.12	683,937.00
LEGAL & GENERAL	950,000	2.66	2,530,800.00
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	89,000	7.17	638,664.00
PRUDENTIAL PLC	422,000	13.53	5,709,660.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	162,000	6.77	1,097,388.00
AVEVA GROUP PLC	19,911	31.85	634,165.35
SAGE GROUP PLC (THE)	175,000	5.84	1,022,350.00
HALMA PLC	65,000	23.98	1,558,700.00
BT GROUP PLC	1,530,000	1.38	2,116,755.00
VODAFONE GROUP PLC	4,330,000	1.23	5,336,292.00
SSE PLC	164,000	15.22	2,496,080.00
NATIONAL GRID PLC	568,000	8.57	4,868,896.00
SEVERN TRENT PLC	37,000	22.76	842,120.00

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	106,000	8.95	949,124.00	
	3I GROUP PLC	155,000	11.57	1,793,350.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	52,000	15.52	807,040.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	51,000	88.78	4,527,780.00	
	SCHRODERS PLC	19,700	34.40	677,680.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	81,000	11.50	931,500.00	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	366,000	2.89	1,060,302.00	
	EXPERIAN PLC	152,900	27.91	4,267,439.00	
	INTERTEK GROUP PLC	25,600	57.60	1,474,560.00	
	RELX PLC	313,000	17.92	5,610,525.00	
	INFORMA PLC	248,000	5.47	1,357,056.00	
	PEARSON	126,000	6.81	858,564.00	
	WPP PLC	200,000	8.13	1,626,000.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	171,000	5.83	997,956.00	
小計	銘柄数：86			251,530,790.35	
				(35,262,101,499)	
	組入時価比率：4.4%				4.6%
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	32,000	18.20	582,400.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,220	833.50	1,016,870.00	
	GIVAUDAN-REG	1,491	3,682.00	5,489,862.00	
	SIKA AG-REG	22,900	237.70	5,443,330.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	83,800	48.05	4,026,590.00	
	GEBERIT AG-REG	5,870	540.20	3,170,974.00	
	ABB LTD	299,000	24.39	7,292,610.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,000	236.20	708,600.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,700	236.70	1,585,890.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	8,400	199.55	1,676,220.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	85,300	79.06	6,743,818.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,700	238.00	1,118,600.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	46.00	340,400.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	2,060.00	947,600.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	177	8,485.00	1,501,845.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	16	87,900.00	1,406,400.00	
	NESTLE SA-REG	465,700	101.24	47,147,468.00	
	ALCON INC	78,800	57.38	4,521,544.00	
		8,858	225.80	2,000,136.40	

	SONOVA HOLDING AG-REG				
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,790	1,018.50	1,823,115.00	
	NOVARTIS AG-REG	358,600	78.57	28,175,202.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	114,100	301.50	34,401,150.00	
	VIFOR PHARMA AG	7,600	134.85	1,024,860.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	5,400	95.50	515,700.00	
	BALOISE HOLDING AG	7,400	156.00	1,154,400.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,760	403.70	1,921,612.00	
	SWISS RE LTD	45,700	82.28	3,760,196.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	24,650	367.10	9,049,015.00	
	TEMENOS AG-REG	10,400	121.50	1,263,600.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	27,000	84.02	2,268,540.00	
	SWISSCOM AG-REG	4,450	470.10	2,091,945.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	391,000	11.35	4,439,805.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	35,800	51.20	1,832,960.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,990	1,014.50	3,033,355.00	
	UBS GROUP AG	600,000	12.53	7,518,000.00	
	LONZA AG-REG	12,180	554.00	6,747,720.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	24,900	59.36	1,478,064.00	
	SGS SA-REG	980	2,643.00	2,590,140.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	13,500	85.45	1,153,575.00	
小計	銘柄数：39			212,964,111.40	
				(24,791,152,208)	
	組入時価比率：3.1%			3.2%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	28,800	219.80	6,330,240.00	
	BOLIDEN AB	44,000	288.20	12,680,800.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B	100,000	141.60	14,160,000.00	
	ASSA ABLOY AB-B	160,000	201.80	32,288,000.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	51,000	267.00	13,617,000.00	
	SKANSKA AB-B SHS	60,000	209.20	12,552,000.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	26,000	194.20	5,049,200.00	
	ALFA LAVAL AB	51,000	224.50	11,449,500.00	
	ATLAS COPCO AB-A	109,400	422.70	46,243,380.00	
	ATLAS COPCO AB-B	62,700	369.20	23,148,840.00	
	EPIROC AB - A	103,000	149.85	15,434,550.00	

	EPIROC AB - B	58,000	141.95	8,233,100.00	
	SANDVIK AB	183,000	200.90	36,764,700.00	
	SKF AB-B SHARES	67,000	213.30	14,291,100.00	
	VOLVO AB-B SHS	229,000	194.45	44,529,050.00	
	SECURITAS AB-B SHS	54,000	132.50	7,155,000.00	
	ELECTROLUX AB-B	34,000	192.70	6,551,800.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	73,000	105.90	7,730,700.00	
	EVOLUTION GAMING GROUP	25,100	792.00	19,879,200.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	130,000	172.50	22,425,000.00	
	ICA GRUPPEN AB	17,100	411.30	7,033,230.00	
	SWEDISH MATCH AB	26,000	637.20	16,567,200.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	103,000	261.80	26,965,400.00	
	NORDEA BANK ABP	519,000	67.27	34,913,130.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	267,000	85.02	22,700,340.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	267,000	83.22	22,219,740.00	
	SWEDBANK AB	148,000	144.00	21,312,000.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	15,000	273.00	4,095,000.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	263.70	6,592,500.00	
	INVESTOR AB-B SHS	73,400	584.00	42,865,600.00	
	KINNEVIK AB - B	39,000	409.40	15,966,600.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	12,600	433.60	5,463,360.00	
	ERICSSON LM-B	471,000	98.04	46,176,840.00	
	HEXAGON AB-B SHS	45,600	734.60	33,497,760.00	
	TELIA CO AB	381,000	34.02	12,961,620.00	
	TELE 2 AB-B SHS	78,000	108.05	8,427,900.00	
	EQT AB	35,000	196.10	6,863,500.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	15,100	424.00	6,402,400.00	
小計	銘柄数：38			701,537,280.00	
				(8,790,262,118)	
	組入時価比率：1.1%			1.1%	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	160,000	142.80	22,848,000.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,600	353.00	10,448,800.00	
	NORSK HYDRO	218,000	39.55	8,621,900.00	
	MOWI ASA	69,000	187.95	12,968,550.00	
	ORKLA ASA	115,000	85.28	9,807,200.00	

	DNB ASA	155,000	165.20	25,606,000.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,000	186.40	5,778,400.00	
	TELENOR ASA	116,000	144.40	16,750,400.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	18,100	318.00	5,755,800.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	10,600	363.20	3,849,920.00	
	ADEVINTA ASA	34,000	143.00	4,862,000.00	
小計	銘柄数：11			127,296,970.00	
				(1,527,563,640)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	18,200	622.40	11,327,680.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	33,700	348.90	11,757,930.00	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S-B SHS	1,120	2,266.00	2,537,920.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	32,100	1,391.00	44,651,100.00	
	DSV PANALPINA A S	33,400	1,015.50	33,917,700.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	560	12,750.00	7,140,000.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,040	13,750.00	14,300,000.00	
	PANDORA A/S	16,000	658.20	10,531,200.00	
	CARLSBERG B	16,800	952.80	16,007,040.00	
	AMBU A/S-B	29,000	253.20	7,342,800.00	
	COLOPLAST-B	19,400	918.40	17,816,960.00	
	DEMANT A/S	16,000	233.90	3,742,400.00	
	GN STORE NORD A/S	21,200	485.00	10,282,000.00	
	GENMAB A/S	10,400	2,384.00	24,793,600.00	
	H LUNDBECK A/S	10,500	212.80	2,234,400.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	277,700	426.00	118,300,200.00	
	DANSKE BANK AS	109,000	101.40	11,052,600.00	
	TRYG A/S	19,900	187.80	3,737,220.00	
	ORSTED A/S	30,400	1,189.50	36,160,800.00	
小計	銘柄数：19			387,633,550.00	
				(6,585,894,014)	
	組入時価比率：0.8%			0.9%	
豪ドル	AMPOL LTD	40,000	28.34	1,133,600.00	
	OIL SEARCH LTD	280,000	3.56	996,800.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	265,000	4.83	1,279,950.00	
	SANTOS LTD.	310,000	6.37	1,974,700.00	

WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	30.04	510,680.00	
WOODSIDE PETROLEUM	152,000	22.75	3,458,000.00	
ORICA LTD	59,000	15.55	917,450.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	73,000	38.48	2,809,040.00	
BHP GROUP LIMITED	475,000	42.95	20,401,250.00	
BLUESCOPE STEEL LTD	90,000	17.23	1,550,700.00	
EVOLUTION MINING LTD	272,000	5.03	1,368,160.00	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	272,000	23.62	6,424,640.00	
NEWCREST MINING	132,000	26.26	3,466,320.00	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	124,000	12.49	1,548,760.00	
RIO TINTO LTD	59,700	115.35	6,886,395.00	
SOUTH32 LTD	780,000	2.52	1,965,600.00	
CIMIC GROUP LTD	18,000	24.87	447,660.00	
BRAMBLES LTD	247,000	10.83	2,675,010.00	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	170,000	4.89	831,300.00	
AURIZON HOLDINGS LTD	305,000	3.94	1,201,700.00	
SYDNEY AIRPORT	200,621	6.44	1,291,999.24	
TRANSURBAN GROUP	440,000	14.08	6,195,200.00	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	91,000	31.86	2,899,260.00	
CROWN RESORTS LTD	55,000	9.72	534,600.00	
TABCORP HOLDINGS	370,909	4.01	1,487,345.09	
WESFARMERS LIMITED	183,000	51.10	9,351,300.00	
COLES GROUP LTD	210,000	18.47	3,878,700.00	
WOOLWORTHS GROUP LTD	204,000	39.87	8,133,480.00	
COCA-COLA AMATIL LTD	77,000	12.90	993,300.00	
TREASURY WINE ESTATES LTD	111,000	9.42	1,045,620.00	
COCHLEAR LTD	10,300	192.00	1,977,600.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	29,500	64.38	1,899,210.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	78,000	33.32	2,598,960.00	
CSL LIMITED	73,200	288.54	21,121,128.00	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	463,000	23.03	10,662,890.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	286,800	83.15	23,847,420.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	523,000	23.00	12,029,000.00	
WESTPAC BANKING CORP	591,000	19.55	11,554,050.00	
AMP LIMITED	530,000	1.59	845,350.00	

	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	361,000	4.82	1,740,020.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	450,000	2.99	1,345,500.00	
	QBE INSURANCE	244,000	8.86	2,161,840.00	
	SUNCORP GROUP LTD	222,000	9.92	2,202,240.00	
	AFTERPAY LTD	34,800	115.95	4,035,060.00	
	COMPUTERSHARE LTD	76,000	14.64	1,112,640.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,000	31.36	658,560.00	
	XERO LIMITED	19,800	146.36	2,897,928.00	
	TELSTRA CORP LTD	640,000	3.01	1,926,400.00	
	TPG TELECOM LTD	52,000	7.12	370,240.00	
	AUSNET SERVICES	330,000	1.79	590,700.00	
	APA GROUP	205,000	10.11	2,072,550.00	
	AGL ENERGY LTD	105,000	12.06	1,266,300.00	
	ASX LTD	30,700	73.53	2,257,371.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	56,800	140.11	7,958,248.00	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	19,200	54.23	1,041,216.00	
	REA GROUP LTD	8,800	149.42	1,314,896.00	
	SEEK LTD	60,000	28.54	1,712,400.00	
小計	銘柄数：57			220,858,236.33	
				(17,379,334,616)	
	組入時価比率：2.2%			2.3%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	223,000	7.68	1,712,640.00	
	A2 MILK CO LTD	117,000	12.06	1,411,020.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	93,000	34.00	3,162,000.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	74,000	15.24	1,127,760.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	307,000	4.79	1,472,065.00	
	MERCURY NZ LTD	100,000	6.44	644,000.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	201,000	7.20	1,447,200.00	
小計	銘柄数：7			10,976,685.00	
				(808,542,617)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	435,040	53.65	23,339,896.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	222,000	108.00	23,976,000.00	
	MTR CORP	243,000	43.60	10,594,800.00	

	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	280,000	20.90	5,852,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	356,000	58.55	20,843,800.00	
	SANDS CHINA LTD	384,000	33.65	12,921,600.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	8.62	2,327,400.00	
	WYNN MACAU LTD	228,000	13.16	3,000,480.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	290,000	25.20	7,308,000.00	
	WH GROUP LIMITED	1,610,000	6.36	10,239,600.00	
	BANK OF EAST ASIA	220,060	16.40	3,608,984.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	610,000	23.45	14,304,500.00	
	HANG SENG BANK	121,000	132.40	16,020,400.00	
	AIA GROUP LTD	1,957,000	90.90	177,891,300.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	48,000	98.90	4,747,200.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	599,600	10.12	6,067,952.00	
	PCCW LTD	750,000	4.69	3,517,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	107,000	39.90	4,269,300.00	
	CLP HLDGS	259,000	71.10	18,414,900.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	225,000	40.75	9,168,750.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,740,365	11.36	19,770,546.40	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	197,300	413.00	81,484,900.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	410,040	39.35	16,135,074.00	
	ESR CAYMAN LTD	260,000	27.10	7,046,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	360,000	19.80	7,128,000.00	
	HENDERSON LAND	229,443	29.80	6,837,401.40	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	268,916	36.20	9,734,759.20	
	SINO LAND CO.LTD	480,000	10.32	4,953,600.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	207,000	100.00	20,700,000.00	
	SWIRE PACIFIC-A	75,000	43.15	3,236,250.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	173,000	22.60	3,909,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	279,000	38.90	10,853,100.00	
小計	銘柄数：32			570,203,793.00	
				(7,617,922,674)	
	組入時価比率：1.0%			1.0%	
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	249,000	3.85	958,650.00	
	KEPPEL CORP.	232,000	5.43	1,259,760.00	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	240,000	4.26	1,022,400.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	850,000	0.85	722,500.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	340,000	4.60	1,564,000.00	
	DBS GROUP HLDGS	292,000	25.17	7,349,640.00	
	OCBC-ORD	531,000	10.06	5,341,860.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	190,000	22.71	4,314,900.00	
	VENTURE CORP LTD	45,000	19.45	875,250.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,280,000	2.32	2,969,600.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	129,000	9.22	1,189,380.00	
	CAPITALAND LIMITED	430,000	3.26	1,401,800.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	7.98	558,600.00	
	UOL GROUP LIMITED	87,000	7.72	671,640.00	
小計	銘柄数：14			30,199,980.00	
				(2,355,296,440)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
新シケル	ICL GROUP LTD	125,000	15.52	1,940,000.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	5,000	427.10	2,135,500.00	
	BANK HAPOALIM BM	183,000	22.08	4,040,640.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	238,000	18.93	4,505,340.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	172,000	12.31	2,117,320.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	23,000	74.55	1,714,650.00	
	NICE LTD	9,900	908.70	8,996,130.00	
	AZRIELI GROUP	6,500	198.80	1,292,200.00	
小計	銘柄数：8			26,741,780.00	
				(860,550,480)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計				768,837,633,633	
				(768,837,633,633)	

(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12月28日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	93,000	1,448,010.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,600	3,594,700.00	
		AMERICAN TOWER CORP	71,900	15,720,935.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	238,000	2,008,720.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	22,500	3,549,150.00	
		BOSTON PROPERTIES	25,000	2,348,250.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,000	1,579,200.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	70,200	10,810,800.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	43,300	5,950,719.00	
		DUKE REALTY CORP	62,200	2,444,460.00	
		EQUINIX INC	14,510	10,243,189.40	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	29,400	1,806,336.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	60,300	3,509,460.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,700	2,506,475.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	20,700	2,367,873.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	88,000	2,618,880.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	109,000	1,547,800.00	
		INVITATION HOMES INC	92,000	2,678,120.00	
		IRON MOUNTAIN INC	49,000	1,447,460.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	83,000	1,803,590.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,300	2,404,780.00	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,500	1,358,530.00	
		PROLOGIS INC	118,800	11,552,112.00	
		PUBLIC STORAGE	25,400	5,812,790.00	
		REALTY INCOME CORP	55,600	3,396,604.00	
		REGENCY CENTERS CORP	26,200	1,189,742.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	18,000	4,950,360.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	51,500	4,345,055.00	
		SUN COMMUNITIES INC	15,900	2,339,526.00	
		UDR INC	46,100	1,720,452.00	
		VENTAS INC	58,900	2,897,291.00	
		VEREIT INC	37,000	1,390,460.00	
VICI PROPERTIES INC	87,000	2,251,560.00			
VORNADO REALTY TRUST	27,000	976,050.00			
WELLTOWER INC	67,100	4,262,192.00			

小計	WEYERHAEUSER CO	121,000	4,095,850.00
	WP CAREY INC	27,400	1,928,960.00
	銘柄数：37	2,058,010	136,856,441.40 (14,181,064,457)
	組入時価比率：1.8%		82.3%
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	752,599.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	374,000.00
小計	銘柄数：2	36,900	1,126,599.00 (90,815,145)
	組入時価比率：0.0%		0.5%
ユーロ	COVIVIO	8,500	645,150.00
	GECINA SA	7,100	896,020.00
	KLEPIERRE	32,300	607,563.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21,400	1,404,268.00
小計	銘柄数：4	69,300	3,553,001.00 (448,886,146)
	組入時価比率：0.1%		2.6%
英ポンド	BRITISH LAND	128,000	645,120.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	111,000	768,342.00
	SEGRO PLC	193,000	1,833,114.00
小計	銘柄数：3	432,000	3,246,576.00 (455,137,489)
	組入時価比率：0.1%		2.6%
豪ドル	DEXUS	171,000	1,646,730.00
	GOODMAN GROUP	268,000	5,102,720.00
	GPT GROUP	330,000	1,518,000.00
	LENDLEASE GROUP	111,000	1,474,080.00
	MIRVAC GROUP	660,000	1,808,400.00
	SCENTRE GROUP	810,000	2,284,200.00
	STOCKLAND TRUST GROUP	400,000	1,760,000.00
	VICINITY CENTRES	670,000	1,115,550.00
小計	銘柄数：8	3,420,000	16,709,680.00 (1,314,884,719)
	組入時価比率：0.2%		7.7%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	3,600,200.00
	LINK REIT	331,000	22,805,900.00

小計	銘柄数：2	801,000	26,406,100.00 (352,785,496)	2.0%
	組入時価比率：0.0%			
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	539,240	1,585,365.60	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	706,779	1,505,439.27	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	773,300.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	427,980	851,680.20	
	SUNTEC REIT	300,000	453,000.00	
小計	銘柄数：5	2,343,999	5,168,785.07 (403,113,547)	2.3%
	組入時価比率：0.1%			
合計			17,246,686,999 (17,246,686,999)	

(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12月28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				
株指先物取引				
買建	9,778,115,960	-	9,896,451,384	118,335,424
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	223,400,600	-	223,398,000	2,600
米ドル	103,579,000	-	103,610,000	31,000
カナダドル	32,240,000	-	32,240,000	-
英ポンド	56,128,120	-	56,076,000	52,120
豪ドル	31,453,480	-	31,472,000	18,520
合計	-	-	-	118,338,024

(注)時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年12月28日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	906,319,256
コール・ローン	37,153,863
株式	49,875,286,101
投資信託受益証券	2,075,195,045
投資証券	41,719,672
派生商品評価勘定	4,211,660
未収入金	16,065,299
未収配当金	48,645,480
差入委託証拠金	631,100,665
流動資産合計	53,635,697,041
資産合計	
53,635,697,041	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,164,689
未払金	32,721,006
未払解約金	5,953,634
未払利息	18
その他未払費用	2,466,100
流動負債合計	42,305,447
負債合計	
42,305,447	
純資産の部	
元本等	
元本	36,764,031,794
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	16,829,359,800
元本等合計	53,593,391,594

(2020年12月28日現在)

純資産合計	53,593,391,594
負債純資産合計	53,635,697,041

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>投資信託受益証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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12月28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	1.4578円
(10,000口当たり純資産額)	(14,578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12月27日 至 2020年12月28日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年12月28日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p>

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。

投資信託受益証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年12月28日現在		2019年12月27日
期首		2019年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額		32,739,805,679円
同期中における追加設定元本額		9,208,370,436円
同期中における一部解約元本額		5,184,144,321円
期末元本額		36,764,031,794円
期末元本額の内訳*		
野村資産設計ファンド2015		22,937,624円
野村資産設計ファンド2020		23,202,727円
野村資産設計ファンド2025		42,559,344円
野村資産設計ファンド2030		55,723,378円
野村資産設計ファンド2035		44,721,860円
野村資産設計ファンド2040		86,730,909円
野村資産設計ファンド2045		13,211,099円
野村インデックスファンド・新興国株式		3,370,727,547円
ネクストコア		29,137,706円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		294,374,414円
野村資産設計ファンド2050		22,335,177円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		7,434,898円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		3,768,717円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		3,121,075円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		2,062,705円
インデックス・ブレンド(タイプ)		1,425,813円
インデックス・ブレンド(タイプ)		1,580,936円
インデックス・ブレンド(タイプ)		8,949,825円
インデックス・ブレンド(タイプ)		3,529,177円
インデックス・ブレンド(タイプ)		15,137,609円
野村つみたて外国株投信		2,397,357,134円
野村外国株(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)		716,089,001円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)		1,470,994,125円
世界6資産分散ファンド		109,398,219円
野村資産設計ファンド2060		9,246,218円

NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIEマージング・マーケット・インデックス(為替ヘッジなし)連動型上場投信	421,695,770円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	738,260,726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)	8,350,687円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国株式(適格機関投資家専用)	346,061,771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)	702,819円
野村新興国株式インデックスファンド(確定拠出年金向け)	25,926,717,293円
野村DC運用戦略ファンド	503,964,930円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	39,136,303円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	8,076,663円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	6,485,569円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	5,824,997円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	2,997,029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12月28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	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	12,600	12.98	163,548.00	
		LUKOIL PJSC-SPON ADR	26,110	68.90	1,798,979.00	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	5,600	162.10	907,760.00	
		PJSC GAZPROM-ADR	398,900	5.49	2,191,556.60	
		ROSNEFT OJSC - GDR	72,800	5.83	424,715.20	
		SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	105,600	4.62	487,872.00	
		TATNEFT-SPONSORED ADR	16,500	40.54	668,910.00	
		YPF S.A. -SPONSORED ADR	10,600	4.94	52,364.00	
		PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	7,010	13.48	94,494.80	
		QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	7,400	47.88	354,312.00	
		CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	9,600	12.26	117,696.00	
		NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	7,370	29.28	215,793.60	
		PJSC ALROSA	176,000	1.30	230,067.20	
		PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	41,700	31.33	1,306,461.00	
		POLYUS PJSC-REG S-GDR	4,710	102.30	481,833.00	
SEVERSTAL-GDR REG S	15,800	17.39	274,762.00			

SOUTHERN COPPER CORP	6,300	64.10	403,830.00
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	27,700	28.02	776,154.00
NIO INC ADR	84,600	45.77	3,872,142.00
XPENG INC ADR	11,090	41.87	464,338.30
HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR	11,200	44.40	497,280.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	27,080	57.71	1,562,786.80
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	125,180	222.00	27,789,960.00
BAOZUN INC-SPN ADR	4,900	32.01	156,849.00
JD.COM INC-ADR	57,600	84.49	4,866,624.00
PINDUODUO INC ADR	25,410	152.75	3,881,377.50
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	32,100	31.99	1,026,879.00
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	30,800	26.31	810,348.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	25,900	17.13	443,667.00
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	8,500	36.42	309,570.00
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	4,000	15.03	60,120.00
BEIGENE, LTD ADR	3,000	263.72	791,160.00
ZAI LAB LTD - ADR	4,860	133.78	650,170.80
HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD - ADR	3,890	29.49	114,716.10
BANCO DE CHILE-ADR	14,300	20.48	292,864.00
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	13,800	19.45	268,410.00
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	7,330	40.28	295,252.40
CREDICORP LTD	4,350	165.00	717,750.00
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	724,000	3.64	2,642,266.96
STATE BANK OF INDIA-GDR	11,070	36.35	402,394.50
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	87,890	0.98	86,264.03
GDS HOLDINGS LTD-ADR	5,610	91.30	512,193.00
GLOBANT SA	2,570	218.67	561,981.90
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	4,000	45.25	181,000.00
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	5,300	6.67	35,351.00
MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR	28,650	8.88	254,412.00
ENEL AMERICAS S.A-ADR	47,900	8.26	395,654.00
ENEL CHILE SA-ADR	42,900	3.94	169,026.00
INTER RAO UES PJSC	2,280,000	0.07	163,202.40
LUFAX HOLDING LTD	11,300	14.17	160,121.00
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	85,170	2.15	183,720.20

	NOAH HLDS LTD ADR	1,500	43.63	65,445.00	
	GSX TECHEDU INC- ADR	5,000	55.00	275,000.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	10,320	172.46	1,779,787.20	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	24,830	69.71	1,730,899.30	
	51JOB INC-ADR	2,210	68.05	150,390.50	
	KE HOLDINGS INC ADR	6,710	65.34	438,431.40	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	87,648	0.77	67,751.90	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	8,380	82.01	687,243.80	
	DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	6,000	11.26	67,560.00	
	HUYA INC-ADR	2,700	18.91	51,057.00	
	IQIYI INC-ADR	14,300	17.44	249,392.00	
	NETEASE INC-ADR	27,880	92.66	2,583,360.80	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	23,500	18.91	444,385.00	
	AUTOHOME INC-ADR	3,860	95.12	367,163.20	
	BAIDU INC - SPON ADR	18,280	191.02	3,491,845.60	
	JOYY INC	4,250	77.35	328,737.50	
	MAIL.RU GROUP-GDR REGS	7,000	26.50	185,500.00	
	MOMO INC-SPON ADR	8,800	13.22	116,336.00	
	SINA CORP	4,150	42.45	176,167.50	
	WEIBO CORP-SPON ADR	3,400	44.31	150,654.00	
	YANDEX NV-A	19,770	67.65	1,337,440.50	
	小計銘柄数：72			80,315,508.49	
				(8,322,292,989)	
	組入時価比率：15.5%			16.7%	
メキシコペソ	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	60,458	45.42	2,746,002.36	
	CEMEX SAB - CPO	1,079,985	10.25	11,069,846.25	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	216,983	82.26	17,849,021.58	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	342.86	2,883,452.60	
	ALFA S.A.B. -A	172,100	14.09	2,424,889.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	60.28	2,103,772.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	14,300	319.72	4,571,996.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	20,400	218.04	4,448,016.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	12,900	169.75	2,189,775.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	341,000	55.77	19,017,570.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	26,100	95.90	2,502,990.00	

	BECLE SAB DE CV	47,000	50.04	2,351,880.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	32,495	89.91	2,921,625.45	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	129,400	147.67	19,108,498.00	
	GRUMA S.A.B.-B	13,400	232.70	3,118,180.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	101,000	42.59	4,301,590.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	95,000	32.95	3,130,250.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	167,300	108.28	18,115,244.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	140,200	20.23	2,836,246.00	
	TELESITES SAB DE CV	111,000	21.28	2,362,080.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,309,000	14.21	32,810,890.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	38,700	77.80	3,010,860.00	
	GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	153,400	31.50	4,832,100.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	23,100	72.70	1,679,370.00	
小計	銘柄数：24			172,386,144.24	
				(898,131,811)	
	組入時価比率：1.7%			1.8%	
リアル	COSAN SA	9,100	74.11	674,401.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	254,000	28.44	7,223,760.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	310,700	27.95	8,684,065.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	48,000	23.70	1,137,600.00	
	KLABIN SA-UNIT	42,700	25.27	1,079,029.00	
	BRADESPAR SA -PREF	15,000	64.71	970,650.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	30.86	1,425,732.00	
	GERDAU SA PFD NPV	74,500	24.24	1,805,880.00	
	VALE SA	246,921	87.36	21,571,018.56	
	SUZANO SA	52,960	56.37	2,985,355.20	
	WEG SA	58,724	72.62	4,264,536.88	
	LOCALIZA RENT A CAR	37,760	66.60	2,514,816.00	
	RUMO SA	96,000	19.20	1,843,200.00	
	CCR SA	75,600	13.44	1,016,064.00	
	ALPARGATAS SA-PREF	12,000	41.13	493,560.00	
	B2W CIA DIGITAL	13,500	75.60	1,020,600.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	48,992	25.16	1,232,638.72	
	LOJAS RENNER S.A.	49,595	43.72	2,168,293.40	
	MAGAZINE LUIZA SA	203,000	24.97	5,068,910.00	

PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	43,600	22.10	963,560.00	
VIA VAREJO SA	92,000	16.13	1,483,960.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	29,600	19.22	568,912.00	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICIAO	11,103	72.71	807,299.13	
RAIA DROGASIL SA	78,200	24.95	1,951,090.00	
AMBEV SA	308,956	15.50	4,788,818.00	
BRF SA	39,700	22.39	888,883.00	
JBS SA	74,600	23.78	1,773,988.00	
NATURA &CO HOLDING SA	62,500	51.69	3,230,625.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	69,500	15.03	1,044,585.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	37,300	77.30	2,883,290.00	
HYPERA SA	23,900	33.65	804,235.00	
BANCO BRADESCO S.A.	75,954	24.85	1,887,456.90	
BANCO BRADESCO SA - PREF	290,036	27.72	8,039,797.92	
BANCO DO BRASIL SA	53,600	38.92	2,086,112.00	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	45.23	1,103,612.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	314,691	31.94	10,051,230.54	
ITAUSA SA	284,017	11.67	3,314,478.39	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	44,100	29.13	1,284,633.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	18,490	43.27	800,062.30	
TOTVS SA	40,000	27.81	1,112,400.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	26,805	45.49	1,219,359.45	
TIM SA	46,552	14.51	675,469.52	
CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	18,000	36.13	650,340.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	16,500	36.04	594,660.00	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	62,498	14.18	886,221.64	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	8,600	74.51	640,786.00	
CPFL ENERGIA SA	19,300	31.86	614,898.00	
ENERGISA SA-UNITS	10,200	49.90	508,980.00	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	70,000	22.67	1,586,900.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	21,300	45.14	961,482.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	133,833	59.99	8,028,641.67	
BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT	16,100	92.79	1,493,919.00	
ENGIE BRASIL SA	12,000	43.66	523,920.00	

	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	17,600	23.74	417,824.00	
小計	銘柄数：54			136,852,539.22	
	組入時価比率：5.1%			(2,717,891,428)	
				5.4%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	25,900	7,070.00	183,113,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	71,951	1,825.00	131,310,575.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	50,200	2,550.00	128,010,000.00	
	CENCOSUD SA	80,738	1,246.00	100,599,548.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	28,800	1,784.00	51,379,200.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	3,241	27,699.00	89,772,459.00	
	COLBUN SA	471,000	123.10	57,980,100.00	
	CENCOSUD SHOPPING SA	23,000	1,164.60	26,785,800.00	
小計	銘柄数：8			768,950,682.00	
	組入時価比率：0.2%			(111,420,953)	
				0.2%	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	15,900	34,650.00	550,935,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	13,000	24,690.00	320,970,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,800	25,000.00	845,000,000.00	
小計	銘柄数：3			1,716,905,000.00	
	組入時価比率：0.1%			(50,648,697)	
				0.1%	
ユーロ	FF GROUP	2,030	0.48	974.40	
	OPAP SA	13,190	10.50	138,495.00	
	JUMBO SA	6,732	14.00	94,248.00	
	HELLENIC TELECOM	18,000	12.93	232,740.00	
小計	銘柄数：4			466,457.40	
	組入時価比率：0.1%			(58,932,227)	
				0.1%	
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	15,000	16.83	252,525.00	
	小計	銘柄数：1			252,525.00
	組入時価比率：0.1%			(35,401,479)	
				0.1%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,300	106.00	879,800.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,000	14.20	1,647,200.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	41,460	18.00	746,280.00	
	KOC HLDGS	53,000	19.90	1,054,700.00	

	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	88,000	7.19	632,720.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	32,186	12.74	410,049.64	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	3,320	122.90	408,028.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	30,000	73.20	2,196,000.00	
	AKBANK T.A.S	205,000	6.51	1,334,550.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	142,160	9.85	1,400,276.00	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	91,800	6.75	619,650.00	
	YAPI VE KREDI BANKASI A.S.	190,000	3.02	573,800.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	40,000	10.53	421,200.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	77,000	16.03	1,234,310.00	
小計	銘柄数：14			13,558,563.64	
				(185,345,564)	
	組入時価比率：0.3%			0.4%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	635.00	3,206,750.00	
	MONETA MONEY BANK AS	42,000	68.00	2,856,000.00	
	CEZ AS	8,500	501.00	4,258,500.00	
小計	銘柄数：3			10,321,250.00	
				(49,748,425)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
フォロント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	25,000	2,140.00	53,500,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	9,200	7,285.00	67,022,000.00	
	OTP BANK NYRT	14,400	13,140.00	189,216,000.00	
小計	銘柄数：3			309,738,000.00	
				(107,788,824)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	18,800	57.42	1,079,496.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	97,770	5.41	528,935.70	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	9,900	185.25	1,833,975.00	
	LPP SA	94	7,690.00	722,860.00	
	ALLEGRO.EU SA	18,300	85.69	1,568,127.00	
	DINO POLSKA SA	3,820	279.80	1,068,836.00	
	BANK PEKAO SA	10,520	61.08	642,561.60	
	PKO BANK POLSKI SA	56,200	28.73	1,614,626.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,550	183.60	284,580.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	37,500	31.71	1,189,125.00	
	ORANGE POLSKA SA	39,150	6.53	255,649.50	

	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	51,730	6.20	320,726.00	
	CYFROWY POLSAT SA	18,900	28.98	547,722.00	
	CD PROJEKT RED SA	4,960	269.00	1,334,240.00	
小計	銘柄数：14			12,991,459.80	
				(363,501,045)	
	組入時価比率：0.7%			0.7%	
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY	367,000	0.05	19,451.00	
	LEGEND HLDS CORP-RTS	18,100	0.00	0.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	100,000	6.34	634,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,470,900	3.40	5,001,060.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	231,000	14.80	3,418,800.00	
	CNOOC LTD	1,169,000	7.34	8,580,460.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,400,000	2.38	3,332,000.00	
	YANZHOU COAL MINING-H	96,000	6.30	604,800.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	77,000	47.55	3,661,350.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	235,000	8.97	2,107,950.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	152,000	8.64	1,313,280.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	2.71	569,100.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	104,000	7.05	733,200.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	180,000	4.18	752,400.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	12.02	1,177,960.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LTD	36,000	17.50	630,000.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H	57,000	9.02	514,140.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO-H	347,000	8.23	2,855,810.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	78,000	6.16	480,480.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	11.10	1,121,100.00	
	AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	202,000	5.22	1,054,440.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	92,000	11.46	1,054,320.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	299,000	3.46	1,034,540.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	3.44	599,936.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	113,500	36.85	4,182,475.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	230,000	3.40	782,000.00	
	CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	135,000	4.39	592,650.00	

CHINA STATE CONSTRUCTION INT	153,250	4.55	697,287.50	
HEBEI CONSTRUCTION GROUP COR	30,000	4.54	136,200.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	39,984	15.00	599,760.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	36,300	29.05	1,054,515.00	
CITIC LTD	362,000	5.35	1,936,700.00	
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	165,940	11.58	1,921,585.20	
CRRC CORP LTD-H	275,350	2.80	770,980.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	32,000	25.00	800,000.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	37,500	18.38	689,250.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	117,800	15.16	1,785,848.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H	61,000	8.90	542,900.00	
BOC AVIATION LTD	11,300	64.20	725,460.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	33,000	34.00	1,122,000.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	281,000	4.29	1,205,490.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	88,000	52.40	4,611,200.00	
GREENTOWN SER	60,000	9.30	558,000.00	
AIR CHINA LIMITED-H	102,000	5.97	608,940.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	4.65	492,900.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	140,000	8.25	1,155,000.00	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	98,000	6.18	605,640.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	82,000	9.26	759,320.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	5.23	533,460.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	8.57	582,760.00	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	79,000	12.34	974,860.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	6.25	712,500.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	39,200	39.25	1,538,600.00	
MINH GROUP LTD	48,000	38.25	1,836,000.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	218,000	6.37	1,388,660.00	
BYD CO LTD-H	41,000	193.50	7,933,500.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	184,000	8.33	1,532,720.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	390,000	23.35	9,106,500.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	179,000	22.20	3,973,800.00	

GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	199,890	7.99	1,597,121.10	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	68,000	14.80	1,006,400.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	139,200	25.80	3,591,360.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	70,000	115.70	8,099,000.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	204,000	3.52	718,080.00	
LI NING CO LTD	136,000	50.00	6,800,000.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	56,000	149.70	8,383,200.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD.	51,000	60.00	3,060,000.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	14,400	164.50	2,368,800.00	
MEITUAN-CLASS B	238,800	279.20	66,672,960.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	54,800	14.68	804,464.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LIMITED	36,000	29.25	1,053,000.00	
GOME RETAIL HODINGS LTD	523,360	0.91	476,257.60	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	77,000	11.06	851,620.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	43,000	53.10	2,283,300.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	149,000	7.66	1,141,340.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	7,000	103.90	727,300.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	93,333	69.35	6,472,643.55	
TSING TAO BREWERY CO-H	30,000	77.10	2,313,000.00	
CHINA FEIHE LTD	94,000	17.80	1,673,200.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.00	0.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	180,000	44.80	8,064,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	4.42	492,830.00	
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	118,000	12.84	1,515,120.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	70,000	7.64	534,800.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	308,000	5.50	1,694,000.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	31,000	112.10	3,475,100.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	30,000	58.80	1,764,000.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	23,000	21.25	488,750.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	44,500	53.90	2,398,550.00	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	24,000	12.60	302,400.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	47,000	41.00	1,927,000.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	160,000	16.40	2,624,000.00	

JINXIN FERTILITY GROUP LTD	86,000	14.86	1,277,960.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	12.62	642,358.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	87,200	18.28	1,594,016.00	
3SBIO, INC	77,000	7.28	560,560.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	58,500	72.95	4,267,575.00	
CANSINO BIOLOGICS INC	3,800	173.00	657,400.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	81,000	8.58	694,980.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	3.95	367,350.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	124,000	3.39	420,360.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	587,520	7.60	4,465,152.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	76,000	36.50	2,774,000.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	62,500	3.63	226,875.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	34,500	39.10	1,348,950.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	712,500	7.46	5,315,250.00	
SSY GROUP LTD	82,000	4.32	354,240.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,910,000	2.75	5,252,500.00	
BANK OF CHINA LTD-H	5,380,000	2.59	13,934,200.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	597,790	4.06	2,427,027.40	
CHINA BOHAI BANK CO LTD	160,000	4.86	777,600.00	
CHINA CITIC BANK-H	560,000	3.22	1,803,200.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	6,408,000	5.68	36,397,440.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	257,000	2.86	735,020.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	254,692	47.65	12,136,073.80	
CHINA MINSHENG BANKING-H	374,800	4.23	1,585,404.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	137,000	3.06	419,220.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,084,000	4.54	18,541,360.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	640,000	4.30	2,752,000.00	
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	8.00	1,232,000.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	486,000	16.70	8,116,200.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	172,200	29.10	5,011,020.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	13.82	1,429,983.04	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	59,100	29.60	1,749,360.00	
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	587,000	2.40	1,408,800.00	

PICC PROPERTY & CASUALTY -H	434,420	5.77	2,506,603.40	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	393,000	91.85	36,097,050.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	25,000	35.60	890,000.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	66,000	18.52	1,222,320.00	
CHINA YOUZAN LIMITED	888,000	2.23	1,980,240.00	
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	174,000	27.75	4,828,500.00	
KINGSOFT CORP LTD	54,000	42.70	2,305,800.00	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	51,500	38.55	1,985,325.00	
ZTE CORP-H	47,252	18.30	864,711.60	
LENOVO GROUP LTD	498,000	6.83	3,401,340.00	
XIAOMI CORPORATION	944,000	32.45	30,632,800.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	45,000	43.90	1,975,500.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	43,000	30.10	1,294,300.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	58,500	11.54	675,090.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	47,700	162.40	7,746,480.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	26,000	45.45	1,181,700.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	249,000	19.04	4,740,960.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	262,000	19.38	5,077,560.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	866,000	2.20	1,905,200.00	
CHINA TOWER CORP LTD	2,790,000	1.16	3,236,400.00	
CHINA UNICOM HONGKONG LTD	378,000	4.45	1,682,100.00	
CHINA MOBILE LTD	388,500	44.50	17,288,250.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	24.60	885,600.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	184,000	29.75	5,474,000.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	56,000	41.30	2,312,800.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	49,600	110.80	5,495,680.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	316,000	6.92	2,186,720.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	405,000	3.09	1,251,450.00	
GUANGDONG INVESTMENT	184,000	13.94	2,564,960.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	1.42	880,400.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	48,000	10.10	484,800.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	4.48	1,191,680.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT	592,000	0.81	479,520.00	

CO LTD				
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H	92,400	18.30	1,690,920.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	162,000	16.70	2,705,400.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	10.20	842,520.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	173,600	6.64	1,152,704.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	102,000	11.74	1,197,480.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	46,000	16.72	769,120.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS	65,000	15.12	982,800.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CO.LTD	76,000	6.73	511,480.00	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	15,000	26.10	391,500.00	
CGN POWER CO LTD-H	627,000	1.70	1,065,900.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	218,000	7.08	1,543,440.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	240,000	1.58	379,200.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	150,000	7.93	1,189,500.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	238,000	2.70	642,600.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	266,000	23.65	6,290,900.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	36,600	89.35	3,270,210.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	56,000	11.36	636,160.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	8,000	175.00	1,400,000.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD	8,000	123.10	984,800.00	
WUXI APPTTEC CO LTD	20,084	141.70	2,845,902.80	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	196,500	91.45	17,969,925.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	94,000	10.02	941,880.00	
CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD	98,000	7.31	716,380.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	126,000	14.56	1,834,560.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	330,000	3.56	1,174,800.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	244,000	17.30	4,221,200.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	85,000	4.29	364,650.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	208,444	31.25	6,513,875.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	98,000	25.55	2,503,900.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	196,000	6.13	1,201,480.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	494,380	10.04	4,963,575.20	

	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	56,000	11.20	627,200.00	
	GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	143,200	9.69	1,387,608.00	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	42,000	18.98	797,160.00	
	KAISA GROUP HLDS LTD	115,000	3.74	430,100.00	
	KWG GROUP HOLDINGS LTD	68,500	10.12	693,220.00	
	LOGAN GROUP CO LTD	74,000	11.88	879,120.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	116,500	44.70	5,207,550.00	
	POLY PROPERTY SERVICES CO LTD	7,400	61.75	456,950.00	
	SEAZEN GROUP LTD	168,000	6.59	1,107,120.00	
	SHENZHEN INVESTMENT LTD	176,000	2.57	452,320.00	
	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	72,000	24.00	1,728,000.00	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	165,000	27.40	4,521,000.00	
	WHARF(HOLDING)	94,000	20.45	1,922,300.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	370,000	1.51	558,700.00	
	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	67,000	4.54	304,180.00	
	CHINA LITERATURE LTD	20,800	58.95	1,226,160.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	870,000	0.94	817,800.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	379,500	556.00	211,002,000.00	
小計	銘柄数：207			849,492,158.19	
				(11,349,215,233)	
	組入時価比率：21.2%			22.8%	
リング	DIALOG GROUP BHD	313,044	3.42	1,070,610.48	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	14,500	21.22	307,690.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	144,000	7.50	1,080,000.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	81,100	8.00	648,800.00	
	GAMUDA BERHAD	100,200	3.77	377,754.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	8.49	286,962.00	
	SIME DARBY BERHAD	220,000	2.23	490,600.00	
	MISC BHD	99,960	6.50	649,740.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	56,460	5.50	310,530.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	51,400	4.40	226,160.00	
	GENTING BHD	112,000	4.46	499,520.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	229,000	2.66	609,140.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	7,700	32.48	250,096.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,600	9.97	145,562.00	

	IOI CORP	162,000	4.44	719,280.00
	KUALA LUMPUR KEPONG	26,400	24.20	638,880.00
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	4,400	139.20	612,480.00
	PPB GROUP BERHAD	51,740	18.90	977,886.00
	QL RESOURCES BHD	60,000	6.12	367,200.00
	SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	5.18	747,474.00
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,000	12.58	1,471,860.00
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES BERHAD	80,000	4.97	397,600.00
	SUPERMAX CORP BHD	111,831	6.81	761,569.11
	TOP GLOVE CORP BHD	332,000	6.49	2,154,680.00
	IHH HEALTHCARE BHD	156,000	5.66	882,960.00
	AMMB HOLDING	125,000	3.63	453,750.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	416,000	4.19	1,743,040.00
	HONG LEONG BANK	37,460	18.48	692,260.80
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	17.60	236,227.20
	MALAYAN BANKING	246,000	8.44	2,076,240.00
	PUBLIC BANK BHD	193,260	20.56	3,973,425.60
	RHB BANK BHD	125,023	5.50	687,626.50
	TELEKOM MALAYSIA	62,000	5.34	331,080.00
	AXIATA GROUP BERHAD	195,000	3.75	731,250.00
	DIGI.COM BERHAD	186,000	4.20	781,200.00
	MAXIS BHD	146,200	5.05	738,310.00
	TENAGA NASIONAL	147,000	10.70	1,572,900.00
	PETRONAS GAS BERHAD	63,000	17.32	1,091,160.00
	小計銘柄数：38			31,793,503.69 (812,006,084)
	組入時価比率：1.5%			1.6%
パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	86,400	96.50	8,337,600.00
	PTT PCL-NVDR	753,000	42.00	31,626,000.00
	THAI OIL PCL-NVDR	83,000	54.00	4,482,000.00
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	110,967	40.00	4,438,680.00
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	151,994	59.75	9,081,641.50
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	50,600	380.00	19,228,000.00
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	476,000	9.60	4,569,600.00
	AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	294,000	62.50	18,375,000.00
	BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	447,100	8.50	3,800,350.00

ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	290,000	4.78	1,386,200.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	182,878	26.00	4,754,828.00	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	155,025	33.00	5,115,825.00	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	354,597	13.70	4,857,978.90	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	34.75	2,561,075.00	
CP ALL PCL-NVDR	375,000	59.00	22,125,000.00	
OSOTSPA PCL-NVDR	33,000	35.75	1,179,750.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	279,000	27.00	7,533,000.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	199,800	13.50	2,697,300.00	
SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	28,000	72.00	2,016,000.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	655,000	20.70	13,558,500.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,200	126.00	4,057,200.00	
BANGKOK BANK(F)	48,000	122.00	5,856,000.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	37,300	116.00	4,326,800.00	
KASIKORNBANK PCL(F)	72,000	115.00	8,280,000.00	
KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	11.30	3,017,665.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	50,800	87.50	4,445,000.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	20,100	684.00	13,748,400.00	
TRUE CORP PCL-NVDR	920,000	3.42	3,146,400.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	85,700	179.00	15,340,300.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR	140,000	56.00	7,840,000.00	
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	43,000	33.75	1,451,250.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	35,000	60.00	2,100,000.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	59.50	2,915,500.00	
SRI SAWAD CORP PCL-NVDR	63,000	67.75	4,268,250.00	
BANGKOK COMMERCIAL ASSET-NVDR	154,000	22.20	3,418,800.00	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	34,000	49.50	1,683,000.00	
ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	17,300	194.00	3,356,200.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	95,000	45.00	4,275,000.00	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	59,000	67.75	3,997,250.00	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	181,500	34.50	6,261,750.00	
RATCH GROUP PCL-NVDR	43,000	53.50	2,300,500.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	133,900	50.75	6,795,425.00	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	620,000	8.15	5,053,000.00	
小計銘柄数：43			289,658,018.40	

				(996,423,583)	
	組入時価比率：1.9%			2.0%	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	46.75	6,825,500.00	
	AYALA CORPORATION	21,102	833.00	17,577,966.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,465	597.00	3,262,605.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	182,385	71.20	12,985,812.00	
	SM INVESTMENTS CORP	17,100	1,077.00	18,416,700.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	69,000	123.80	8,542,200.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	24,400	197.50	4,819,000.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	65,000	40.90	2,658,500.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	67,000	151.70	10,163,900.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	145,999	82.40	12,030,317.60	
	BDO UNIBANK INC	124,998	106.80	13,349,786.40	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	127,695	50.80	6,486,906.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	4.18	3,125,804.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,070	2,010.00	4,160,700.00	
	PLDT INC	4,970	1,350.00	6,709,500.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	282.60	4,775,940.00	
	ABOITIZ POWER CORP	76,700	26.75	2,051,725.00	
	AYALA LAND LTD	499,000	41.75	20,833,250.00	
MEGAWORLD CORP	910,000	4.00	3,640,000.00		
SM PRIME HLDGS	652,975	38.55	25,172,186.25		
小計	銘柄数：20			187,588,298.25	
				(405,190,724)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
ルピア	ADARO ENERGY PT	839,200	1,490.00	1,250,408,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	99,150	26,075.00	2,585,336,250.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,660,000	1,225.00	2,033,500,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	127,000	14,025.00	1,781,175,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	176,000	12,350.00	2,173,600,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	635,000	2,540.00	1,612,900,000.00	
	INDAH KIAT PULP&PAPER	148,600	10,600.00	1,575,160,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,335,000	6,000.00	8,010,000,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	300,000	1,780.00	534,000,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	178,000	9,525.00	1,695,450,000.00	

	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	266,200	6,800.00	1,810,160,000.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	499,000	6,600.00	3,293,400,000.00	
	GUDANG GARAM TBK	29,200	41,075.00	1,199,390,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	523,500	7,425.00	3,886,987,500.00	
	KALBE FARMA PT	1,540,000	1,465.00	2,256,100,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	642,000	33,625.00	21,587,250,000.00	
	BANK MANDIRI	1,330,000	6,350.00	8,445,500,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	499,000	6,250.00	3,118,750,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,810,000	4,160.00	15,849,600,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,479,000	965.00	1,427,235,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,330,000	3,320.00	11,055,600,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	593,500	1,650.00	979,275,000.00	
小計	銘柄数：22			98,160,776,750.00	
				(716,573,670)	
	組入時価比率：1.3%			1.4%	
ウォン	GS HOLDINGS CORP	3,600	37,500.00	135,000,000.00	
	S-OIL CORPORATION	2,690	69,000.00	185,610,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,580	180,500.00	646,190,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	6,330	45,650.00	288,964,500.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	998	138,500.00	138,223,000.00	
	LG CHEM LTD - PREFERRED	384	378,500.00	145,344,000.00	
	LG CHEMICALS LTD	3,000	818,000.00	2,454,000,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,050	265,000.00	278,250,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	600	376,500.00	225,900,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,810	104,500.00	189,145,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD RTS	431	33,000.00	14,223,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	4,779	38,300.00	183,035,700.00	
	KOREA ZINC CO LTD	592	413,000.00	244,496,000.00	
	POSCO	5,070	271,000.00	1,373,970,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	4,520	25,250.00	114,130,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,220	35,850.00	151,287,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	4,650	36,650.00	170,422,500.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,520	13,100.00	111,612,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	16,000	13,350.00	213,600,000.00	
	CJ CORP	1,100	88,400.00	97,240,000.00	

HANWHA CORPORATION	2,470	27,950.00	69,036,500.00
LG CORP	6,050	85,000.00	514,250,000.00
LOTTE CORP	1,620	34,700.00	56,214,000.00
SAMSUNG C&T CORP	5,700	139,000.00	792,300,000.00
SK HOLDINGS CO LTD	2,340	242,000.00	566,280,000.00
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,900	26,650.00	77,285,000.00
DOOSAN BOBCAT INC	3,350	30,000.00	100,500,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	597	313,500.00	187,159,500.00
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	2,377	108,000.00	256,716,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	30,700	6,930.00	212,751,000.00
S-1 CORPORATION	1,450	85,700.00	124,265,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,140	182,000.00	207,480,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	4,280	26,900.00	115,132,000.00
PAN OCEAN CO LTD	14,890	4,720.00	70,280,800.00
CJ LOGISTICS	780	163,500.00	127,530,000.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	5,320	39,650.00	210,938,000.00
HANON SYSTEMS	11,650	15,900.00	185,235,000.00
HYUNDAI MOBIS	4,520	251,000.00	1,134,520,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD	10,130	187,000.00	1,894,310,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,640	91,600.00	241,824,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	89,300.00	131,271,000.00
KIA MOTORS CORP	18,170	61,700.00	1,121,089,000.00
COWAY CO LTD	3,340	72,400.00	241,816,000.00
LG ELECTRONICS INC	7,410	112,000.00	829,920,000.00
HLB INC	2,431	89,100.00	216,602,100.00
FILA HOLDINGS CORP	2,930	44,400.00	130,092,000.00
KANGWON LAND INC	7,900	23,100.00	182,490,000.00
CJ ENM CO LTD	657	137,600.00	90,403,200.00
LOTTE SHOPPING CO	800	100,000.00	80,000,000.00
SHINSEGAE CO LTD	427	236,000.00	100,772,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	1,960	80,900.00	158,564,000.00
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	138,500.00	67,172,500.00
E-MART CO	1,181	151,000.00	178,331,000.00
GS RETAIL CO LTD	1,140	34,450.00	39,273,000.00

CJ CHEILJEDANG CORP	510	382,500.00	195,075,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,800	125,000.00	225,000,000.00
OTTOGI CORPORATION	70	578,000.00	40,460,000.00
KT & G CORP	7,280	88,400.00	643,552,000.00
AMOREPACIFIC CORP	1,930	202,500.00	390,825,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	53,800.00	81,776,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	573	1,625,000.00	931,125,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	700,000.00	72,800,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	4,720	168,000.00	792,960,000.00
ALTEOGEN INC	1,420	156,600.00	222,372,000.00
CELLTRION INC	6,120	347,500.00	2,126,700,000.00
SEEGENE, INC.	1,360	187,700.00	255,272,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,030	240,000.00	247,200,000.00
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	481	332,000.00	159,692,000.00
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,330	119,000.00	277,270,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,000	171,000.00	171,000,000.00
YUHAN CORPORATION	3,620	73,500.00	266,070,000.00
HANA FINANCIAL HOLDINGS	20,100	35,800.00	719,580,000.00
INDUSTRIAL BK OF KOREA	15,040	9,450.00	142,128,000.00
KB FINANCIAL GROUP INC	25,550	45,450.00	1,161,247,500.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP	28,600	33,300.00	952,380,000.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	30,200	10,150.00	306,530,000.00
DB INSURANCE CO LTD	2,850	45,000.00	128,250,000.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,400	23,450.00	79,730,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	1,890	195,500.00	369,495,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,640	82,100.00	380,944,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	2,570	179,500.00	461,315,000.00
DUZONBIZON CO., LTD.	1,240	104,000.00	128,960,000.00
KMW CO.LTD.	1,140	77,400.00	88,236,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS	315,890	77,800.00	24,576,242,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	55,030	72,800.00	4,006,184,000.00
LG INNOTEK CO LTD	860	174,000.00	149,640,000.00
LG.DISPLAY CO LTD	16,200	17,850.00	289,170,000.00
SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	3,490	167,500.00	584,575,000.00
SAMSUNG SDI CO,LTD	3,600	563,000.00	2,026,800,000.00

	SK HYNIX INC	36,470	118,000.00	4,303,460,000.00	
	LG UPLUS CORP	13,300	12,100.00	160,930,000.00	
	SK TELECOM CO LTD	2,700	247,000.00	666,900,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER	14,300	27,000.00	386,100,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,599	30,300.00	48,449,700.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,360	35,250.00	47,940,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,140	80,000.00	251,200,000.00	
	MERITZ SECURITIES	24,500	3,885.00	95,182,500.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	24,737	9,630.00	238,217,310.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	11,800.00	91,214,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES	3,565	42,950.00	153,116,750.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,024	794,000.00	813,056,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,900	21,250.00	125,375,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,128	897,000.00	1,011,816,000.00	
	NETMARBLE CORP	1,470	125,000.00	183,750,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	310	268,500.00	83,235,000.00	
	KAKAO CORP	3,910	374,000.00	1,462,340,000.00	
	NAVER CORP	8,300	282,000.00	2,340,600,000.00	
小計	銘柄数：107			74,185,883,060.00	
				(6,995,728,772)	
	組入時価比率：13.1%			14.0%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	88,360	94.20	8,323,512.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	247,998	79.60	19,740,640.80	
	FORMOSA PLASTIC	246,424	92.80	22,868,147.20	
	NAN YA PLASTICS CORP	342,726	69.40	23,785,184.40	
	ASIA CEMENT	126,980	42.70	5,422,046.00	
	TAIWAN CEMENT	334,294	42.80	14,307,783.20	
	CHINA STEEL	754,544	24.20	18,259,964.80	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	234,454	28.55	6,693,661.70	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	8,000	874.00	6,992,000.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	14,050	371.00	5,212,550.00	
	EVERGREEN MARINE	202,375	33.45	6,769,443.75	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	143,000	30.90	4,418,700.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	142,036	43.55	6,185,667.80	

NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	320.00	3,200,000.00
GIANT MANUFACTURING	18,752	260.00	4,875,520.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,443	395.50	4,525,706.50
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	26,815	195.00	5,228,925.00
POU CHEN CORP	135,468	30.75	4,165,641.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	20,000	622.00	12,440,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	37,816	263.00	9,945,608.00
STANDARD FOODS CORP	27,079	60.70	1,643,695.30
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	320,836	66.30	21,271,426.80
ONENESS BIOTECH CO LTD	13,000	231.00	3,003,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	355,459	17.35	6,167,213.65
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,131,212	19.30	21,832,391.60
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	710,897	25.00	17,772,425.00
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	636,320	20.80	13,235,456.00
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	516,720	17.90	9,249,288.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	723,380	29.35	21,231,203.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	759,549	11.15	8,468,971.35
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	680,155	13.00	8,842,015.00
TAIWAN BUSINESS BANK	336,646	9.58	3,225,068.68
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	588,451	19.95	11,739,597.45
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	220,574	39.60	8,734,730.40
CHAILEASE HOLDING CO LTD	75,973	160.00	12,155,680.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	644,152	19.70	12,689,794.40
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	552,035	41.15	22,716,240.25
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	838,789	9.20	7,716,858.80
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	187,359	22.00	4,121,898.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	425,541	45.50	19,362,115.50
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	708,228	8.52	6,034,102.56
ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION	32,000	287.50	9,200,000.00
ACER INC	160,767	23.75	3,818,216.25
ADVANTECH CO.,LTD.	23,750	328.50	7,801,875.00
ASUSTEK COMPUTER INC	45,805	248.00	11,359,640.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	40,840	202.50	8,270,100.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	48,645	86.10	4,188,334.50

COMPAL ELECTRONICS	244,590	20.60	5,038,554.00
INVENTEC CO.,LTD	136,911	23.95	3,279,018.45
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	145,897	49.30	7,192,722.10
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	52,000	125.50	6,526,000.00
PEGATRON CORP	121,692	67.80	8,250,717.60
QUANTA COMPUTER INC	170,684	79.80	13,620,583.20
WISTRON CORP	212,457	30.55	6,490,561.35
WIWYNN CORP	5,000	693.00	3,465,000.00
AU OPTRONICS CORP	670,008	15.15	10,150,621.20
DELTA ELECTRONICS INC	128,681	249.00	32,041,569.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,834	53.70	2,944,585.80
HON HAI PRECISION INDUSTRY	837,649	91.80	76,896,178.20
INNOLUX CORP	505,322	14.35	7,251,370.70
LARGAN PRECISION CO LTD	7,040	3,260.00	22,950,400.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	77,566	46.70	3,622,332.20
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	78,000	84.00	6,552,000.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	18,000	223.00	4,014,000.00
WPG HOLDINGS CO LTD	120,387	42.55	5,122,466.85
YAGEO CORPORATION	23,377	500.00	11,688,500.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	36,410	117.00	4,259,970.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	220,658	80.90	17,851,232.20
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,570.00	3,140,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	13,000	655.00	8,515,000.00
MEDIATEK INC	99,538	715.00	71,169,670.00
NANYA TECHNOLOGY CO	62,000	84.00	5,208,000.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	38,058	351.50	13,377,387.00
PHISON ELECTRONICS CORP	9,306	331.50	3,084,939.00
POWERTECH TECHNOLOGY INC	46,147	94.40	4,356,276.80
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	32,417	400.50	12,983,008.50
SILERGY CORP	5,000	2,335.00	11,675,000.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,626,000	511.00	830,886,000.00
UNITED MICROELECTRONICS CORP	794,500	46.75	37,142,875.00
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	69,000	115.00	7,935,000.00
WIN SEMICONDUCTORS CORP	21,000	344.00	7,224,000.00
WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	26.70	6,461,400.00

	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	263,065	108.50	28,542,552.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	105,000	60.80	6,384,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	102,200	98.80	10,097,360.00	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	43,021	46.45	1,998,325.45	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	46,509	40.60	1,888,265.40	
小計	銘柄数：87			1,810,489,482.14	
				(6,662,601,294)	
	組入時価比率：12.4%			13.4%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	44,705	377.55	16,878,372.75	
	COAL INDIA LTD	76,900	136.25	10,477,625.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	34,380	213.65	7,345,287.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	113,000	90.25	10,198,250.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	157,000	93.15	14,624,550.00	
	PETRONET LNG LTD	34,980	246.10	8,608,578.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	189,900	1,994.15	378,689,085.00	
	ASIAN PAINTS LTD	26,200	2,648.25	69,384,150.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	19,000	731.05	13,889,950.00	
	PI INDUSTRIES LTD	7,000	2,227.00	15,589,000.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	6,620	1,731.85	11,464,847.00	
	UPL LTD	32,100	449.40	14,425,740.00	
	ACC LIMITED	6,000	1,614.65	9,687,900.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	57,000	246.70	14,061,900.00	
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	17,700	897.15	15,879,555.00	
	SHREE CEMENT LIMITED	470	23,826.75	11,198,572.50	
	ULTRATECH CEMENT LTD	8,130	5,044.75	41,013,817.50	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	117,000	236.95	27,723,150.00	
	JSW STEEL LTD	53,000	366.25	19,411,250.00	
	TATA STEEL LIMITED	49,600	622.30	30,866,080.00	
	VEDANTA LTD	126,000	162.85	20,519,100.00	
	LARSEN&TOUBRO LIMITED	47,100	1,262.20	59,449,620.00	
	HAVELLS INDIA LTD	17,700	895.90	15,857,430.00	
	SIEMENS LIMITED	3,100	1,550.75	4,807,325.00	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	5,010	1,643.80	8,235,438.00	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,380	392.20	4,855,436.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,600	478.55	20,386,230.00	

BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,000	1,555.80	10,890,600.00
BHARAT FORGE LIMITED	12,700	526.60	6,687,820.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	57,438	154.05	8,848,323.90
MRF LTD	200	75,892.35	15,178,470.00
BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	3,374.75	18,864,852.50
EICHER MOTORS LTD	8,200	2,436.75	19,981,350.00
HERO MOTOCORP LTD	6,210	3,073.10	19,083,951.00
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	50,800	710.90	36,113,720.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,270	7,446.05	61,578,833.50
TATA MOTORS LTD	104,000	175.95	18,298,800.00
PAGE INDUSTRIES LTD	340	27,478.50	9,342,690.00
TITAN CO LTD	21,000	1,495.90	31,413,900.00
JUBILANT FOODWORKS LIMITED	4,700	2,707.50	12,725,250.00
TRENT LTD	15,000	684.75	10,271,250.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,500	2,673.10	30,740,650.00
UNITED SPIRITS LTD	22,600	569.35	12,867,310.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,040	3,618.25	29,090,730.00
NESTLE INDIA LIMITED	2,360	18,566.35	43,816,586.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	45,300	601.00	27,225,300.00
ITC LTD	221,100	208.60	46,121,460.00
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	53,400	2,402.25	128,280,150.00
COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)	10,200	1,568.85	16,002,270.00
DABUR INDIA LTD	37,800	514.55	19,449,990.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,200	721.00	19,611,200.00
MARICO LIMITED	26,340	401.30	10,570,242.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	7,000	2,413.05	16,891,350.00
BIOCON LTD	18,600	481.95	8,964,270.00
AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	909.00	16,998,300.00
CIPLA LIMITED	20,980	833.20	17,480,536.00
DR.REDDYS LABORATORIES	7,130	5,201.80	37,088,834.00
IPCA LABORATORIES LTD	6,000	2,164.20	12,985,200.00
LUPIN LTD	14,900	976.20	14,545,380.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	61,700	590.45	36,430,765.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,270	2,785.35	9,108,094.50
AXIS BANK LIMITED	149,500	610.20	91,224,900.00

BANDHAN BANK LTD	56,000	398.15	22,296,400.00	
ICICI BANK LTD	338,800	513.55	173,990,740.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	37,000	1,960.60	72,542,200.00	
YES BANK LTD	839,000	17.55	14,724,450.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,927	1,406.60	11,150,118.20	
REC LTD	39,810	133.90	5,330,559.00	
BAJAJ FINSERV LTD	2,320	8,992.55	20,862,716.00	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	45,500	657.25	29,904,875.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY	16,000	1,484.05	23,744,800.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	17,100	496.15	8,484,165.00	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	25,800	873.90	22,546,620.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	69,600	919.35	63,986,760.00	
INFOSYS LTD	219,600	1,236.05	271,436,580.00	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	4,000	3,625.60	14,502,400.00	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	61,000	2,909.35	177,470,350.00	
TECH MAHINDRA LTD	44,200	947.25	41,868,450.00	
WIPRO LTD	80,400	382.20	30,728,880.00	
INDUS TOWERS LTD	16,510	239.10	3,947,541.00	
BHARTI AIRTEL LIMITED	79,900	517.30	41,332,270.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	127,000	190.00	24,130,000.00	
GAIL INDIA LTD	94,600	120.15	11,366,190.00	
INDRAPRASTHA GAS LTD	13,500	489.15	6,603,525.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	110,700	2,455.15	271,785,105.00	
BAJAJ FINANCE LTD	18,150	5,184.90	94,105,935.00	
MUTHOOT FINANCE LTD	10,000	1,187.95	11,879,500.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	15,700	996.60	15,646,620.00	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,990	2,891.45	5,753,985.50	
ADANI GREEN ENERGY LTD	28,000	1,036.20	29,013,600.00	
NTPC LIMITED	322,000	99.95	32,183,900.00	
DIVIS LABORATORIES LTD	9,700	3,749.60	36,371,120.00	
DLF LIMITED	26,000	226.10	5,878,600.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	70,000	217.30	15,211,000.00	
INFO EDGE INDIA LTD	4,860	4,623.35	22,469,481.00	
小計銘柄数：95			3,433,551,002.85	

				(4,875,642,424)	
	組入時価比率：9.1%			9.8%	
パキスタンル ビー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	51,000	105.05	5,357,550.00	
	HABIB BANK LTD	35,600	134.39	4,784,284.00	
	MCB BANK LIMITED	34,000	184.39	6,269,260.00	
	小計 銘柄数：3			16,411,094.00	
				(10,667,211)	
	組入時価比率：0.0%			0.0%	
カタールリヤル	QATAR FUEL CO	34,700	18.86	654,442.00	
	QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	114,000	3.20	364,800.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING	305,000	2.05	626,470.00	
	INDUSTRIES QATAR	111,700	11.04	1,233,168.00	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	117,900	4.36	514,044.00	
	MASRAF AL RAYAN	237,000	4.55	1,079,772.00	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	47,000	9.21	433,199.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	83,900	17.38	1,458,182.00	
	QATAR NATIONAL BANK	309,000	18.07	5,583,630.00	
	OOREDOO QSC	43,100	7.88	339,800.40	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	34,400	18.29	629,176.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	113,000	3.43	388,494.00	
	小計 銘柄数：12			13,305,177.40	
				(375,072,950)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	
エジプトポンド	ELSWEDY ELECTRIC CO	41,500	8.84	366,860.00	
	EASTERN TOBACCO	51,525	12.52	645,093.00	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	91,300	59.04	5,390,352.00	
	小計 銘柄数：3			6,402,305.00	
				(42,255,213)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	15,000	138.69	2,080,350.00	
	SASOL LTD	36,200	129.21	4,677,402.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,000	257.18	1,800,260.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,110	1,370.00	5,630,700.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	26,400	339.17	8,954,088.00	
	GOLD FIELDS LTD	59,600	139.00	8,284,400.00	

HARMONY GOLD MINING CO LTD	40,800	68.95	2,813,160.00	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	55,700	196.45	10,942,265.00	
KUMBA IRON ORE LTD	3,900	626.70	2,444,130.00	
NORTHAM PLATINUM LTD	26,700	202.98	5,419,566.00	
SIBANYE STILLWATER LTD	161,000	58.35	9,394,350.00	
BIDVEST GROUP LTD	17,200	157.75	2,713,300.00	
NASPERS LTD-N SHS	28,960	2,991.72	86,640,211.20	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	61,610	38.35	2,362,743.50	
MR PRICE GROUP LTD	16,700	170.48	2,847,016.00	
BID CORP LTD	22,800	259.00	5,905,200.00	
CLICKS GROUP LTD	18,300	251.94	4,610,502.00	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	29,200	134.20	3,918,640.00	
SPAR GROUP LIMITED/THE	15,300	186.88	2,859,264.00	
TIGER BRANDS LTD	12,800	213.00	2,726,400.00	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	21,630	125.00	2,703,750.00	
ABSA GROUP LTD	42,300	122.08	5,163,984.00	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,342	1,414.02	6,139,674.84	
NEDBANK GROUP LTD	21,300	132.81	2,828,853.00	
STANDARD BANK GROUP LTD	91,100	128.15	11,674,465.00	
FIRSTRAND LTD	329,000	51.80	17,042,200.00	
REMGRO LTD	33,200	94.25	3,129,100.00	
DISCOVERY LTD	25,800	152.86	3,943,788.00	
OLD MUTUAL LTD	294,000	11.83	3,478,020.00	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	40,350	32.27	1,302,094.50	
SANLAM LIMITED	119,300	58.00	6,919,400.00	
MTN GROUP LTD	109,700	60.27	6,611,619.00	
VODACOM GROUP	39,800	122.67	4,882,266.00	
REINET INVESTMENTS SCA	8,790	269.38	2,367,850.20	
NEPI ROCKCASTLE PLC	26,281	91.85	2,413,909.85	
MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	132.90	3,543,114.00	
小計	銘柄数：36		261,168,036.09	
			(1,849,069,695)	
	組入時価比率：3.5%		3.7%	
U A E ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	173,870	6.21	1,079,732.70

	ABU DHABI ISLAMIC BANK	60,000	4.70	282,000.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	102,029	4.64	473,414.56	
	EMIRATES NBD PJSC	161,000	10.50	1,690,500.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	173,200	13.08	2,265,456.00	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	118,200	17.32	2,047,224.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	277,000	3.21	889,170.00	
	EMAAR MALLS PJSC	211,000	1.87	394,570.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	290,000	3.57	1,035,300.00	
小計	銘柄数：9			10,157,367.26	
				(287,047,198)	
	組入時価比率：0.5%			0.6%	
クウェートディ ナル	AGILITY	72,000	0.67	48,600.00	
	BOUBYAN BANK K.S.C	68,000	0.57	38,760.00	
	GULF BANK	98,000	0.21	21,168.00	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	272,000	0.67	184,144.00	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	446,000	0.84	375,978.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	139,000	0.60	84,512.00	
	MABANEE CO SAKC	36,000	0.65	23,724.00	
小計	銘柄数：7			776,886.00	
				(264,110,164)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
サウジアラビア リヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	9,600	14.18	136,128.00	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	142,800	35.05	5,005,140.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,020	68.40	616,968.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	28,000	14.24	398,720.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	29,300	18.06	529,158.00	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	11,900	81.60	971,040.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	58,600	102.00	5,977,200.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	18,700	27.90	521,730.00	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	47,000	14.98	704,060.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	13,600	67.30	915,280.00	
	SAUDI CEMENT	6,400	58.90	376,960.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	28,200	41.30	1,164,660.00	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	1,200	76.80	92,160.00	

	JARIR MARKETING CO	3,730	176.00	656,480.00	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,700	123.80	458,060.00	
	ALMARAI CO	18,000	54.70	984,600.00	
	SAVOLA	16,600	43.55	722,930.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	3,000	110.60	331,800.00	
	AL RAJHI BANK	80,100	74.70	5,983,470.00	
	ALINMA BANK	61,066	16.30	995,375.80	
	ARAB NATIONAL BANK	47,800	20.26	968,428.00	
	BANK AL - JAZIRA	34,100	13.68	466,488.00	
	BANK ALBILAD	23,300	28.50	664,050.00	
	BANQUE SAUDI FRANSI	37,400	31.70	1,185,580.00	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	101,000	43.25	4,368,250.00	
	RIYAD BANK	97,500	20.48	1,996,800.00	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	65,800	30.45	2,003,610.00	
	SAUDI BRITISH BANK	61,100	24.84	1,517,724.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	3,900	116.00	452,400.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,700	80.00	216,000.00	
	SAUDI TELECOM CO	39,400	106.00	4,176,400.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	23,900	29.45	703,855.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS COMPANY	29,000	13.92	403,680.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	58,200	20.92	1,217,544.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	23,000	8.73	200,790.00	
	EMAAR ECONOMIC CITY	12,000	9.25	111,000.00	
	小計 銘柄数：36			48,194,518.80	
				(1,332,578,444)	
	組入時価比率：2.5%			2.7%	
	合計			49,875,286,101	
				(49,875,286,101)	

(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12月28日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

投資信託受益証券	米ドル	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	521,400	20,026,974.00	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：3.9%	521,400	20,026,974.00 (2,075,195,045) 98.1%	
	合計			2,075,195,045 (2,075,195,045)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	208,100	4,659,359.00	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.0%	208,100	4,659,359.00 (24,275,260) 1.1%	
	ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	191,000	2,463,900.00	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.0%	191,000	2,463,900.00 (17,444,412) 0.8%	
	合計			41,719,672 (41,719,672)	
合計				2,116,914,717 (2,116,914,717)	

(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12月28日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	1,564,057,999	-	1,567,098,106	3,040,107
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	16,570,736	-	16,577,600	6,864
米ドル	16,570,736	-	16,577,600	6,864
合計	-	-	-	3,046,971

（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12月28日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,500,362,527
国債証券	561,100,200,050
地方債証券	49,295,159,248
特殊債券	62,040,417,231
社債券	29,513,545,050
未収利息	995,533,384
前払費用	20,387,458
流動資産合計	709,465,604,948
資産合計	709,465,604,948
負債の部	
流動負債	
未払解約金	367,827,718
未払利息	3,273
流動負債合計	367,830,991
負債合計	367,830,991
純資産の部	
元本等	
元本	532,981,539,158
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	176,116,234,799
元本等合計	709,097,773,957
純資産合計	709,097,773,957
負債純資産合計	709,465,604,948

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(貸借対照表に関する注記)

2020年12月28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	1.3304円
(10,000口当たり純資産額)	(13,304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12月27日 至 2020年12月28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12月28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12月28日現在

期首	2019年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	528,330,983,939円
同期中における追加設定元本額	85,599,564,771円
同期中における一部解約元本額	80,949,009,552円
期末元本額	532,981,539,158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	421,694,883円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	40,870,129,681円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	17,349,346,737円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	2,952,969,326円
野村資産設計ファンド2015	344,647,985円
野村資産設計ファンド2020	348,675,715円
野村資産設計ファンド2025	322,276,212円
野村資産設計ファンド2030	247,108,338円
野村資産設計ファンド2035	125,424,357円
野村資産設計ファンド2040	176,232,605円
野村日本債券インデックスファンド	856,510,780円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	154,089,754,048円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	12,646,247,940円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	9,304,707,012円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	1,273,687,371円
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	10,583,731,664円
野村資産設計ファンド2045	16,669,812円
野村円債投資インデックスファンド	930,906,935円
野村インデックスファンド・国内債券	3,423,557,380円
マイ・ロード	33,509,283,713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	1,272,372,627円
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	16,329,687,991円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,246,993,724円
野村資産設計ファンド2050	21,788,111円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	22,950,537円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	6,256,629円

野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	3,889,654円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,999,603円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	888,375,295円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	263,264,758円
インデックス・ブレンド(タイプ)	54,826,633円
インデックス・ブレンド(タイプ)	27,879,060円
インデックス・ブレンド(タイプ)	70,617,916円
インデックス・ブレンド(タイプ)	12,157,165円
インデックス・ブレンド(タイプ)	11,736,244円
野村6資産均等バランス	2,199,174,881円
世界6資産分散ファンド	117,816,418円
野村資産設計ファンド2060	6,683,083円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合連動型上場投信	2,677,244,255円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	15,127,625,741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)	593,986,539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)	109,832,498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)	1,915,742,012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)	1,365,550,777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)	17,945,606円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	11,645,721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)	464,179円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,568,621,849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)	10,590,778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)	85,847,874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)	72,042,925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)	350,480,448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)	322,001,179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)	844,424,905円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	177,886,074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)	698,854,867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)	1,907,199,452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)	12,110,312円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	35,495,945,988円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	45,144,982,592円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	16,494,556,998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)	50,404,610,935円
マイバランスDC30	12,351,883,038円
マイバランスDC50	9,712,713,411円
マイバランスDC70	3,103,161,465円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合	13,013,153,011円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	833,194,633円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	2,030,370,706円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	897,478,566円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	132,221,697円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	21,694,046円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	21,901,037円

野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	35,816,273円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	13,178,645円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	5,682,297円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	558,857,488円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	284,289,355円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	90,690,032円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	110,859,892円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	2,166,239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12月28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12月28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409回	2,000,000,000	2,005,020,000	
		国庫債券 利付(2年)第413回	500,000,000	501,705,000	
		国庫債券 利付(2年)第415回	3,700,000,000	3,715,318,000	
		国庫債券 利付(2年)第416回	3,000,000,000	3,013,080,000	
		国庫債券 利付(2年)第417回	3,200,000,000	3,214,080,000	
		国庫債券 利付(2年)第418回	3,400,000,000	3,415,674,000	
		国庫債券 利付(5年)第131回	5,300,000,000	5,314,257,000	
		国庫債券 利付(5年)第132回	3,000,000,000	3,009,960,000	
		国庫債券 利付(5年)第133回	6,200,000,000	6,225,172,000	
		国庫債券 利付(5年)第134回	2,500,000,000	2,511,875,000	
		国庫債券 利付(5年)第135回	3,500,000,000	3,518,690,000	
		国庫債券 利付(5年)第136回	3,300,000,000	3,319,239,000	
		国庫債券 利付(5年)第137回	4,000,000,000	4,026,240,000	
		国庫債券 利付(5年)第138回	5,500,000,000	5,538,610,000	
		国庫債券 利付(5年)第139回	4,400,000,000	4,433,440,000	
		国庫債券 利付(5年)第140回	3,400,000,000	3,427,268,000	
		国庫債券 利付(5年)第141回	4,500,000,000	4,538,745,000	
		国庫債券 利付(5年)第143回	4,970,000,000	5,018,507,200	
		国庫債券 利付(5年)第144回	4,500,000,000	4,545,540,000	
		国庫債券 利付(5年)第145回	4,000,000,000	4,040,840,000	
国庫債券 利付(40年)第1回	2,360,000,000	3,442,626,400			
国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,272,105,000			

国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,277,073,000	
国庫債券 利付(40年)第4回	1,130,000,000	1,611,086,200	
国庫債券 利付(40年)第5回	1,200,000,000	1,657,020,000	
国庫債券 利付(40年)第6回	1,300,000,000	1,770,665,000	
国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,836,758,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	1,500,000,000	1,840,695,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	2,050,000,000	1,884,196,000	
国庫債券 利付(40年)第10回	2,010,000,000	2,163,664,500	
国庫債券 利付(40年)第11回	1,750,000,000	1,828,662,500	
国庫債券 利付(40年)第12回	2,070,000,000	1,953,997,200	
国庫債券 利付(40年)第13回	2,920,000,000	2,757,239,200	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,243,840,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,429,952,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	1,700,000,000	1,725,602,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	3,200,000,000	3,243,456,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	4,400,000,000	4,470,400,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,134,293,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,100,000,000	3,156,761,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,250,000,000	5,335,365,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	6,000,000,000	6,138,480,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	3,896,140,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,937,943,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	5,400,000,000	5,516,910,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	3,600,000,000	3,684,420,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	6,600,000,000	6,766,914,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	4,600,000,000	4,707,594,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	2,750,000,000	2,818,640,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	3,000,000,000	3,050,910,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	5,000,000,000	5,111,400,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	5,000,000,000	5,118,100,000	
	4,200,000,000	4,304,790,000	

国庫債券 利付(10年)第340回			
国庫債券 利付(10年)第341回	7,300,000,000	7,451,548,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	2,750,000,000	2,780,305,000	
国庫債券 利付(10年)第343回	5,900,000,000	5,968,204,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	5,800,000,000	5,868,440,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	5,000,000,000	5,061,600,000	
国庫債券 利付(10年)第346回	4,900,000,000	4,962,867,000	
国庫債券 利付(10年)第347回	5,400,000,000	5,470,362,000	
国庫債券 利付(10年)第348回	6,800,000,000	6,889,760,000	
国庫債券 利付(10年)第349回	2,800,000,000	2,838,332,000	
国庫債券 利付(10年)第350回	5,850,000,000	5,928,624,000	
国庫債券 利付(10年)第351回	5,600,000,000	5,675,768,000	
国庫債券 利付(10年)第352回	6,600,000,000	6,689,694,000	
国庫債券 利付(10年)第353回	5,100,000,000	5,167,422,000	
国庫債券 利付(10年)第354回	4,350,000,000	4,405,680,000	
国庫債券 利付(10年)第355回	5,100,000,000	5,162,883,000	
国庫債券 利付(10年)第356回	4,800,000,000	4,856,688,000	
国庫債券 利付(10年)第357回	1,900,000,000	1,920,482,000	
国庫債券 利付(10年)第358回	5,470,000,000	5,525,520,500	
国庫債券 利付(10年)第359回	5,300,000,000	5,347,647,000	
国庫債券 利付(10年)第360回	5,500,000,000	5,545,375,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	500,000,000	623,520,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	500,000,000	610,300,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	194,550,400	
国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,155,924,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	183,520,500	
国庫債券 利付(30年)第6回	600,000,000	752,352,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	750,750,000	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	120,131,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	265,000,000	305,947,800	

国庫債券	利付(30年)第10回	250,000,000	279,847,500
国庫債券	利付(30年)第11回	160,000,000	191,185,600
国庫債券	利付(30年)第12回	220,000,000	274,428,000
国庫債券	利付(30年)第13回	290,000,000	358,967,800
国庫債券	利付(30年)第14回	800,000,000	1,034,704,000
国庫債券	利付(30年)第15回	900,000,000	1,179,324,000
国庫債券	利付(30年)第16回	915,000,000	1,202,566,200
国庫債券	利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,566,360,000
国庫債券	利付(30年)第18回	2,200,000,000	2,848,714,000
国庫債券	利付(30年)第19回	2,050,000,000	2,663,052,500
国庫債券	利付(30年)第20回	1,270,000,000	1,690,255,700
国庫債券	利付(30年)第21回	300,000,000	391,599,000
国庫債券	利付(30年)第22回	600,000,000	803,262,000
国庫債券	利付(30年)第23回	840,000,000	1,128,288,000
国庫債券	利付(30年)第24回	700,000,000	942,592,000
国庫債券	利付(30年)第25回	500,000,000	659,480,000
国庫債券	利付(30年)第26回	850,000,000	1,136,671,000
国庫債券	利付(30年)第27回	1,550,000,000	2,108,201,500
国庫債券	利付(30年)第28回	1,200,000,000	1,639,032,000
国庫債券	利付(30年)第29回	1,500,000,000	2,031,885,000
国庫債券	利付(30年)第30回	1,700,000,000	2,281,519,000
国庫債券	利付(30年)第31回	1,200,000,000	1,595,748,000
国庫債券	利付(30年)第32回	1,200,000,000	1,625,832,000
国庫債券	利付(30年)第33回	2,400,000,000	3,130,680,000
国庫債券	利付(30年)第34回	1,900,000,000	2,561,390,000
国庫債券	利付(30年)第35回	2,300,000,000	3,021,671,000
国庫債券	利付(30年)第36回	2,300,000,000	3,031,699,000
国庫債券	利付(30年)第37回	2,300,000,000	2,995,589,000
国庫債券	利付(30年)第38回	1,600,000,000	2,057,136,000
国庫債券	利付(30年)第39回	1,600,000,000	2,092,720,000
国庫債券	利付(30年)第40回	1,300,000,000	1,675,648,000
国庫債券	利付(30年)第41回	1,500,000,000	1,902,300,000
国庫債券	利付(30年)第42回	1,600,000,000	2,031,168,000
国庫債券	利付(30年)第43回	1,300,000,000	1,652,014,000
国庫債券	利付(30年)第44回	1,400,000,000	1,780,870,000
国庫債券	利付(30年)第45回	1,700,000,000	2,088,535,000
国庫債券	利付(30年)第46回	1,800,000,000	2,212,794,000
国庫債券	利付(30年)第47回	1,700,000,000	2,128,638,000
国庫債券	利付(30年)第48回	1,900,000,000	2,291,419,000
国庫債券	利付(30年)第49回	2,900,000,000	3,498,908,000
国庫債券	利付(30年)第50回	1,600,000,000	1,703,680,000
国庫債券	利付(30年)第51回	2,650,000,000	2,504,753,500
国庫債券	利付(30年)第52回	1,900,000,000	1,882,824,000

国庫債券 利付（30年）第53回	1,700,000,000	1,723,222,000	
国庫債券 利付（30年）第54回	1,700,000,000	1,803,581,000	
国庫債券 利付（30年）第55回	1,500,000,000	1,590,330,000	
国庫債券 利付（30年）第56回	1,900,000,000	2,013,012,000	
国庫債券 利付（30年）第57回	1,600,000,000	1,691,968,000	
国庫債券 利付（30年）第58回	2,100,000,000	2,219,049,000	
国庫債券 利付（30年）第59回	1,600,000,000	1,647,440,000	
国庫債券 利付（30年）第60回	1,150,000,000	1,240,850,000	
国庫債券 利付（30年）第61回	1,000,000,000	1,026,410,000	
国庫債券 利付（30年）第62回	500,000,000	486,755,000	
国庫債券 利付（30年）第63回	1,400,000,000	1,323,854,000	
国庫債券 利付（30年）第64回	1,500,000,000	1,414,350,000	
国庫債券 利付（30年）第65回	1,200,000,000	1,129,596,000	
国庫債券 利付（30年）第66回	2,700,000,000	2,537,352,000	
国庫債券 利付（30年）第67回	1,300,000,000	1,288,703,000	
国庫債券 利付（30年）第68回	1,350,000,000	1,336,513,500	
国庫債券 利付（20年）第55回	231,000,000	237,006,000	
国庫債券 利付（20年）第56回	120,000,000	123,756,000	
国庫債券 利付（20年）第57回	210,000,000	216,262,200	
国庫債券 利付（20年）第58回	180,000,000	186,319,800	
国庫債券 利付（20年）第59回	230,000,000	238,335,200	
国庫債券 利付（20年）第60回	780,000,000	803,634,000	
国庫債券 利付（20年）第61回	300,000,000	307,554,000	
国庫債券 利付（20年）第62回	440,000,000	450,155,200	
国庫債券 利付（20年）第63回	300,000,000	314,370,000	
国庫債券 利付（20年）第64回	400,000,000	422,156,000	
国庫債券 利付（20年）第65回	455,000,000	482,513,850	
国庫債券 利付（20年）第66回	300,000,000	317,244,000	
国庫債券 利付（20年）第67回	310,000,000	330,305,000	
国庫債券 利付（20年）第68回	290,000,000	311,810,900	
国庫債券 利付（20年）第69回	560,000,000	600,303,200	
国庫債券 利付（20年）第70回	540,000,000	587,574,000	
国庫債券 利付（20年）第71回	200,000,000	216,224,000	
国庫債券 利付（20年）第72回	1,470,000,000	1,592,436,300	
国庫債券 利付（20年）第73回	1,200,000,000	1,301,868,000	
国庫債券 利付（20年）第74回	800,000,000	871,112,000	
国庫債券 利付（20年）第75回	600,000,000	656,658,000	
国庫債券 利付（20年）第76回	910,000,000	988,205,400	
国庫債券 利付（20年）第77回	700,000,000	763,133,000	
国庫債券 利付（20年）第78回	800,000,000	872,688,000	
国庫債券 利付（20年）第79回	860,000,000	942,009,600	
国庫債券 利付（20年）第80回	1,400,000,000	1,539,790,000	

国庫債券 利付(20年)第81回	360,000,000	396,273,600
国庫債券 利付(20年)第82回	820,000,000	906,518,200
国庫債券 利付(20年)第83回	1,370,000,000	1,521,837,100
国庫債券 利付(20年)第84回	1,200,000,000	1,326,996,000
国庫債券 利付(20年)第85回	400,000,000	446,428,000
国庫債券 利付(20年)第86回	1,400,000,000	1,577,198,000
国庫債券 利付(20年)第87回	500,000,000	560,660,000
国庫債券 利付(20年)第88回	1,100,000,000	1,245,992,000
国庫債券 利付(20年)第89回	470,000,000	529,788,700
国庫債券 利付(20年)第90回	1,500,000,000	1,699,170,000
国庫債券 利付(20年)第91回	250,000,000	284,635,000
国庫債券 利付(20年)第92回	650,000,000	735,956,000
国庫債券 利付(20年)第93回	300,000,000	339,441,000
国庫債券 利付(20年)第94回	200,000,000	227,546,000
国庫債券 利付(20年)第95回	100,000,000	115,638,000
国庫債券 利付(20年)第96回	400,000,000	457,340,000
国庫債券 利付(20年)第97回	300,000,000	346,605,000
国庫債券 利付(20年)第98回	300,000,000	344,574,000
国庫債券 利付(20年)第99回	1,100,000,000	1,269,092,000
国庫債券 利付(20年)第100回	1,520,000,000	1,771,727,200
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	295,035,000
国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	593,010,000
国庫債券 利付(20年)第103回	600,000,000	707,100,000
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	465,388,000
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,220,264,000
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	470,532,000
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	351,927,000
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,851,296,000
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,045,314,000
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,295,778,000
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	952,768,000
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,128,428,000
国庫債券 利付(20年)第113回	2,000,000,000	2,373,740,000
国庫債券 利付(20年)第114回	1,700,000,000	2,024,037,000

国庫債券 利付(20年)第115回	1,000,000,000	1,199,610,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,324,389,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	1,400,000,000	1,672,664,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	594,455,000	
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	935,976,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	920,824,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	1,200,000,000	1,419,672,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	900,000,000	1,056,015,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	500,000,000	603,235,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,196,520,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	900,000,000	1,098,459,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	1,000,000,000	1,200,140,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	1,200,000,000	1,427,940,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	1,800,000,000	2,148,084,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	1,400,000,000	1,656,130,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	1,400,000,000	1,660,498,000	
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	940,320,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,532,453,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,665,608,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	1,400,000,000	1,669,668,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	700,000,000	827,043,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	819,245,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,184,180,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	929,152,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	1,000,000,000	1,172,810,000	
国庫債券 利付(20年)第140回	2,300,000,000	2,731,250,000	
	2,600,000,000	3,094,104,000	

国庫債券 利付(20年)第141回			
国庫債券 利付(20年)第142回	950,000,000	1,141,786,000	
国庫債券 利付(20年)第143回	1,300,000,000	1,534,520,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,300,000,000	1,518,829,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,300,000,000	2,748,293,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	2,400,000,000	2,873,496,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	4,000,000,000	4,747,240,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	2,100,000,000	2,469,138,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	3,850,000,000	4,533,413,500	
国庫債券 利付(20年)第150回	3,330,000,000	3,881,980,800	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,500,000,000	2,849,550,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	2,650,000,000	3,022,722,500	
国庫債券 利付(20年)第153回	1,600,000,000	1,850,176,000	
国庫債券 利付(20年)第154回	1,220,000,000	1,394,508,800	
国庫債券 利付(20年)第155回	5,050,000,000	5,629,184,500	
国庫債券 利付(20年)第156回	2,650,000,000	2,716,250,000	
国庫債券 利付(20年)第157回	3,190,000,000	3,170,955,700	
国庫債券 利付(20年)第158回	2,100,000,000	2,181,081,000	
国庫債券 利付(20年)第159回	2,000,000,000	2,105,900,000	
国庫債券 利付(20年)第160回	2,300,000,000	2,455,595,000	
国庫債券 利付(20年)第161回	2,100,000,000	2,207,541,000	
国庫債券 利付(20年)第162回	1,700,000,000	1,785,476,000	
国庫債券 利付(20年)第163回	2,600,000,000	2,728,180,000	
国庫債券 利付(20年)第164回	2,600,000,000	2,680,756,000	
国庫債券 利付(20年)第165回	2,200,000,000	2,265,516,000	
国庫債券 利付(20年)第166回	2,300,000,000	2,444,555,000	
	2,600,000,000	2,670,460,000	

		国庫債券 利付(20年)第167回			
		国庫債券 利付(20年)第168回	2,700,000,000	2,720,790,000	
		国庫債券 利付(20年)第169回	2,530,000,000	2,501,537,500	
		国庫債券 利付(20年)第170回	2,000,000,000	1,973,740,000	
		国庫債券 利付(20年)第171回	1,300,000,000	1,281,592,000	
		国庫債券 利付(20年)第172回	3,840,000,000	3,850,291,200	
		国庫債券 利付(20年)第173回	3,250,000,000	3,255,850,000	
		国庫債券 利付(20年)第174回	2,590,000,000	2,592,356,900	
		メキシコ合衆国 第25回円貨社債(2018)	100,000,000	98,946,000	
	小計	銘柄数:262 組入時価比率:79.1%	518,976,000,000	561,100,200,050	80.0%
	合計			561,100,200,050	
地方債証券	日本円	東京都 公募第707回	100,000,000	101,049,000	
		東京都 公募第708回	100,000,000	101,301,000	
		東京都 公募第710回	100,000,000	101,183,000	
		東京都 公募第712回	100,000,000	101,313,000	
		東京都 公募第715回	100,000,000	101,483,000	
		東京都 公募第716回	200,000,000	203,006,000	
		東京都 公募第731回	100,000,000	102,013,000	
		東京都 公募第736回	100,000,000	101,844,000	
		東京都 公募第745回	300,000,000	307,020,000	
		東京都 公募第760回	100,000,000	100,000,000	
		東京都 公募第761回	100,000,000	100,171,000	
		東京都 公募第769回	500,000,000	504,670,000	
		東京都 公募第778回	100,000,000	100,645,000	
		東京都 公募(30年)第7回	100,000,000	135,814,000	
		東京都 公募第10回	200,000,000	267,022,000	
		東京都 公募第1回	300,000,000	311,373,000	
		東京都 公募(20年)第3回	200,000,000	214,494,000	
		東京都 公募第7回	100,000,000	110,183,000	
		東京都 公募(20年)第13回	100,000,000	114,483,000	
		東京都 公募(20年)第16回	200,000,000	230,600,000	
		東京都 公募(20年)第17回	200,000,000	231,868,000	
		東京都 公募第23回	100,000,000	119,602,000	
		東京都 公募(20年)第26回	100,000,000	117,533,000	
		東京都 公募(20年)第29回	200,000,000	233,294,000	
		北海道 公募平成24年度第6回	100,000,000	101,355,000	

北海道	公募平成24年度第9回	100,000,000	101,398,000
北海道	公募平成25年度第1回	300,000,000	303,837,000
北海道	公募平成26年度第13回	100,000,000	101,719,000
北海道	公募平成27年度第7回	100,000,000	102,342,000
北海道	公募平成28年度第13回	200,000,000	199,978,000
北海道	公募平成29年度第5回	200,000,000	201,228,000
北海道	公募平成29年度第6回	700,000,000	699,783,000
北海道	公募平成29年度第7回	100,000,000	100,829,000
北海道	公募平成29年度第9回	100,000,000	100,814,000
宮城県	公募第32回2号	100,000,000	100,344,000
神奈川県	公募第188回	200,000,000	202,538,000
神奈川県	公募第196回	100,000,000	101,486,000
神奈川県	公募第200回	100,000,000	102,223,000
神奈川県	公募第205回	100,000,000	102,107,000
神奈川県	公募第206回	100,000,000	102,238,000
神奈川県	公募第210回	200,000,000	203,506,000
神奈川県	公募第231回	200,000,000	202,152,000
神奈川県	公募第247回	200,000,000	200,092,000
神奈川県	公募(30年)第3回	100,000,000	135,783,000
神奈川県	公募第7回	300,000,000	340,062,000
神奈川県	公募(20年)第14回	100,000,000	117,747,000
神奈川県	公募(20年)第17回	200,000,000	237,728,000
神奈川県	公募(20年)第26回	100,000,000	115,986,000
大阪府	公募第378回	104,000,000	106,046,720
大阪府	公募第381回	100,000,000	102,082,000
大阪府	公募第382回	100,000,000	102,105,000
大阪府	公募第383回	100,000,000	102,226,000
大阪府	公募第384回	100,000,000	102,201,000
大阪府	公募第387回	300,000,000	305,448,000
大阪府	公募第389回	100,000,000	101,936,000
大阪府	公募第396回	200,000,000	204,664,000
大阪府	公募第417回	102,000,000	103,082,220
大阪府	公募第423回	100,000,000	100,730,000
大阪府	公募第429回	179,000,000	180,426,630
大阪府	公募第452回	100,000,000	99,567,000
大阪府	公募第5回	100,000,000	119,047,000
大阪府	公募第8回	100,000,000	117,777,000
大阪府	公募(5年)第137回	1,024,000,000	1,023,682,560
大阪府	公募(5年)第141回	230,000,000	229,908,000
京都府	公募平成24年度第2回	100,000,000	101,330,000
京都府	公募平成24年度第6回	100,000,000	101,432,000
京都府	公募平成25年度第15回	200,000,000	204,186,000

京都府	公募平成26年度第5回	100,000,000	115,780,000
京都府	公募平成26年度第7回	200,000,000	204,126,000
京都府	公募(20年)平成27年度第5回	200,000,000	226,388,000
京都府	公募(15年)平成27年度第8回	100,000,000	106,435,000
京都府	公募(20年)平成28年度第5回	100,000,000	99,881,000
京都府	公募平成29年度第4回	100,000,000	100,806,000
兵庫県	公募平成26年度第17回	100,000,000	101,809,000
兵庫県	公募平成29年度第22回	100,000,000	100,737,000
兵庫県	公募(30年)第2回	200,000,000	269,488,000
兵庫県	公募(15年)第1回	300,000,000	326,853,000
兵庫県	公募(15年)第3回	200,000,000	216,614,000
兵庫県	公募(12年)第3回	300,000,000	306,891,000
兵庫県	公募(15年)第11回	100,000,000	105,541,000
兵庫県	公募第2回	100,000,000	115,346,000
兵庫県	公募第9回	100,000,000	118,735,000
兵庫県	公募(20年)第11回	200,000,000	233,090,000
兵庫県	公募(20年)第14回	100,000,000	117,141,000
兵庫県	公募(20年)第22回	100,000,000	114,913,000
静岡県	公募平成24年度第5回	100,060,000	101,369,785
静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	101,489,000
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	103,380,570
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	168,763,650
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	102,072,000
静岡県	公募平成26年度第9回	200,000,000	204,156,000
静岡県	公募平成27年度第11回	115,400,000	115,820,056
静岡県	公募平成28年度第2回	300,000,000	300,624,000
静岡県	公募平成29年度第3回	100,000,000	100,650,000
静岡県	公募(31年)第1回	174,000,000	174,140,940
静岡県	公募(15年)第5回	200,000,000	215,802,000
静岡県	公募(15年)第9回	100,000,000	106,054,000
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	116,792,000
静岡県	公募(20年)第14回	200,000,000	234,976,000
静岡県	公募(20年)第18回	100,000,000	115,921,000
静岡県	公募(20年)第30回	200,000,000	200,144,000
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	115,537,000
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	101,166,000
愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	101,292,000
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	116,909,000
愛知県	公募平成24年度第8回	150,000,000	152,065,500
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	434,608,000

愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	119,266,000
愛知県	公募(30年)平成25年度第8回	120,000,000	157,585,200
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	127,340,000
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	114,620,000
愛知県	公募(15年)平成27年度第2回	100,000,000	105,821,000
愛知県	公募平成27年度第15回	100,000,000	102,289,000
愛知県	公募平成29年度第8回	100,000,000	100,897,000
愛知県	公募平成29年度第9回	100,000,000	100,568,000
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	101,534,000
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	204,330,000
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	111,080,932
広島県	公募平成29年度第3回	100,000,000	100,571,000
広島県	公募平成29年度第4回	211,300,000	213,550,345
広島県	公募令和2年度第2回	100,000,000	100,615,000
埼玉県	公募平成24年度第4回	300,000,000	303,918,000
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	102,342,000
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	151,235,280
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	102,087,000
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	102,090,000
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	102,237,000
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	204,072,000
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	407,436,000
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	101,743,000
埼玉県	公募平成27年度第9回	100,000,000	101,004,000
埼玉県	公募平成28年度第5回	100,000,000	100,044,000
埼玉県	公募平成30年度第4回	200,000,000	201,936,000
埼玉県	公募平成30年度第7回	200,000,000	200,056,000
埼玉県	公募(15年)第1回	100,000,000	107,246,000
埼玉県	公募(15年)第3回	100,000,000	102,777,000
埼玉県	公募(20年)第6回	100,000,000	116,796,000
埼玉県	公募(20年)第16回	100,000,000	112,990,000
埼玉県	公募(20年)第20回	100,000,000	104,275,000
福岡県	公募平成26年度第1回	100,000,000	102,249,000
福岡県	公募平成27年度第1回	300,000,000	307,656,000
福岡県	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,871,000
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	108,530,000
福岡県	公募(15年)平成27年度第1回	200,000,000	212,796,000
福岡県	公募(15年)令和元年度第1回	100,000,000	99,777,000
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	136,509,000

福岡県 公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	127,612,000
福岡県 公募(30年・定時償還)平成29年度第2回	100,000,000	106,827,000
福岡県 公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	115,617,000
福岡県 公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	116,520,000
千葉県 公募平成24年度第1回	100,000,000	101,378,000
千葉県 公募平成24年度第2回	100,000,000	101,266,000
千葉県 公募平成24年度第7回	100,000,000	101,448,000
千葉県 公募平成24年度第8回	100,000,000	101,723,000
千葉県 公募平成25年度第3回	100,000,000	102,189,000
千葉県 公募平成25年度第4回	100,000,000	102,342,000
千葉県 公募平成26年度第3回	200,000,000	204,292,000
千葉県 公募平成28年度第4回	200,000,000	200,458,000
千葉県 公募平成29年度第4回	100,000,000	100,570,000
千葉県 公募平成29年度第8回	100,000,000	100,899,000
千葉県 公募(20年)第1回	400,000,000	440,888,000
千葉県 公募(20年)第8回	100,000,000	119,186,000
千葉県 公募(20年)第16回	200,000,000	233,708,000
千葉県 公募(20年)第17回	100,000,000	115,134,000
群馬県 公募第12回	100,000,000	102,369,000
群馬県 公募(20年)第3回	100,000,000	116,965,000
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	190,481,801
共同発行市場地方債 公募第108回	200,000,000	202,480,000
共同発行市場地方債 公募第110回	200,000,000	202,476,000
共同発行市場地方債 公募第111回	200,000,000	202,622,000
共同発行市場地方債 公募第112回	100,000,000	101,306,000
共同発行市場地方債 公募第113回	800,000,000	810,080,000
共同発行市場地方債 公募第114回	243,700,000	247,121,548
共同発行市場地方債 公募第115回	100,000,000	101,441,000
共同発行市場地方債 公募第116回	200,000,000	203,016,000
共同発行市場地方債 公募第118回	100,000,000	101,723,000
共同発行市場地方債 公募第119回	200,000,000	203,410,000
共同発行市場地方債 公募第120回	300,000,000	304,491,000
共同発行市場地方債 公募第121回	100,000,000	101,302,000

共同発行市場地方債 公募第122回	400,000,000	405,876,000
共同発行市場地方債 公募第124回	300,000,000	306,948,000
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	102,193,000
共同発行市場地方債 公募第128回	700,000,000	713,223,000
共同発行市場地方債 公募第129回	100,000,000	102,094,000
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	102,307,000
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	102,104,000
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	204,292,000
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	204,058,000
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	158,163,550
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	549,838,800
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,017,110,000
共同発行市場地方債 公募第156回	200,000,000	200,626,000
共同発行市場地方債 公募第157回	300,000,000	300,636,000
共同発行市場地方債 公募第161回	300,000,000	300,276,000
共同発行市場地方債 公募第172回	600,000,000	606,276,000
共同発行市場地方債 公募第184回	100,000,000	100,752,000
共同発行市場地方債 公募第186回	400,000,000	405,388,000
共同発行市場地方債 公募第188回	300,000,000	304,215,000
共同発行市場地方債 公募第190回	610,000,000	613,666,100
共同発行市場地方債 公募第191回	100,000,000	100,445,000
共同発行市場地方債 公募第200回	100,000,000	99,553,000
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	117,857,000
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	123,902,000
島根県 公募(30年)平成29年度第1回	100,000,000	106,557,000
佐賀県 公募平成28年度第1回	100,000,000	100,206,000
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	203,798,000
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	101,868,000
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	144,696,580

栃木県	公募平成24年度第1回	100,000,000	101,500,000
栃木県	公募平成25年度第1回	100,000,000	101,868,000
熊本市	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,861,000
新潟市	公募平成25年度第1回	233,200,000	238,157,832
新潟市	公募平成29年度第1回	100,000,000	101,008,000
浜松市	公募平成26年度第1回	100,000,000	101,322,000
大阪市	公募平成25年度第6回	100,000,000	101,984,000
大阪市	公募平成26年度第5回	100,000,000	102,184,000
大阪市	公募(15年)第1回	100,000,000	109,477,000
大阪市	公募(20年)第1回	300,000,000	345,939,000
大阪市	公募(20年)第5回	100,000,000	118,410,000
大阪市	公募(20年)第6回	100,000,000	116,885,000
大阪市	公募(20年)第17回	100,000,000	117,794,000
名古屋市	公募第478回	100,000,000	101,285,000
名古屋市	公募第481回	100,000,000	101,451,000
名古屋市	公募第488回	300,000,000	306,573,000
名古屋市	公募第489回	100,000,000	101,793,000
名古屋市	公募第501回	200,000,000	201,478,000
名古屋市	公募第503回	100,000,000	100,935,000
名古屋市	公募第504回	200,000,000	201,932,000
名古屋市	公募第512回	300,000,000	300,984,000
名古屋市	公募(12年)第1回	200,000,000	209,154,000
名古屋市	公募(15年)第2回	100,000,000	106,942,000
京都市	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,961,000
京都市	公募平成29年度第4回	101,280,000	102,422,438
京都市	公募(20年)第2回	100,000,000	109,992,000
京都市	公募(20年)第5回	200,000,000	227,578,000
京都市	公募(20年)第6回	100,000,000	115,490,000
京都市	公募(20年)第13回	100,000,000	114,595,000
京都市	公募(20年)第15回	200,000,000	204,438,000
神戸市	公募平成26年度第17回	300,000,000	303,303,000
神戸市	公募平成28年度第1回	200,000,000	200,422,000
横浜市	公募公債平成24年度2回	200,000,000	202,902,000
横浜市	公募公債平成25年度1回	200,000,000	203,128,000
横浜市	公募公債平成25年度5回	200,000,000	203,724,000
横浜市	公募公債平成26年度5回	200,000,000	203,648,000
横浜市	公募平成28年度第5回	300,000,000	303,027,000
横浜市	公募平成29年度第3回	100,000,000	101,022,000
横浜市	公募(30年)第2回	200,000,000	261,196,000
横浜市	公募(20年)第18回	100,000,000	117,685,000
横浜市	公募(20年)第26回	100,000,000	118,594,000
横浜市	公募(20年)第30回	100,000,000	114,796,000

	札幌市 公募(15年)平成23年度第9回	200,000,000	217,426,000
	札幌市 公募(20年)平成24年度第1回	100,000,000	117,923,000
	札幌市 公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	118,935,000
	札幌市 公募平成26年度第4回	100,000,000	101,842,000
	札幌市 公募平成26年度第9回	200,000,000	203,340,000
	川崎市 公募第85回	100,000,000	101,404,000
	川崎市 公募(20年)第17回	100,000,000	115,869,000
	川崎市 公募(20年)第19回	100,000,000	114,520,000
	川崎市 公募(30年)第11回	100,000,000	103,741,000
	北九州市 公募(20年)第3回	200,000,000	230,052,000
	北九州市 公募(20年)第14回	100,000,000	117,665,000
	福岡市 公募(20年)平成21年度第3回	200,000,000	235,282,000
	福岡市 公募(20年)平成23年度第4回	100,000,000	118,100,000
	福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	116,156,000
	福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	102,026,000
	福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	163,083,200
	広島市 公募平成26年度第2回	100,000,000	101,779,000
	広島市 公募平成27年度第2回	500,000,000	511,455,000
	広島市 公募(10年)平成30年度第6回	241,000,000	242,188,130
	千葉市 公募平成24年度第1回	100,000,000	101,378,000
	三重県 公募平成24年度第1回	140,660,000	142,689,723
	三重県 公募平成28年度第1回	155,000,000	156,111,350
	福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	101,047,000
	福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	200,478,000
	山梨県 公募平成24年度第1回	200,000,000	202,896,000
	岡山県 公募平成28年度第2回	168,900,000	170,372,808
	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	116,530,000
	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	354,387,000
	福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	115,903,000
	福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	105,311,000
小計	銘柄数:280 組入時価比率:7.0%	46,910,820,000	49,295,159,248 7.0%
合計			49,295,159,248
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)	100,000,000 102,072,000
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000 153,068,700

新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	195,186,720	
新関西国際空港債券 政府保証第5回	117,000,000	117,950,040	
新関西国際空港社債 財投機関債第6回	300,000,000	330,132,000	
新関西国際空港社債 財投機関債第9回	100,000,000	108,607,000	
新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	107,807,000	
新関西国際空港社債 財投機関債第22回	200,000,000	200,000,000	
日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	105,435,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000	303,999,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	107,741,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第78回	200,000,000	201,624,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第82回	100,000,000	101,104,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000	302,730,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第96回	200,000,000	201,270,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000	103,479,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	159,000,000	161,330,940	
日本政策投資銀行社債 政府保証第38回	1,500,000,000	1,499,865,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	300,000,000	302,709,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第55回	300,000,000	301,473,000	
道路債券 財投機関債第17回	300,000,000	309,078,000	
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	132,539,000	
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	224,820,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第17回	100,000,000	112,933,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第23回	300,000,000	344,766,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第33回	200,000,000	308,478,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第39回	200,000,000	234,638,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第47回	100,000,000	118,792,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第84回	400,000,000	404,884,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第86回	200,000,000	202,256,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第89回	100,000,000	116,747,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第100回	200,000,000	203,062,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第102回	100,000,000	101,436,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第103回	350,000,000	409,990,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第105回	100,000,000	119,145,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第107回	100,000,000	102,267,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第116回	400,000,000	407,656,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第122回	100,000,000	102,169,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第123回	100,000,000	102,124,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第130回	200,000,000	203,680,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第134回	200,000,000	203,466,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第136回	200,000,000	204,118,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第145回	300,000,000	357,669,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第149回	100,000,000	121,100,000	
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	106,606,000	
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	111,349,000	
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	92,509,000	
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	103,354,000	
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	235,664,000	
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	236,084,000	
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	238,490,000	
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	237,452,000	
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	234,750,000	
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	131,127,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回	100,000,000	101,005,000	
	140,000,000	141,507,800	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回			
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	1,013,110,000	
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	126,836,000	
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	101,361,000	
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	116,772,000	
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	220,995,320	
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	115,987,000	
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	385,866,000	
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	202,946,000	
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	202,986,000	
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	203,016,000	
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	915,624,000	
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	118,365,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回	196,000,000	198,450,000	
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	405,820,000	
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	1,021,990,000	
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	278,038,400	
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	306,192,000	
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	139,822,200	
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	147,991,350	
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	116,272,000	
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	125,316,000	
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	116,314,000	
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	102,217,000	
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	125,427,000	
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	193,807,600	
	630,000,000	642,795,300	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第229回			
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	101,822,000	
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	562,280,000	
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	408,410,480	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第271回	151,000,000	151,078,520	
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	100,419,000	
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	406,272,360	
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	100,714,000	
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	605,196,000	
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	100,438,000	
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	104,607,000	
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	506,080,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第342回	131,000,000	132,137,080	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第351回	100,000,000	100,861,000	
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	201,436,000	
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	101,331,000	
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	135,101,200	
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	529,364,000	
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	134,236,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第38回	1,000,000,000	1,083,060,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	134,413,000	
地方公営企業等金融機構債券（20年）第1回	100,000,000	115,546,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	100,000,000	117,747,000	
地方公共団体金融機構債券 F16回	100,000,000	111,702,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	300,000,000	357,753,000	
地方公共団体金融機構債券 F24回	100,000,000	103,679,000	
	300,000,000	345,954,000	

地方公共団体金融機構債券(20年)第10回			
地方公共団体金融機構債券 F104回	100,000,000	105,394,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	103,989,000	
地方公共団体金融機構債券 F122回	100,000,000	108,470,000	
地方公共団体金融機構債券 F124回	100,000,000	108,459,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第37回	604,000,000	612,123,800	
地方公共団体金融機構債券 第37回	400,000,000	405,052,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第38回	194,000,000	196,576,320	
地方公共団体金融機構債券 F132回	500,000,000	524,445,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第39回	100,000,000	101,339,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第40回	101,000,000	102,455,410	
政保 地方公共団体金融機構債券第41回	102,000,000	103,493,280	
地方公共団体金融機構債券 第41回	600,000,000	608,694,000	
地方公共団体金融機構債券 F142回	100,000,000	103,899,000	
地方公共団体金融機構債券 F145回	200,000,000	208,722,000	
地方公共団体金融機構債券 F147回	100,000,000	107,430,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第42回	108,000,000	109,675,080	
地方公共団体金融機構債券 第42回	100,000,000	101,517,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第43回	202,000,000	204,995,660	
政保 地方公共団体金融機構債券第44回	145,000,000	147,480,950	
地方公共団体金融機構債券 第44回	100,000,000	101,604,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第45回	223,000,000	226,866,820	
地方公共団体金融機構債券 F160回	100,000,000	106,961,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第48回	500,000,000	507,150,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第49回	13,000,000	13,281,320	
地方公共団体金融機構債券(20年)第29回	100,000,000	117,952,000	
	100,000,000	102,305,000	

政保 地方公共団体金融機構債券 第50回			
地方公共団体金融機構債券 第51 回	600,000,000	613,128,000	
地方公共団体金融機構債券 第52 回	300,000,000	306,483,000	
地方公共団体金融機構債券(15 年) 第2回	200,000,000	216,754,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第56回	591,000,000	604,327,050	
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回	116,000,000	118,512,560	
地方公共団体金融機構債券(20 年) 第38回	100,000,000	115,629,000	
地方公共団体金融機構債券 F24 0回	300,000,000	325,395,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	101,980,000	
地方公共団体金融機構債券 第64 回	100,000,000	102,074,000	
地方公共団体金融機構債券(20 年) 第39回	100,000,000	114,922,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第65回	400,000,000	408,036,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第69回	320,000,000	325,347,200	
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回	189,000,000	193,146,660	
地方公共団体金融機構債券 第74 回	300,000,000	306,810,000	
地方公共団体金融機構債券 第77 回	100,000,000	102,273,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回	509,000,000	518,355,420	
地方公共団体金融機構債券 第79 回	400,000,000	409,256,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (8年) 第5回	500,000,000	502,515,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回	116,000,000	116,060,320	
地方公共団体金融機構債券 第95 回	200,000,000	201,320,000	
地方公共団体金融機構債券 第10 1回	400,000,000	403,800,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第108回	157,000,000	158,329,790	
政保 地方公共団体金融機構債券 第110回	100,000,000	100,715,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第113回	110,000,000	111,530,100	
公営企業債券(20年) 第2回財 投機関債	100,000,000	102,848,000	
	200,000,000	211,400,000	

公営企業債券(20年) 第5回財 投機関債			
公営企業債券(20年) 第19回 財投機関債	100,000,000	113,578,000	
公営企業債券(20年) 第20回 財投機関債	100,000,000	113,393,000	
公営企業債券(20年) 第24回 財投機関債	100,000,000	115,879,000	
公営企業債券(20年) 第25回 財投機関債	100,000,000	117,767,000	
都市再生債券 財投機関債第96回	200,000,000	204,238,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	107,655,000	
都市再生債券 財投機関債第101 回	100,000,000	107,026,000	
都市再生債券 財投機関債第109 回	100,000,000	107,176,000	
都市再生債券 財投機関債第113 回	300,000,000	320,010,000	
都市再生債券 財投機関債第127 回	100,000,000	99,972,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第 7回	100,000,000	109,773,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第 16回	360,000,000	367,023,600	
東京交通債券 第342回	200,000,000	207,026,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	166,978,920	
関西国際空港債券 政府保証第54 回	300,000,000	353,097,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機 関債	100,000,000	101,359,000	
中部国際空港債券 政府保証第18 回	368,000,000	373,442,720	
預金保険機構債券 政府保証第23 1回	300,000,000	301,014,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第3回	400,000,000	453,704,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第6回	200,000,000	230,422,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第18回	100,000,000	105,809,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第42回	100,000,000	108,008,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第49回	100,000,000	118,414,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第59回	100,000,000	117,413,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第75回	100,000,000	119,419,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第77回	300,000,000	327,495,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	119,394,000	

住宅金融支援機構債券 財投機関債 第85回	200,000,000	234,956,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	217,946,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第120回	100,000,000	118,595,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第123回	100,000,000	118,009,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	134,219,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第132回	200,000,000	214,138,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第137回	100,000,000	108,898,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第143回	100,000,000	108,379,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回	250,000,000	255,572,500
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第198回	300,000,000	301,245,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第223回	100,000,000	101,845,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第244回	130,000,000	131,614,600
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	203,220,000
成田国際空港 第17回	400,000,000	407,100,000
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第6回	200,000,000	217,874,000
商工債券 利付第806回い号	300,000,000	300,309,000
商工債券 利付第811回い号	300,000,000	300,807,000
商工債券 利付第815回い号	100,000,000	100,303,000
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	100,323,000
商工債券 利付第819回い号	300,000,000	301,077,000
商工債券 利付第829回い号	200,000,000	200,418,000
商工債券 利付第831回い号	200,000,000	200,072,000
商工債券 利付第833回い号	100,000,000	99,866,000
しんきん中金債券 利付第327回	200,000,000	200,094,000
しんきん中金債券 利付第335回	200,000,000	200,254,000
商工債券 利付(3年)第231回	200,000,000	200,122,000
商工債券 利付(3年)第236回	500,000,000	499,865,000
商工債券 利付(10年)第15回	200,000,000	203,668,000
国際協力機構債券 第6回財投機関 債	200,000,000	237,994,000
東日本高速道路 第61回	200,000,000	199,492,000
中日本高速道路 第63回	100,000,000	102,533,000
中日本高速道路 第79回	300,000,000	299,889,000
西日本高速道路 第20回	200,000,000	203,974,000
西日本高速道路 第22回	400,000,000	409,060,000

西日本高速道路 第23回	100,000,000	101,915,000
西日本高速道路 第30回	300,000,000	301,368,000
西日本高速道路 第50回	200,000,000	199,930,000
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	102,065,000
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	204,002,000
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	114,973,000
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	509,675,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第90回	300,000,000	300,306,000
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	29,268,000	29,363,706
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	54,965,000	55,794,421
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	33,084,000	33,520,377
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	36,624,000	37,813,913
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	11,496,000	11,733,967
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	24,872,000	25,523,397
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	28,780,000	30,044,017
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券	31,590,000	31,864,517
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	51,464,000	52,757,804
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	55,005,000	55,763,518
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	49,464,000	50,969,684
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	79,926,000	82,484,431
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	13,667,000	14,173,635
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	21,218,000	22,811,471
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	68,577,000	73,204,575
貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券	12,641,000	12,802,299
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	68,712,000	72,392,214
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券	25,312,000	25,660,546
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	86,103,000	91,422,443
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	66,596,000	70,379,318

貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	37,798,000	40,337,647	
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	82,986,000	88,263,909	
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	84,207,000	88,153,782	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	127,884,000	134,141,364	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	123,981,000	130,794,995	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	79,916,000	83,996,510	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	30,521,000	32,313,193	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	68,320,000	72,516,214	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	41,297,000	43,057,904	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	89,926,000	93,886,341	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	40,231,000	41,945,645	
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	23,044,000	23,439,895	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	121,038,000	127,106,845	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	25,874,000	27,656,718	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	27,975,000	29,959,546	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	26,050,000	27,744,813	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	29,555,000	31,476,370	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	81,404,000	86,161,249	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	115,587,000	122,132,691	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	38,547,000	40,766,536	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	78,514,000	82,263,043	
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	10,607,000	10,716,994	
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券	50,755,000	50,945,838	
貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券	20,792,000	20,870,593	
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	74,340,000	78,958,744	
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	75,066,000	79,985,825	
	139,565,000	146,840,523	

貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	82,668,000	87,432,156	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	135,033,000	141,463,271	
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	118,071,000	123,021,717	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	91,562,000	96,631,787	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	77,766,000	81,673,741	
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	189,184,000	197,315,128	
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	327,488,000	341,095,126	
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	49,625,000	51,516,208	
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	52,028,000	54,069,058	
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	53,252,000	55,125,937	
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	111,406,000	114,608,922	
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	117,000,000	119,487,420	
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	62,270,000	64,271,357	
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	65,758,000	67,680,763	
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	195,888,000	202,591,287	
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	201,678,000	209,426,468	
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	135,326,000	140,381,779	
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	66,134,000	68,481,757	
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	66,589,000	69,141,356	
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	246,585,000	248,989,203	
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	165,384,000	167,838,298	
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券	166,326,000	168,548,115	
貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券	83,221,000	84,392,751	
貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券	166,462,000	168,692,590	
貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券	83,931,000	84,737,576	
	84,377,000	85,345,647	

		貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券	85,681,000	86,822,270	
		貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券	343,024,000	346,653,193	
		貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券	258,840,000	261,728,654	
		貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券	172,916,000	174,722,972	
		貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券	175,562,000	177,842,550	
		貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券	179,550,000	181,000,764	
		貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券	89,693,000	90,412,337	
		貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券	90,245,000	91,348,696	
		貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券	91,117,000	91,824,067	
		貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券	277,443,000	278,330,817	
		貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券	278,754,000	279,788,177	
		貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券	476,660,000	473,618,909	
		貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券	192,672,000	193,367,545	
		貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券	194,518,000	194,702,792	
		貸付債権担保第164回住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,402,000	
	小計	銘柄数：317 組入時価比率：8.7%	59,075,831,000	62,040,417,231 8.8%	
	合計			62,040,417,231	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行(BFCM)第29回円貨社債	200,000,000	199,220,000	
		フランス相互信用連合銀行(BFCM)第31回円貨社債	100,000,000	99,563,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー第14回円貨社債	100,000,000	100,451,000	
		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	200,734,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー第6回円貨社債(2014)	100,000,000	102,402,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー第15回円貨社債(2018)	100,000,000	99,775,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー第16回円貨社債(2018)	100,000,000	99,938,000	
		スタンダード・チャータード第3回円貨社債(2015)	100,000,000	100,792,000	

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	100,886,000	
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	101,021,000	
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	100,492,000	
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	99,963,000	
サントナデル銀行 第1回円貨社債	100,000,000	100,039,000	
フランス電力 第4回円貨社債(2017)	100,000,000	102,735,000	
現代キャピタル・サービス・インク 第15回円貨社債	200,000,000	195,782,000	
ビー・エヌ・ピー・パリバ 第1回円貨社債(2017)	100,000,000	100,996,000	
ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第12回円貨社債	200,000,000	199,966,000	
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	200,470,000	
ソシエテ・ジェネラル 第1回非上位円貨社債(2017)	100,000,000	99,901,000	
長谷工コーポレーション 第14回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,920,000	
長谷工コーポレーション 第15回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,808,000	
大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,193,000	
日揮ホールディングス 第6回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,890,000	
味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,062,000	
日本たばこ産業 第13回	100,000,000	100,375,000	
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	98,972,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,390,000	
森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特約付	200,000,000	196,620,000	
森ビル 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,881,000	
セブン&アイ・ホールディングス 第13回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,016,000	
東レ 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,872,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,743,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,060,000	
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	100,728,000	
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,968,000	

三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,001,000	
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	99,715,000	
三菱ケミカルホールディングス 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,088,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,488,000	
電通 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,139,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,990,000	
オリエンタルランド 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,145,000	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,233,000	
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,867,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,645,000	
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,971,000	
日本特殊陶業 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,873,000	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	300,000,000	298,053,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順位	100,000,000	98,844,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第34回社債間限定同順位	100,000,000	100,117,000	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,220,000	
LIXILグループ 第11回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,871,000	
荏原製作所 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,028,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	216,734,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,369,000	
日本電産 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,600,000	
日本電気 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,683,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,298,000	
パナソニック 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,979,000	
パナソニック 第21回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,931,000	
ソニー 第32回	100,000,000	100,203,000	
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	99,563,000	

三菱重工業 第35回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,967,000	
J A三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,208,000	
三井住友トラスト・パナソニックファイナンス 第2回社債間限定	100,000,000	100,144,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	101,972,000	
楽天カード 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,311,000	
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	100,392,000	
ニコン 第22回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,005,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,883,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	207,804,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,744,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,447,000	
住友商事 第53回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,227,000	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,114,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,364,000	
クレディセゾン 第65回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,291,000	
イオン 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,825,000	
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	101,587,000	
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	99,959,000	
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	202,730,000	
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	114,748,000	
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	103,891,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	300,000,000	303,606,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	100,000,000	101,488,000	
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	105,085,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	300,000,000	306,057,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,523,000	
	100,000,000	101,450,000	

セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付			
セブン銀行 第12回社債間限定同順位特約付	300,000,000	303,180,000	
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	202,868,000	
みずほ銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	113,169,000	
芙蓉総合リース 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,316,000	
みずほリース 第3回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,946,000	
NTTファイナンス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,565,000	
NTTファイナンス 第15回日本電信電話保証付	300,000,000	300,024,000	
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	99,928,000	
トヨタファイナンス 第81回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,134,000	
リコーリース 第28回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,809,000	
アコム 第77回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,873,000	
ジャックス 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,094,000	
日立キャピタル 第61回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,328,000	
日立キャピタル 第80回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,233,000	
三井住友ファイナンス&リース 第27回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,889,000	
三菱UFJリース 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,709,000	
三菱UFJリース 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,206,000	
三菱UFJリース 第76回社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,399,000	
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	102,314,000	
三井不動産 第71回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,300,000	
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	101,379,000	
三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	99,621,000	
東京建物 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,214,000	
ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,959,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,354,000	
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	101,992,000	

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	114,956,000	
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	101,435,000	
東武鉄道 第124回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,598,000	
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	202,840,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,295,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,540,000	
東京急行電鉄 第83回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,474,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	215,072,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,838,000	
東日本旅客鉄道 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,690,000	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	200,000,000	234,358,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	116,080,000	
東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,176,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,090,000	
東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,000,000	
東日本旅客鉄道 第145回社債間限定同順位特約付	200,000,000	187,956,000	
西日本旅客鉄道 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,404,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	300,000,000	343,593,000	
西日本旅客鉄道 第66回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,374,000	
東海旅客鉄道 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	215,876,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	236,712,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,894,000	
東海旅客鉄道 第73回社債間限定同順位特約付	300,000,000	323,046,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	120,874,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	100,417,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	102,372,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	106,178,000	
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	201,834,000	

西日本鉄道 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,751,000	
阪急阪神ホールディングス 第47回	200,000,000	215,856,000	
阪急阪神ホールディングス 第49回	100,000,000	103,817,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,692,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,459,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,911,000	
日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,102,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,726,000	
九州旅客鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,054,000	
九州旅客鉄道 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,239,000	
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	91,410,000	
澁澤倉庫 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,388,000	
K D D I 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,884,000	
K D D I 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,385,000	
東京電力 第548回	100,000,000	110,768,000	
東京電力 第560回	100,000,000	109,549,000	
中部電力 第500回	200,000,000	205,324,000	
中部電力 第524回	100,000,000	101,265,000	
中部電力 第530回	200,000,000	200,314,000	
関西電力 第509回	100,000,000	101,323,000	
関西電力 第511回	100,000,000	100,890,000	
関西電力 第514回	200,000,000	200,518,000	
関西電力 第527回	200,000,000	200,992,000	
関西電力 第535回	200,000,000	200,000,000	
中国電力 第377回	200,000,000	205,576,000	
中国電力 第378回	100,000,000	102,618,000	
中国電力 第400回	100,000,000	100,830,000	
中国電力 第402回	300,000,000	301,599,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	102,428,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	104,726,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	102,418,000	
北陸電力 第326回	100,000,000	101,946,000	
東北電力 第475回	100,000,000	102,567,000	
東北電力 第481回	200,000,000	205,994,000	

東北電力 第484回	100,000,000	103,467,000	
東北電力 第491回	100,000,000	101,308,000	
東北電力 第521回	100,000,000	101,374,000	
四国電力 第281回	200,000,000	205,698,000	
九州電力 第424回	100,000,000	103,283,000	
九州電力 第428回	105,000,000	108,067,050	
九州電力 第449回	200,000,000	202,490,000	
九州電力 第451回	100,000,000	101,388,000	
九州電力 第476回	100,000,000	101,148,000	
九州電力 第484回	200,000,000	201,288,000	
北海道電力 第321回	100,000,000	102,899,000	
北海道電力 第323回	100,000,000	108,939,000	
北海道電力 第338回	100,000,000	103,560,000	
北海道電力 第345回	300,000,000	301,395,000	
電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,594,000	
電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,652,000	
電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,371,000	
電源開発 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,132,000	
電源開発 第59回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,014,000	
東京電力パワーグリッド 第2回	100,000,000	100,557,000	
東京電力パワーグリッド 第6回	100,000,000	101,801,000	
東京電力パワーグリッド 第11回	300,000,000	303,870,000	
東京電力パワーグリッド 第14回	100,000,000	100,661,000	
東京電力パワーグリッド 第28回	100,000,000	102,373,000	
東京電力パワーグリッド 第35回	100,000,000	103,740,000	
東京電力パワーグリッド 第38回	200,000,000	201,796,000	
東京電力パワーグリッド 第40回	400,000,000	417,156,000	
東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	126,661,000	
東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付	100,000,000	94,936,000	
大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,565,000	
東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,450,000	
北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,311,000	
北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,642,000	
広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,754,000	
東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,771,000	

		ファーストリテイリング 第7回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,765,000	
		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	100,481,000	
	小計	銘柄数：214 組入時価比率：4.2%	28,905,000,000	29,513,545,050	4.2%
	合計			29,513,545,050	
	合計			701,949,321,579	

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年12月28日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	127,687,802
コール・ローン	506,464,118
国債証券	78,168,813,111
派生商品評価勘定	118,519,276
未収利息	456,046,743
前払費用	30,519,836
差入委託証拠金	3,350,740
流動資産合計	79,411,401,626
資産合計	79,411,401,626
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	648,272,471
未払解約金	5,141,428
未払利息	255
その他未払費用	569,900
流動負債合計	653,984,054
負債合計	653,984,054
純資産の部	
元本等	
元本	62,722,104,478
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	16,035,313,094
元本等合計	78,757,417,572
純資産合計	78,757,417,572
負債純資産合計	79,411,401,626

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

	<p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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>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12月28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	1.2557円
(10,000口当たり純資産額)	(12,557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12月27日 至 2020年12月28日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>

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12月28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12月28日現在	
期首	2019年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	52,581,841,715円
同期中における追加設定元本額	23,934,355,164円
同期中における一部解約元本額	13,794,092,401円
期末元本額	62,722,104,478円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,344,589,432円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	963,974,995円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	24,252,068円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	6,611,439円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	4,110,235円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	2,112,999円
野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	10,737,609,558円
インデックス・ブレンド(タイプ)	11,498,652円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,465,394円
インデックス・ブレンド(タイプ)	12,888,839円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,709,038円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,115,551円

野村外国債券インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	28,440,659,386円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	7,411,060,000円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	4,270,979,658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)	887,744,117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)	2,544,964,502円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信(適格機関投資家専用)	6,047,758,615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12月28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12月28日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	70,000.00	81,260.15	
		US TREASURY BOND	500,000.00	539,042.95	
		US TREASURY BOND	610,000.00	783,921.49	
		US TREASURY BOND	1,800,000.00	2,471,484.42	
		US TREASURY BOND	2,280,000.00	3,095,278.06	
		US TREASURY BOND	20,000.00	26,956.25	
		US TREASURY BOND	80,000.00	108,475.00	
		US TREASURY BOND	510,000.00	643,277.33	
		US TREASURY BOND	3,450,000.00	4,955,331.94	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,524,550.80	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,015,234.40	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,019,179.70	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,025,117.20	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,013,867.20	
		US TREASURY N/B	600,000.00	612,890.64	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,528,886.70	
		US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,428,875.00	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,066,093.90	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,587,636.85	
		US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,479,156.42	
		US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,781,527.31	
		US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,254,140.68	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,050,390.60	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,089,531.40			
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,027,890.60			

US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,766,656.25	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,705,609.24	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,100,468.80	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,085,664.10	
US TREASURY N/B	700,000.00	721,464.87	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,000,000.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,548,339.90	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,896,578.16	
US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,210,636.66	
US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,350,576.50	
US TREASURY N/B	700,000.00	719,632.83	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,033,945.30	
US TREASURY N/B	700,000.00	732,867.17	
US TREASURY N/B	4,110,000.00	4,274,239.29	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,054,101.60	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,133,902.33	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,557,597.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	999,804.70	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,072,109.40	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,577,343.75	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,600,214.80	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,274,531.28	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,098,671.80	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,673,730.50	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,997,343.60	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,168,750.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,996,718.80	
US TREASURY N/B	700,000.00	729,339.87	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,074,882.80	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,173,085.90	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,777,402.30	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,125,312.60	
US TREASURY N/B	500,000.00	532,109.40	
US TREASURY N/B	400,000.00	432,265.64	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,125,468.80	
US TREASURY N/B	500,000.00	530,078.15	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,616,777.40	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,250,312.40	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,107,578.20	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,204,960.90	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,120,468.80	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,141,015.60	

US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,153,046.80
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,309,531.20
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,219,140.70
US TREASURY N/B	800,000.00	863,406.24
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,118,281.20
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,141,562.60
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,944,375.00
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,444,375.20
US TREASURY N/B	500,000.00	501,503.90
US TREASURY N/B	800,000.00	863,375.04
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,225,468.80
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,435,312.40
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,232,265.60
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,992,500.00
US TREASURY N/B	2,780,000.00	2,994,038.31
US TREASURY N/B	600,000.00	667,078.14
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,375,703.20
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,981,250.00
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,979,843.60
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,790,162.50
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,339,960.90
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,251,562.40
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,468,734.48
US TREASURY N/B	800,000.00	846,375.04
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,827,500.00
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,656,738.30
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,006,085.96
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,491,914.10
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,545,500.16
US TREASURY N/B	600,000.00	665,625.00
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,812,937.50
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,894,531.25
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,598,179.61
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,915,234.50
US TREASURY N/B	5,400,000.00	6,191,437.50
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,514,687.60
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,136,875.00
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,641,015.75
US TREASURY N/B	500,000.00	745,000.00
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,757,109.42
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,407,851.65
US TREASURY N/B	340,000.00	532,153.14
US TREASURY N/B	1,760,000.00	2,653,887.45

	US TREASURY N/B	400,000.00	542,312.52	
	US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,925,828.19	
	US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,788,699.19	
	US TREASURY N/B	340,000.00	486,465.64	
	US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,132,781.28	
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	2,249,765.70	
	US TREASURY N/B	300,000.00	478,500.00	
	US TREASURY N/B	500,000.00	652,265.65	
	US TREASURY N/B	500,000.00	617,890.65	
	US TREASURY N/B	800,000.00	1,047,125.04	
	US TREASURY N/B	700,000.00	988,750.00	
	US TREASURY N/B	500,000.00	645,468.75	
	US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,853,937.44	
	US TREASURY N/B	2,540,000.00	3,285,926.62	
	US TREASURY N/B	2,760,000.00	3,502,181.38	
	US TREASURY N/B	3,020,000.00	3,918,685.86	
	US TREASURY N/B	2,530,000.00	3,013,467.31	
	US TREASURY N/B	3,400,000.00	4,051,578.04	
	US TREASURY N/B	3,530,000.00	4,017,856.94	
	US TREASURY N/B	3,600,000.00	4,586,906.16	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,306,093.80	
	US TREASURY N/B	2,820,000.00	3,526,322.01	
	US TREASURY N/B	2,600,000.00	3,253,453.06	
	US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,748,210.99	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,338,437.50	
	US TREASURY N/B	400,000.00	524,562.52	
	US TREASURY N/B	500,000.00	643,359.40	
	US TREASURY N/B	600,000.00	684,187.50	
	US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,436,539.13	
	US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,608,375.00	
小計	銘柄数：140	291,650,000.00	321,491,605.39	
			(33,312,960,150)	
	組入時価比率：42.3%		42.5%	
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,007,640.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,032,370.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,030,620.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	156,898.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	637,272.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	1,139,542.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,036,430.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,056,300.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	485,888.70	

	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,031,700.00
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	441,684.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	1,446,013.20
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,132,460.00
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	944,958.00
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	643,236.00
	CANADIAN GOVERNMENT	780,000.00	1,191,918.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,740,000.00	2,358,065.40
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	237,688.00
小計	銘柄数：18	15,280,000.00	18,010,684.20 (1,451,841,253)
	組入時価比率：1.8%		1.9%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,800,000.00	2,875,565.84
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	15,457,474.50
	MEX BONOS DESARR FIX RT	11,000,000.00	13,193,510.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,000,000.00	14,655,900.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	20,100,000.00	22,905,156.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	11,779,900.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,100,000.00	3,673,345.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,000,000.00	8,464,320.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,200,000.00	12,735,720.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,300,000.00	5,123,106.00
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,300,000.00	10,230,372.00
小計	銘柄数：11	105,800,000.00	121,094,369.34 (630,901,664)
	組入時価比率：0.8%		0.8%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	529,387.50
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	760,835.95
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,288,776.00
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	615,137.88
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	256,618.36
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	313,549.80
	BELGIUM KINGDOM	2,100,000.00	2,287,911.57
	BELGIUM KINGDOM	950,000.00	1,035,880.00
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,037,193.00
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	329,870.91
	BELGIUM KINGDOM	1,400,000.00	1,559,098.10
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,366,192.80
	BELGIUM KINGDOM	550,000.00	818,659.60
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	247,606.60
	BELGIUM KINGDOM	420,000.00	556,130.82
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	544,896.30
	BELGIUM KINGDOM	750,000.00	1,372,714.50

BELGIUM KINGDOM	500,000.00	663,733.00
BELGIUM KINGDOM	400,000.00	550,956.00
BELGIUM KINGDOM	170,000.00	285,130.29
BELGIUM KINGDOM GOVT	370,000.00	643,635.01
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,490,000.00	1,595,730.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	304,132.56
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,400,000.00	3,464,698.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,013,370.84
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,100,000.00	2,128,112.49
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	307,077.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,940,000.00	2,216,417.02
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,920,000.00	2,201,665.92
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,577,599.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,039,547.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	872,990.08
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,237,228.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	720,000.00	811,116.72
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,098,200.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,115,610.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	855,849.12
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	334,777.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,300,000.00	2,569,350.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,600,000.00	1,790,984.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	330,000.00	467,477.01
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	1,359,321.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,183,710.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	668,917.26
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	1,888,507.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	483,032.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	552,449.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,787,914.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,773,412.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,150,000.00	1,718,664.65
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	879,338.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	618,944.10
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,013,096.00
BUNDES OblIGATION	1,100,000.00	1,123,818.41
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,025,038.00
BUNDES OblIGATION	1,500,000.00	1,547,488.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	873,701.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,349,205.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,310,000.00	1,381,117.28
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	751,498.30

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	485,761.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	658,540.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	754,049.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	468,443.36
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,052,344.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000.00	2,163,544.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	958,027.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	312,405.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,270,000.00	2,406,045.64
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,300,000.00	3,411,725.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	918,681.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,085,880.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,421,450.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	421,191.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,581,645.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,370,156.84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,791,986.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	1,213,234.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	527,485.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	2,422,602.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,310,000.00	2,469,537.33
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	60,000.00	121,942.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	1,346,707.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	2,177,871.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	1,049,994.95
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,200,000.00	1,687,707.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	941,680.80
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,026,020.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	714,748.30
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,030,000.00	1,053,988.70
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,533,939.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	510,727.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,962,283.52
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	221,774.40
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,816,417.80
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000.00	2,162,361.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,150,000.00	1,282,344.30
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000.00	2,694,119.25
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,027,704.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	228,088.44
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,534,070.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,716,862.50

BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	744,552.90
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000.00	2,760,930.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,041,403.80
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,350,000.00	1,640,825.10
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	533,968.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	856,500.16
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,087,075.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	363,195.03
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,232,150.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	596,616.90
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,174,779.76
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,200,000.00	3,612,793.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	569,322.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	897,320.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,040,000.00	2,720,568.48
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,417,421.20
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	508,310.24
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	323,532.99
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000.00	2,603,280.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	552,800.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	1,078,460.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	552,979.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,579,380.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,070,000.00	1,283,952.92
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,110,000.00	1,702,182.78
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	593,135.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,580,000.00	2,274,994.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	520,083.20
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	248,106.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	501,090.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	882,075.20
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,480,000.00	4,219,791.42
BUONI POLIENNALI DEL TES	860,000.00	1,213,407.54
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	387,468.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	1,173,228.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	944,997.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000.00	13,348.80
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	302,730.00
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	312,302.10
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	157,820.01
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	218,341.00
FINNISH GOVERNMENT	310,000.00	329,710.11
FINNISH GOVERNMENT	740,000.00	928,378.10

FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	311,386.50
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	236,609.60
FINNISH GOVERNMENT	160,000.00	254,415.20
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	273,818.58
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,522,297.50
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	317,706.60
FRANCE (GOVT OF)	2,800,000.00	2,862,749.68
FRANCE (GOVT OF)	2,010,000.00	2,213,373.81
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,054,688.80
FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	420,248.16
FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	742,251.30
FRANCE (GOVT OF)	250,000.00	262,381.25
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	880,947.20
FRANCE (GOVT OF)	2,300,000.00	2,515,142.00
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,097,380.00
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,079,527.00
FRANCE (GOVT OF)	4,000,000.00	4,138,260.00
FRANCE (GOVT OF)	1,720,000.00	2,191,156.16
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,547,017.65
FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	1,424,157.60
FRANCE (GOVT OF)	1,850,000.00	2,218,692.05
FRANCE (GOVT OF)	960,000.00	1,263,401.28
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	858,797.12
FRANCE (GOVT OF)	1,010,000.00	1,464,723.21
FRANCE (GOVT OF)	1,300,000.00	1,722,913.40
FRANCE (GOVT OF)	1,900,000.00	2,102,916.58
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,320,000.00	1,385,044.32
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	900,000.00	908,982.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	610,000.00	643,005.27
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,800,000.00	2,054,944.80
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000.00	657,654.60
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,100,000.00	1,459,397.50
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,081,043.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	4,121,492.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	910,000.00	1,112,757.10
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,900,000.00	2,333,864.62
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,200,000.00	1,808,572.80
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	640,000.00	761,587.20
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	516,525.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,490,000.00	2,547,304.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	686,562.80
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	720,000.00	1,359,424.80

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,800,000.00	3,091,111.20
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000.00	1,371,007.20
IRISH GOVERNMENT	800,000.00	880,191.20
IRISH TSY 0.2% 2030	1,100,000.00	1,151,415.32
IRISH TSY 1.5% 2050	200,000.00	264,740.00
IRISH TSY 1.7% 2037	550,000.00	701,741.70
IRISH TSY 1% 2026	650,000.00	705,081.00
IRISH TSY 2% 2045	250,000.00	355,905.00
IRISH TSY 2022	1,000,000.00	1,012,435.50
IRISH TSY 3.4% 2024	500,000.00	565,800.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	503,732.50
NETHERLANDS GOVERNMENT	630,000.00	688,120.65
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	351,105.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	319,140.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,097,714.40
NETHERLANDS GOVERNMENT	700,000.00	730,594.20
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	426,024.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	863,500.44
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,045,667.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,150,000.00	1,561,652.16
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	685,314.40
NETHERLANDS GOVERNMENT	610,000.00	1,137,609.13
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,050,000.00	1,873,662.00
REPUBLIC OF AUSTRIA	10,000.00	16,817.77
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	845,520.00
REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	708,432.20
REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	128,349.60
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,636,734.45
REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	324,388.80
REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	428,520.00
REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	765,963.80
REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	726,414.50
REPUBLIC OF AUSTRIA	530,000.00	721,022.60
REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	392,966.96
REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	701,091.80
REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	275,728.00
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	952,667.20
REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	802,908.48
REPUBLIC OF IRELAND	80,000.00	88,188.46
SPANISH GOVERNMENT	90,000.00	134,733.06
SPANISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,804,965.80
SPANISH GOVERNMENT	410,000.00	651,236.21

小計	銘柄数 : 229 組入時価比率 : 42.2%	218,780,000.00	263,311,459.76 (33,266,769,826) 42.6%
英ポンド	UK TREASURY	320,000.00	335,778.81
	UK TREASURY	400,000.00	404,019.52
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,238,391.84
	UK TREASURY	600,000.00	602,141.76
	UK TREASURY	900,000.00	919,505.34
	UK TREASURY	550,000.00	584,610.62
	UK TREASURY	500,000.00	517,911.80
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,324,917.60
	UK TREASURY	900,000.00	927,114.12
	UK TREASURY	1,370,000.00	1,486,265.32
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,077,612.00
	UK TREASURY	300,000.00	387,090.60
	UK TREASURY	900,000.00	1,005,824.88
	UK TREASURY	90,000.00	131,518.74
	UK TREASURY	1,400,000.00	1,482,123.44
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,010,148.00
	UK TREASURY	600,000.00	864,726.00
	UK TREASURY	600,000.00	861,783.96
	UK TREASURY	200,000.00	306,635.60
	UK TREASURY	1,160,000.00	1,782,114.96
	UK TREASURY	670,000.00	786,062.76
	UK TREASURY	400,000.00	650,776.96
	UK TREASURY	700,000.00	765,353.40
	UK TREASURY	850,000.00	1,492,353.50
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,589,480.80
	UK TREASURY	2,180,000.00	3,931,636.10
	UK TREASURY	1,700,000.00	1,976,103.80
	UK TREASURY	1,350,000.00	1,667,387.70
	UK TREASURY	1,140,000.00	2,152,662.91
	UK TREASURY	860,000.00	1,568,979.01
	UK TREASURY	500,000.00	622,392.10
	UK TREASURY	200,000.00	420,972.16
	UK TREASURY	380,000.00	807,210.74
	UK TSY 0 5/8% 2050	400,000.00	378,914.24
	UK TSY 3 1/4% 2044	100,000.00	151,722.60
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	580,000.00	1,197,606.15
小計	銘柄数 : 36 組入時価比率 : 6.7%	28,200,000.00	37,409,849.84 (5,244,486,849) 6.7%
	SWEDISH GOVERNMENT	3,500,000.00	3,694,899.25

スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	3,000,000.00	3,164,568.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	250,000.00	281,265.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,700,000.00	2,899,825.65	
	SWEDISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,271,781.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,600,000.00	2,506,245.60	
	小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.3%	15,050,000.00	16,818,584.70 (210,736,866) 0.3%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,975,883.15	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,750,000.00	2,974,482.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,771,991.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,750,000.00	1,855,387.10	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,623,150.00	
	小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.2%	11,600,000.00	12,276,484.35 (147,317,812) 0.2%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,650,000.00	1,752,279.87	
	KINGDOM OF DENMARK	3,400,000.00	3,789,060.98	
	KINGDOM OF DENMARK	2,300,000.00	2,462,989.50	
	KINGDOM OF DENMARK	6,400,000.00	6,972,160.00	
	KINGDOM OF DENMARK	4,900,000.00	9,352,751.52	
	小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.5%	18,650,000.00	24,329,241.87 (413,353,819) 0.5%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,177,387.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,047,393.10	
	POLAND GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,889,658.70	
	小計	銘柄数：3 組入時価比率：0.6%	16,000,000.00	17,114,439.40 (478,862,014) 0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,223,147.16	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	120,000.00	130,575.79	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,249,208.28	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	899,371.04	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,087,193.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,002,073.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,340,000.00	1,511,465.32	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	625,129.12	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	820,000.00	1,033,793.27	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	1,028,828.52	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,820,000.00	3,134,546.46	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,958,525.12	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,195,473.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	927,306.64	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,824,611.84	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,199,991.96	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,014,557.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,170,000.00	1,620,054.54	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	354,951.27	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	199,343.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	1,283,905.41	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,289,297.24	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	270,000.00	330,889.02	
小計	銘柄数：23	23,030,000.00	26,124,238.70	
			(2,055,716,343)	
	組入時価比率：2.6%		2.6%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,485,740.06	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	438,747.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	434,606.12	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	757,878.10	
	SINGAPORE GOVERNMENT	730,000.00	855,270.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	339,700.23	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	468,013.56	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,210,000.00	1,438,938.05	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	815,073.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	838,092.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	664,512.25	
小計	銘柄数：11	7,440,000.00	8,536,572.07	
			(665,767,255)	
	組入時価比率：0.8%		0.9%	
新シエケル	ISRAEL FIXED BOND	1,500,000.00	1,556,473.95	
	ISRAEL FIXED BOND	1,500,000.00	1,671,382.20	
	ISRAEL FIXED BOND	2,000,000.00	2,191,791.80	
	ISRAEL FIXED BOND	1,000,000.00	1,019,247.90	
	ISRAEL FIXED BOND	1,100,000.00	1,879,594.86	
	ISRAEL FIXED BOND	500,000.00	696,402.40	
小計	銘柄数：6	7,600,000.00	9,014,893.11	
			(290,099,260)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
合計			78,168,813,111	
			(78,168,813,111)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年12月28日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	78,286,468,596	-	78,816,221,791	529,753,195
米ドル	33,738,446,596	-	33,619,927,320	118,519,276
カナダドル	1,451,637,320	-	1,463,131,800	11,494,480
メキシコペソ	600,730,888	-	605,477,600	4,746,712
ユーロ	33,014,345,634	-	33,502,207,900	487,862,266
英ポンド	5,226,245,424	-	5,290,462,182	64,216,758
スウェーデンクローナ	204,077,455	-	209,075,580	4,998,125
ノルウェークローネ	139,958,140	-	142,788,910	2,830,770
デンマーククローネ	416,658,963	-	423,649,048	6,990,085
ズロチ	481,347,384	-	486,174,540	4,827,156
豪ドル	2,039,220,155	-	2,087,695,120	48,474,965
シンガポールドル	676,913,287	-	679,921,791	3,008,504
新シェケル	296,887,350	-	305,710,000	8,822,650
合計	78,286,468,596	-	78,816,221,791	529,753,195

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年12月28日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	100,416,679
コール・ローン	377,114,628
国債証券	574,671,483,436
未収入金	823,835,831
未収利息	5,228,202,299
前払費用	367,329,004
その他未収収益	11,508,725
流動資産合計	581,579,890,602
資産合計	581,579,890,602

(2020年12月28日現在)

負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,400
未払金	82,455,615
未払解約金	335,613,448
未払利息	189
その他未払費用	5,942,773
流動負債合計	424,032,425
負債合計	424,032,425
純資産の部	
元本等	
元本	234,759,829,540
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	346,396,028,637
元本等合計	581,155,858,177
純資産合計	581,155,858,177
負債純資産合計	581,579,890,602

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年12月28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	2.4755円
(10,000口当たり純資産額)	(24,755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	
	176,797,160,132円
なお、上記の金額は利込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

185,459,183,144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12月27日

至 2020年12月28日

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年12月28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12月28日現在		2019年12月27日
期首		2019年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額		260,083,815,731円
同期中における追加設定元本額		33,772,848,724円
同期中における一部解約元本額		59,096,834,915円
期末元本額		234,759,829,540円
期末元本額の内訳*		
バランスセレクト30		80,345,102円
バランスセレクト50		80,463,454円
バランスセレクト70		69,972,480円
野村外国債券インデックスファンド		290,986,810円
野村世界6資産分散投信（安定コース）		3,678,330,069円
野村世界6資産分散投信（分配コース）		23,421,738,712円
野村世界6資産分散投信（成長コース）		1,594,611,284円
野村資産設計ファンド2015		20,162,182円
野村資産設計ファンド2020		20,398,113円
野村資産設計ファンド2025		37,513,134円
野村資産設計ファンド2030		36,981,704円
野村資産設計ファンド2035		26,284,285円
野村資産設計ファンド2040		46,155,773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）		87,939,092,055円
のむらップ・ファンド（保守型）		5,571,992,169円
のむらップ・ファンド（普通型）		12,525,619,555円
のむらップ・ファンド（積極型）		2,622,691,405円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）		572,302,713円
野村資産設計ファンド2045		5,821,983円
野村インデックスファンド・外国債券		822,473,266円
マイ・ロード		8,846,703,055円
ネクストコア		271,000,887円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		171,228,494円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）		8,238,813,567円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）		816,124,673円
野村資産設計ファンド2050		7,624,442円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		4,799,101円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		1,950,726円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		1,455,286円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		904,435円
のむらップ・ファンド（やや保守型）		566,174,217円
のむらップ・ファンド（やや積極型）		427,049,796円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		1,947,924円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		1,296,281円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		5,240,755円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		1,376,992円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		3,686,642円
野村6資産均等バランス		1,187,560,307円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）		6,560,447,437円
世界6資産分散ファンド		63,633,603円

野村資産設計ファンド2060	2,345,781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	3,468,293,590円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	1,811,883,462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)	8,167,486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)	1,283,039,396円
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	237,242,239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)	1,448,594,457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)	1,229,243,900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)	2,642,912円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	9,433,082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)	250,657円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,212,408,491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)	12,869,156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)	69,537,280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)	14,591,771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)	165,602,856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)	173,908,685円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	1,824,151,489円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	96,070,290円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,272,450,725円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	974,844,009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)	4,905,689円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,718,216円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	6,587,415円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	5,569,065円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	589,429,945円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,215,503,409円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	6,074,542,935円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	4,422,456,259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)	17,456,485,225円
マイバランスDC30	1,809,116,961円
マイバランスDC50	1,303,867,248円
マイバランスDC70	835,691,173円
野村DC外国債券インデックスファンド	6,778,863,447円
野村DC運用戦略ファンド	4,883,628,753円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	554,785,285円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	181,807,415円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	287,659,085円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	138,882,195円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	11,902,366円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	29,287,635円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	11,828,961円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	5,360,201円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	3,451,517円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	1,988,371円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	75,446,143円

マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	51,358,953円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	24,486,425円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	29,932,313円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	760,353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12月28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12月28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	38,800,000.00	45,041,344.72	
		US TREASURY BOND	45,100,000.00	48,621,674.09	
		US TREASURY BOND	73,500,000.00	94,456,114.20	
		US TREASURY BOND	12,000,000.00	16,476,562.80	
		US TREASURY BOND	46,200,000.00	62,720,108.22	
		US TREASURY BOND	48,000,000.00	64,695,000.00	
		US TREASURY BOND	28,200,000.00	38,237,437.50	
		US TREASURY BOND	100,000.00	148,414.06	
		US TREASURY BOND	500,000.00	630,664.05	
		US TREASURY BOND	4,700,000.00	6,750,742.07	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,016,367.20	
		US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,639,609.44	
		US TREASURY N/B	8,100,000.00	8,264,847.96	
		US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,828,503.99	
		US TREASURY N/B	81,500,000.00	83,547,051.80	
		US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,380,742.32	
		US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,271,250.00	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,331,894.56	
		US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,504,688.32	
		US TREASURY N/B	100,000.00	102,714.84	

US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,930,953.04	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,572,460.85	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,980,437.50	
US TREASURY N/B	500,000.00	511,093.75	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,336,054.72	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,522,626.64	
US TREASURY N/B	26,200,000.00	26,818,157.56	
US TREASURY N/B	8,300,000.00	8,487,398.23	
US TREASURY N/B	200,000.00	205,007.82	
US TREASURY N/B	900,000.00	920,953.17	
US TREASURY N/B	33,400,000.00	34,194,555.94	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,234,456.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,460.94	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,984.38	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,027,890.60	
US TREASURY N/B	900,000.00	922,218.75	
US TREASURY N/B	32,400,000.00	33,350,483.16	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,511.72	
US TREASURY N/B	900,000.00	925,699.23	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,649,062.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,222.66	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,551,738.30	
US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,300,242.01	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,605.47	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,801,562.00	
US TREASURY N/B	49,700,000.00	51,387,081.41	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,695.31	
US TREASURY N/B	400,000.00	415,984.36	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,594,532.00	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	15,073,652.88	
US TREASURY N/B	400,000.00	412,328.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	105,335.94	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,522,657.00	
US TREASURY N/B	34,800,000.00	36,136,264.32	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,531,703.24	

US TREASURY N/B	9,100,000.00	9,675,148.21	
US TREASURY N/B	100,000.00	106,222.66	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,423,121.04	
US TREASURY N/B	47,100,000.00	50,282,928.51	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,903,711.10	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,258,507.54	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,069,492.20	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	36,388,000.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,074,882.80	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	11,044,289.46	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,077,109.40	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	45,790,007.28	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,730,796.76	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	31,622,253.54	
US TREASURY N/B	43,000,000.00	45,694,220.90	
US TREASURY N/B	800,000.00	859,062.48	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,393,285.14	
US TREASURY N/B	800,000.00	864,531.28	
US TREASURY N/B	400,000.00	427,718.76	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,806,648.48	
US TREASURY N/B	20,900,000.00	22,527,098.44	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,807,632.37	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,059,617.14	
US TREASURY N/B	300,000.00	318,070.32	
US TREASURY N/B	42,700,000.00	45,710,683.06	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,583,656.16	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	36,846,491.76	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,468,007.87	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	18,096,203.97	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	2,094,527.32	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	35,929,125.00	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	38,332,736.10	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	8,687,711.34	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,546,195.21	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,803,890.56	

US TREASURY N/B	27,000,000.00	29,078,789.40	
US TREASURY N/B	700,000.00	778,257.83	
US TREASURY N/B	29,200,000.00	32,856,844.48	
US TREASURY N/B	100,000.00	112,699.22	
US TREASURY N/B	50,600,000.00	55,233,062.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	11,225,391.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	11,118,750.00	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	16,699,804.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,125,781.20	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	9,491,242.08	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,915,171.92	
US TREASURY N/B	300,000.00	327,304.68	
US TREASURY N/B	21,100,000.00	22,323,141.68	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,611,719.20	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,652,734.00	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,966,843.68	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	14,137,500.00	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	31,973,439.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	107,378.91	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,480,761.86	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,937,577.70	
US TREASURY N/B	38,000,000.00	42,350,703.60	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	9,639,328.56	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,109,375.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	572,968.75	
US TREASURY N/B	30,600,000.00	35,429,062.50	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	11,490,960.69	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,419,656.28	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,267,179.74	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,795,890.71	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	3,874,000.00	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	16,204,453.54	
US TREASURY N/B	36,900,000.00	53,006,274.36	
US TREASURY N/B	15,100,000.00	22,125,039.44	
US TREASURY N/B	200,000.00	313,031.26	

US TREASURY N/B	100,000.00	150,789.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	135,578.13	
US TREASURY N/B	100,000.00	148,140.63	
US TREASURY N/B	100,000.00	152,734.38	
US TREASURY N/B	100,000.00	150,945.31	
US TREASURY N/B	100,000.00	155,539.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	151,515.63	
US TREASURY N/B	200,000.00	286,156.26	
US TREASURY N/B	100,000.00	149,984.38	
US TREASURY N/B	100,000.00	159,500.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	152,976.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	141,804.69	
US TREASURY N/B	300,000.00	391,359.39	
US TREASURY N/B	100,000.00	130,796.88	
US TREASURY N/B	100,000.00	128,343.75	
US TREASURY N/B	200,000.00	247,343.76	
US TREASURY N/B	600,000.00	741,468.78	
US TREASURY N/B	290,000.00	379,582.82	
US TREASURY N/B	100,000.00	140,945.31	
US TREASURY N/B	13,700,000.00	19,351,250.00	
US TREASURY N/B	15,200,000.00	20,739,687.12	
US TREASURY N/B	25,000,000.00	32,890,625.00	
US TREASURY N/B	37,100,000.00	47,893,781.25	
US TREASURY N/B	39,900,000.00	47,446,709.94	
US TREASURY N/B	23,400,000.00	30,271,922.46	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	22,205,860.25	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,801,038.97	
US TREASURY N/B	51,500,000.00	61,341,330.70	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	33,604,264.92	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	39,268,006.95	
US TREASURY N/B	14,200,000.00	18,092,796.52	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,608,281.20	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,220,359.46	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	14,255,344.32	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	11,637,351.33	

	US TREASURY N/B	9,500,000.00	12,432,383.05	
	US TREASURY N/B	5,100,000.00	6,826,031.25	
	US TREASURY N/B	10,500,000.00	13,769,766.15	
	US TREASURY N/B	2,470,000.00	3,247,471.03	
	US TREASURY N/B	100,000.00	128,671.88	
	US TREASURY N/B	11,250,000.00	12,828,515.62	
	US TREASURY N/B	300,000.00	351,117.18	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,081,562.50	
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,985,328.18	
	US TREASURY N/B	9,100,000.00	8,477,218.75	
	US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,585,875.04	
小計	銘柄数：171	2,105,360,000.00	2,385,201,563.76	
			(247,154,586,036)	
	組入時価比率：42.5%		43.1%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	18,650,000.00	19,335,387.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	301,146.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	300,267.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	12,000,000.00	12,164,400.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	309,711.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,460,000.00	4,596,565.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,150,589.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	531,060.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	7,310,272.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	17,000,000.00	17,619,310.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	4,004,436.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	316,890.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	9,865,013.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	206,340.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	110,421.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	11,380,000.00	16,132,970.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,132,460.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	16,064,286.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	6,110,742.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,800,000.00	7,334,880.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	14,876,941.50	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,761,773.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	475,376.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	150,493.00	
	銘柄数：24 組入時価比率：2.0%	115,340,000.00	142,161,730.00 (11,459,657,055) 2.0%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	92,900,000.00	95,407,166.62	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,400,000.00	45,754,124.52	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	315,204.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	87,300,000.00	97,881,633.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	47,976,400.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	51,300,000.00	53,703,405.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	112,300,000.00	127,972,588.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	45,300,000.00	55,374,267.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,100,000.00	80,221,119.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	11,849,500.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,300,000.00	79,423,536.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,800,000.00	32,213,880.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	52,200,000.00	60,625,080.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	51,231,060.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	122,700,000.00	134,974,908.00	
小計	銘柄数：15 組入時価比率：0.9%	851,900,000.00	974,923,871.14 (5,079,353,368) 0.9%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	847,020.00	
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	652,145.10	
	BELGIUM KINGDOM	8,200,000.00	8,806,636.00	
	BELGIUM KINGDOM	2,900,000.00	2,973,166.42	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,462,928.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,045,166.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,811,756.81	
	BELGIUM KINGDOM	6,700,000.00	8,531,599.10	
	BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,595,289.61	
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,180,800.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,099,569.70	
	BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	7,238,669.75	

BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	5,920,168.80
BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	4,614,263.20
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	118,383.20
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	619,016.50
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	132,412.10
BELGIUM KINGDOM	1,600,000.00	2,906,113.60
BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	7,321,144.00
BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,902,823.20
BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	4,269,909.00
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,944,318.00
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,677,237.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	16,625,366.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	19,135,095.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,450,000.00	15,475,372.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,650,000.00	4,714,054.68
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,700,000.00	5,808,465.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	17,002,110.76
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,299,078.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	6,055,159.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,600,000.00	17,042,171.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,900,000.00	7,912,236.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	507,085.65
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	982,113.84
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	18,682,148.84
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,632,830.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,506,204.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	30,339,747.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,600,000.00	8,481,037.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,234,218.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,596,825.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	13,174,352.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,367,421.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	6,798,627.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,207,581.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	2,705,803.50

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,700,000.00	10,191,109.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,000,000.00	19,704,580.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	4,782,371.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,800,000.00	12,896,963.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	5,419,841.70	
BUNDES OblIGATION	750,000.00	759,822.00	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,017,440.00	
BUNDES OblIGATION	2,000,000.00	2,057,035.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	415,140.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	311,471.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	408,909.15	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,300,000.00	8,750,590.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,580,000.00	2,769,808.02	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	23,900,000.00	29,024,255.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,835,277.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,800,000.00	11,633,911.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000.00	8,623,616.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,841,328.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,844,125.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,800,000.00	22,141,080.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,041,350.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	741,952.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	29,963,851.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	216,160.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,200,000.00	26,520,057.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	651,528.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	10,376,585.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,600,000.00	30,515,550.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,400,000.00	10,426,105.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,400,000.00	16,292,004.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,200,000.00	22,841,676.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,800,000.00	7,163,543.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	10,771,607.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,130,000.00	2,029,039.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	9,716,658.80	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,600,000.00	19,967,117.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,850,000.00	16,666,108.99	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	200,000.00	201,696.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,600,000.00	2,667,652.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,500,000.00	14,372,761.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,200,000.00	10,414,903.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,944,251.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	408,581.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,200,000.00	9,015,804.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,201,620.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES	31,800,000.00	35,262,129.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,917,329.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	102,969.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,226,590.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	567,190.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	23,695,854.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,700,000.00	16,932,195.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	321,162.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,638,535.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,999,140.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,104,372.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	20,419,156.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	854,348.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,211,875.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,871,206.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,301,773.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,900,000.00	14,662,585.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,225,038.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,100,000.00	25,656,098.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	22,500,000.00	32,024,362.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	7,734,949.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000.00	42,380,893.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,000,000.00	24,650,528.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	552,979.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	17,215,242.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,679,938.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,900,000.00	27,449,614.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	10,620,376.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	3,887,649.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	650,104.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	8,270,220.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	266,197.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,900,000.00	16,535,970.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	14,973,453.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	7,760,164.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	4,106,298.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	11,024,972.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,000,000.00	13,688,785.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,936,736.00	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	504,550.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	104,100.70	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,213.34	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	408,186.40	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	764,193.50	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,379,995.08	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	107,547.20	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,127,162.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,140,064.50	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,605,320.00	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	894,770.40	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	236,609.60	
FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,171,320.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	636,038.00	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	410,727.87	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	504,012.25	
FRANCE (GOVT OF)	4,200,000.00	4,262,433.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,600,000.00	2,641,123.68	
FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,662,664.54	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	102,241.06	
FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	11,121,928.10	

FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,849,219.92	
FRANCE (GOVT OF)	11,000,000.00	11,556,824.40	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,908,646.20	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,958,682.50	
FRANCE (GOVT OF)	7,700,000.00	8,479,116.80	
FRANCE (GOVT OF)	4,300,000.00	4,702,222.00	
FRANCE (GOVT OF)	11,600,000.00	12,729,608.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,159,054.00	
FRANCE (GOVT OF)	8,500,000.00	10,828,388.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	11,986,659.80	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	119,929.30	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	131,604.30	
FRANCE (GOVT OF)	10,400,000.00	15,082,298.40	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,650,636.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	553,399.10	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	700,000.00	734,493.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	700,000.00	706,986.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	23,700,000.00	24,982,335.90	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,900,000.00	13,239,377.62	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	25,600,000.00	29,225,881.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,288,273.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	12,603,887.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,486,258.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000.00	41,697,821.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,400,000.00	4,176,389.32	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	40,692,888.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,500,000.00	16,064,730.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,400,000.00	35,123,700.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,500,000.00	24,789,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	514,922.10	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,900,000.00	11,139,731.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,550,000.00	49,028,458.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,800,000.00	12,511,145.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,400,000.00	14,624,076.80	
IRISH GOVERNMENT	4,630,000.00	5,815,524.00	

IRISH GOVERNMENT	6,500,000.00	7,151,553.50	
IRISH TSY 0.8% 2022	1,200,000.00	1,221,608.28	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	675,645.00	
IRISH TSY 1.3% 2033	3,200,000.00	3,782,640.00	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,335,810.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	1,500,000.00	1,985,550.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	3,100,000.00	3,955,271.40	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,989,804.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	5,500,000.00	6,929,466.50	
IRISH TSY 2% 2045	1,600,000.00	2,277,792.00	
IRISH TSY 2022	8,200,000.00	8,301,971.10	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,100,000.00	6,902,760.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	604,479.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	104,629.52	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	218,451.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,500,000.00	4,096,225.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	425,520.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	102,196.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,700,000.00	8,452,400.88	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,565,559.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	2,023,614.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,728,453.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	17,701,759.02	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,102,069.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,400,000.00	2,563,038.24	
NETHERLANDS GOVERNMENT	8,900,000.00	12,085,829.76	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,700,000.00	6,339,158.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	573,032.45	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	2,797,399.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,900,000.00	12,312,636.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,767,061.84	
REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	101,204.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	215,688.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	915,850.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	160,437.00	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,331,474.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	763,809.41	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,419,437.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	6,985,391.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,162,592.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	11,082,282.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	9,600,000.00	10,377,235.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6,800,000.00	9,250,856.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	683,420.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	5,608,734.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,100,000.00	9,788,344.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,381,668.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	450,000.00	1,094,875.20	
	REPUBLIC OF IRELAND	4,450,000.00	4,905,483.31	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,952,544.00	
	SPANISH GOVERNMENT	27,800,000.00	45,616,408.40	
	SPANISH GOVERNMENT	2,500,000.00	3,970,952.50	
小計	銘柄数：239	1,417,750,000.00	1,888,766,112.20 (238,626,710,615)	
	組入時価比率：41.1%		41.5%	
英ポンド	UK TREASURY	5,150,000.00	5,403,940.32	
	UK TREASURY	400,000.00	412,797.28	
	UK TREASURY	1,400,000.00	1,404,997.44	
	UK TREASURY	15,800,000.00	16,142,427.08	
	UK TREASURY	2,300,000.00	2,444,735.32	
	UK TREASURY	1,600,000.00	1,657,317.76	
	UK TREASURY	7,450,000.00	8,225,530.10	
	UK TREASURY	13,450,000.00	16,316,248.80	
	UK TREASURY	200,000.00	206,025.36	
	UK TREASURY	200,000.00	219,406.00	
	UK TREASURY	160,000.00	173,578.43	
	UK TREASURY	400,000.00	431,044.80	
	UK TREASURY	12,130,000.00	15,651,363.26	
	UK TREASURY	200,000.00	223,516.64	
	UK TREASURY	7,900,000.00	11,544,423.26	

	UK TREASURY	6,000,000.00	8,647,260.00	
	UK TREASURY	5,550,000.00	7,971,501.63	
	UK TREASURY	12,300,000.00	18,858,089.40	
	UK TREASURY	2,350,000.00	3,610,319.10	
	UK TREASURY	100,000.00	169,745.80	
	UK TREASURY	600,000.00	976,165.44	
	UK TREASURY	500,000.00	828,028.30	
	UK TREASURY	400,000.00	437,344.80	
	UK TREASURY	570,000.00	1,000,754.70	
	UK TREASURY	18,440,000.00	29,310,025.95	
	UK TREASURY	6,300,000.00	11,362,067.64	
	UK TREASURY	8,200,000.00	9,531,794.80	
	UK TREASURY	16,100,000.00	19,885,142.20	
	UK TREASURY	5,350,000.00	10,102,409.28	
	UK TREASURY	6,750,000.00	12,314,660.85	
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,244,784.20	
	UK TREASURY	700,000.00	922,255.46	
	UK TREASURY	750,000.00	1,578,645.60	
	UK TREASURY	100,000.00	167,583.26	
	UK TREASURY	200,000.00	424,847.76	
	UK TSY 3 1/4% 2044	27,450,000.00	41,647,853.70	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	7,500,000.00	15,486,286.50	
小計	銘柄数：37	195,950,000.00	276,934,918.22 (38,823,506,185)	
	組入時価比率：6.7%		6.8%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	36,050,000.00	38,057,462.27	
	SWEDISH GOVERNMENT	7,900,000.00	8,333,362.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	29,350,000.00	33,020,511.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,888,114.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,800,000.00	17,941,481.04	
	SWEDISH GOVERNMENT	18,900,000.00	20,343,487.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	13,100,000.00	20,519,885.85	
小計	銘柄数：7	134,100,000.00	151,104,304.06 (1,893,336,929)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ノルウェークロー	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,300,000.00	10,711,366.55	

ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	37,800,000.00	40,885,614.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,931,898.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,899,035.60
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,178,123.52
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,791,120.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	22,000,000.00	23,524,490.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,802,046.50
	小計	銘柄数：8 組入時価比率：0.2%	99,000,000.00
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	400,000.00	406,489.64
	KINGDOM OF DENMARK	27,770,000.00	29,491,401.20
	KINGDOM OF DENMARK	29,300,000.00	32,652,790.21
	KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	16,812,580.50
	KINGDOM OF DENMARK	26,300,000.00	28,651,220.00
	KINGDOM OF DENMARK	35,800,000.00	68,332,347.84
	小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.5%	135,270,000.00
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	38,300,000.00	39,432,324.18
	POLAND GOVERNMENT BOND	33,100,000.00	35,527,865.14
	POLAND GOVERNMENT BOND	48,300,000.00	54,438,645.03
	小計	銘柄数：3 組入時価比率：0.6%	119,700,000.00
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,400,000.00	6,523,451.52
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,340,000.00	14,515,675.54
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	80,000.00	83,280.55
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	7,532,232.46
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,827,791.04
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	15,200,000.00	17,144,979.84
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	15,363,750.49
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,100,000.00	15,254,754.35
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,658,056.96
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	14,000,000.00	15,561,578.20
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,419,354.56

小計	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	12,074,278.31	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	15,416,472.89	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	22,200,000.00	25,316,489.28	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,699,961.81	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	10,661,897.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,538,122.17	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,250,000.00	13,621,778.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	881,111.56	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	468,835.36	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	6,495,228.97	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,837,611.50	
	銘柄数：22	173,050,000.00	200,896,693.26 (15,808,560,792)	
	組入時価比率：2.7%		2.8%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	407,115.92	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,100,000.00	3,246,645.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	308,811.57	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,100,000.00	4,351,095.89	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,524,952.67	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,084,052.05	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,195,166.83	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	757,878.10	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,569,252.87	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	566,167.05	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	351,010.17	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,850,000.00	3,389,234.25	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,531,833.96	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,920,000.00	2,235,628.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,750,000.00	3,528,325.90	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,329,024.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,181,990.00	
	銘柄数：17	28,470,000.00	32,558,186.03 (2,539,212,928)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,127,412.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	428,693.48	

	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,974,746.84	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,700,000.00	2,866,604.04	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	467,653.04	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	508,532.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	5,129,843.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	517,097.85	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,959,810.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,645,825.75	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,305,666.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	6,225,591.24	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	648,975.96	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,600,000.00	17,251,121.16	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	5,026,848.72	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,469,452.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,397,598.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	307,194.02	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	12,700,000.00	14,578,959.92	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,965,628.36	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	855,994.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,543,412.68	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	11,477,157.37	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,100,000.00	4,689,694.39	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	352,470.99	
小計	銘柄数：25	102,780,000.00	112,721,985.59	
			(2,878,919,511)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
新シエケル	ISRAEL FIXED BOND	2,600,000.00	2,755,148.76	
	ISRAEL FIXED BOND	9,800,000.00	9,904,054.44	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,110,205.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,459,394.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,188,246.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,571,274.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,336,222.50	
	ISRAEL FIXED BOND	6,500,000.00	8,701,532.45	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,479,479.50	

	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,618,818.50	
	ISRAEL FIXED BOND	2,000,000.00	2,038,495.80	
	ISRAEL FIXED BOND	6,000,000.00	10,252,335.60	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	6,964,024.00	
小計	銘柄数：13	66,900,000.00	78,379,231.55	
			(2,522,243,671)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
合計			574,671,483,436	
			(574,671,483,436)	

(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12月28日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	1,445,000	
		US TREASURY N/B	33,000,000	
		US TREASURY N/B	10,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	10,227,000	
		US TREASURY N/B	5,500,000	
		US TREASURY N/B	1,034,000	
		US TREASURY N/B	6,400,000	
		US TREASURY N/B	5,000,000	
		US TREASURY N/B	12,000,000	
		US TREASURY N/B	7,586,000	
		US TREASURY N/B	18,000,000	
		US TREASURY N/B	31,000,000	
		US TREASURY N/B	10,000,000	
		US TREASURY N/B	12,000,000	
		US TREASURY N/B	12,000,000	
		US TREASURY N/B	835,000	
		US TREASURY BOND	5,000,000	
		US TREASURY BOND	40,000,000	
		US TREASURY N/B	18,600,000	
		US TREASURY BOND	36,000,000	
		US TREASURY BOND	50,000,000	
		US TREASURY BOND	9,403,000	
		US TREASURY BOND	1,000,000	
		US TREASURY BOND	32,000,000	
		US TREASURY N/B	9,980,000	
		US TREASURY N/B	3,655,000	
US TREASURY N/B	29,000,000			

US TREASURY N/B	10,200,000
US TREASURY N/B	8,400,000
US TREASURY N/B	17,000,000
US TREASURY N/B	1,700,000
US TREASURY N/B	1,300,000
US TREASURY N/B	12,500,000
US TREASURY N/B	250,000
US TREASURY N/B	25,000,000
US TREASURY N/B	20,600,000
US TREASURY N/B	29,000,000
US TREASURY N/B	17,000,000
US TREASURY N/B	1,710,000
US TREASURY N/B	40,000,000
US TREASURY N/B	19,600,000
US TREASURY N/B	16,000,000
US TREASURY N/B	11,540,000
US TREASURY N/B	5,000,000
US TREASURY N/B	6,900,000
US TREASURY N/B	425,000
US TREASURY N/B	22,000,000
US TREASURY N/B	950,000
US TREASURY N/B	20,600,000
US TREASURY N/B	2,000,000
US TREASURY N/B	1,098,000
US TREASURY N/B	340,000
US TREASURY N/B	5,000,000
US TREASURY N/B	15,045,000
US TREASURY N/B	36,000,000
US TREASURY N/B	7,369,000
US TREASURY N/B	8,611,000
US TREASURY N/B	1,020,000
US TREASURY N/B	7,395,000
US TREASURY N/B	6,826,000
US TREASURY N/B	19,700,000
US TREASURY N/B	3,341,000
US TREASURY N/B	33,000,000
US TREASURY N/B	35,000,000
US TREASURY N/B	1,550,000
US TREASURY BOND	38,000,000
US TREASURY BOND	335,000
US TREASURY N/B	30,000,000
US TREASURY N/B	2,000,000
US TREASURY N/B	4,186,000
US TREASURY N/B	1,339,000
US TREASURY N/B	41,000,000
US TREASURY N/B	27,000,000
US TREASURY N/B	1,275,000
US TREASURY N/B	17,000,000
US TREASURY N/B	765,000

		US TREASURY N/B	1,105,000
		US TREASURY N/B	85,000
		US TREASURY N/B	12,000,000
		US TREASURY N/B	155,000
		US TREASURY N/B	12,750,000
		US TREASURY N/B	26,000,000
		US TREASURY N/B	680,000
		US TREASURY N/B	36,000,000
		US TREASURY N/B	210,000
		US TREASURY N/B	34,000,000
		US TREASURY N/B	1,300,000
		US TREASURY N/B	10,000,000
		US TREASURY N/B	2,000,000
		US TREASURY N/B	24,000,000
		US TREASURY N/B	16,000,000
	ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,600,000
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,000,000
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,900,000
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000,000
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,100,000
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,300,000
		FRANCE (GOVT OF)	8,500,000
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,000,000
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5,000,000
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,000,000
		SPANISH GOVERNMENT	18,000,000
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1,700,000

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12月28日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	41,423,600	-	41,444,000	20,400
米ドル	41,423,600	-	41,444,000	20,400
合計	41,423,600	-	41,444,000	20,400

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2020年12月28日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	50,472,839
コール・ローン	7,686,851
国債証券	8,768,901,099
未収利息	88,696,220
前払費用	10,043,664
流動資産合計	8,925,800,673
資産合計	8,925,800,673
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,185,519
未払利息	3
その他未払費用	494,700
流動負債合計	2,680,222
負債合計	2,680,222
純資産の部	
元本等	
元本	6,443,256,508
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,479,863,943
元本等合計	8,923,120,451
純資産合計	8,923,120,451
負債純資産合計	8,925,800,673

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年12月28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	1.3849円
(10,000口当たり純資産額)	(13,849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12月27日 至 2020年12月28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、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p>
<p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年12月28日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年12月28日現在	
期首	2019年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	5,692,464,158円
同期中における追加設定元本額	2,942,092,764円
同期中における一部解約元本額	2,191,300,414円
期末元本額	6,443,256,508円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	19,783,708円
野村資産設計ファンド2020	20,023,786円
野村資産設計ファンド2025	37,467,055円
野村資産設計ファンド2030	36,936,280円
野村資産設計ファンド2035	26,160,589円
野村資産設計ファンド2040	45,995,169円
野村資産設計ファンド2045	5,803,815円
野村インデックスファンド・新興国債券	886,268,545円
ネクストコア	47,328,222円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	311,900,878円
野村資産設計ファンド2050	7,548,870円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	4,900,758円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	1,978,757円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,448,861円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	908,070円
世界6資産分散ファンド	115,909,144円
野村資産設計ファンド2060	2,308,893円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用）	3,424,088,965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）	744,687円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信（適格機関投資家専用）	144,599,668円
野村DC新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド	385,290,329円
野村DC運用戦略ファンド	827,647,635円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	76,690,184円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	5,353,611円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	3,447,272円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	1,974,359円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	748,398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12月28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12月28日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,600,000.00	8,832,095.08		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	11,000,000.00	11,335,481.30		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,500,000.00	8,930,780.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	11,212,100.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,900,000.00	13,073,569.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,900,000.00	8,270,115.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	15,550,000.00	17,720,158.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	17,100,000.00	20,902,869.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,600,000.00	7,774,734.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,200,000.00	4,976,790.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	3,808,944.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	11,600,000.00	14,483,760.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,700,000.00	7,781,380.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,500,000.00	10,127,070.00		
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	12,900,000.00	14,190,516.00		
		小計	銘柄数：15	142,750,000.00	163,420,361.38	(851,420,082)
			組入時価比率：9.5%		9.6%	
		リアル	レアル	LETRA TESOURO NACIONAL	3,300,000.00	3,207,211.92
	LETRA TESOURO NACIONAL			4,900,000.00	4,634,407.26	
LETRA TESOURO NACIONAL	3,900,000.00			3,448,731.39		
LETRA TESOURO NACIONAL	9,200,000.00			7,867,145.40		
NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000.00			7,031,674.35		
NOTA DO TESOURO NACIONAL	411,000.00			4,938,989.87		
NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000.00			3,916,756.16		
NOTA DO TESOURO NACIONAL	250,000.00			3,106,959.75		
NOTA DO TESOURO NACIONAL	60,000.00			751,140.30		
小計	銘柄数：9		22,951,000.00	38,903,016.40	(772,613,905)	
	組入時価比率：8.7%		8.8%			
チリペソ	チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	100,000,000.00	108,725,000.00		
		BONOS TESORERIA PESOS	310,000,000.00	327,685,500.00		
		BONOS TESORERIA PESOS	300,000,000.00	348,015,000.00		

小計	BONOS TESORERIA PESOS	295,000,000.00	349,855,250.00
	BONOS TESORERIA PESOS	240,000,000.00	294,042,336.00
	BONOS TESORERIA PESOS	215,000,000.00	297,678,250.00
	銘柄数：6 組入時価比率：2.8%	1,460,000,000.00	1,726,001,336.00 (250,097,593) 2.9%
小計	REPUBLIC OF COLOMBIA	3,610,000,000.00	4,714,551,700.00
	TITULOS DE TESORERIA	1,100,000,000.00	1,168,028,290.00
	TITULOS DE TESORERIA	950,000,000.00	1,154,109,970.00
	TITULOS DE TESORERIA	1,900,000,000.00	2,083,052,080.00
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	961,786,800.00
	TITULOS DE TESORERIA	1,750,000,000.00	2,058,758,975.00
	TITULOS DE TESORERIA	1,600,000,000.00	1,761,106,880.00
	TITULOS DE TESORERIA	1,850,000,000.00	2,068,025,830.00
	銘柄数：8 組入時価比率：5.3%	13,660,000,000.00	15,969,420,525.00 (471,097,905) 5.4%
小計	BONOS DE TESORERIA	200,000.00	234,226.16
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	751,053.06
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	732,059.22
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	774,139.52
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	734,400.52
	PERU BONO SOBERANO	700,000.00	952,503.93
	PERU BONO SOBERANO	1,300,000.00	1,696,895.20
	PERU BONO SOBERANO	1,020,000.00	1,270,684.78
	REPUBLIC OF PERU	1,100,000.00	1,401,317.83
	銘柄数：9 組入時価比率：2.7%	6,920,000.00	8,547,280.22 (245,135,996) 2.8%
小計	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	4,240,053.20
小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.1%	4,000,000.00	4,240,053.20 (10,430,530) 0.1%
小計	DOMINICAN REPUBLIC	8,000,000.00	8,622,964.80
小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.2%	8,000,000.00	8,622,964.80 (15,348,877) 0.2%
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	250,000.00	237,020.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,150,260.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,100,000.00	1,040,193.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	790,000.00	721,246.30
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,400,000.00	1,358,210.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,770,000.00	2,411,506.60

小計	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	481,150.80
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,110,000.00	984,570.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	859,819.20
	TURKEY GOVERNMENT BOND	400,000.00	374,400.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,124,400.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	700,000.00	641,200.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,790,334.00
	銘柄数：13	14,260,000.00	13,174,309.90 (180,092,816)
組入時価比率：2.0%		2.1%	
チェココルナ	CZECH REPUBLIC	14,000,000.00	14,028,872.20
	CZECH REPUBLIC	19,600,000.00	19,736,261.16
	CZECH REPUBLIC	12,500,000.00	11,992,476.25
	CZECH REPUBLIC	13,200,000.00	12,902,709.60
	CZECH REPUBLIC	5,000,000.00	4,980,439.00
	CZECH REPUBLIC	6,500,000.00	7,002,775.00
	銘柄数：6	70,800,000.00	70,643,533.21 (340,501,830)
組入時価比率：3.8%		3.9%	
フォリント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	17,000,000.00	18,614,150.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	93,000,000.00	95,191,684.50
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	62,000,000.00	63,163,603.60
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	77,000,000.00	88,611,600.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	68,000,000.00	72,658,000.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	75,000,000.00	79,103,542.50
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	75,071,209.50
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	86,000,000.00	92,620,624.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	82,000,000.00	89,854,829.20
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	57,000,000.00	78,078,600.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	60,000,000.00	65,180,220.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	170,000,000.00	190,142,144.00
銘柄数：12	910,000,000.00	1,008,290,207.30 (350,884,992)	
組入時価比率：3.9%		4.0%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	3,809,389.02
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,293,397.60
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,784,440.88
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000.00	4,279,020.78
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	7,421,793.68
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,700,000.00	1,916,059.97
	POLAND GOVERNMENT BOND	600,000.00	681,480.00
	銘柄数：7	23,100,000.00	25,185,581.93 (704,692,582)

	組入時価比率：7.9%		8.0%
ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,000,000.00	20,494,628.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	22,500,000.00	23,557,950.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	12,649,857.60
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	29,000,000.00	30,395,190.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	28,000,000.00	29,223,740.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,300,000.00	11,078,325.68
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,000,000.00	29,003,875.20
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,000,000.00	30,045,870.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	47,700,000.00	53,342,986.32
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	29,000,000.00	32,858,560.20
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	12,214,401.60
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,700,000.00	20,196,654.50
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	10,742,500.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	48,000,000.00	54,168,960.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	26,500,000.00	31,686,937.75
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,500,000.00	31,009,275.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	10,892,100.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,000,000.00	20,592,180.00
小計	銘柄数：18	423,200,000.00	464,153,991.85 (654,457,128)
	組入時価比率：7.3%		7.5%
レイ	ROMANIA	900,000.00	910,161.00
	ROMANIA	1,000,000.00	1,019,005.00
	ROMANIA	550,000.00	590,876.00
	ROMANIA	400,000.00	420,051.08
	ROMANIA	500,000.00	520,505.95
	ROMANIA	500,000.00	511,162.50
	ROMANIA	1,000,000.00	1,063,765.00
	ROMANIA	920,000.00	997,657.20
	ROMANIA	500,000.00	522,411.75
	ROMANIA	500,000.00	553,000.00
	ROMANIA	760,000.00	896,553.22
	ROMANIA	800,000.00	922,508.00
	ROMANIA	1,200,000.00	1,247,220.00
	小計	銘柄数：13	9,530,000.00
	組入時価比率：3.0%		3.0%
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	857,386.96
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,000,000.00	2,195,697.40
	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	849,364.16
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,000,000.00	1,169,132.60
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	827,248.00

小計	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,874,996.10	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,258,158.24	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,790,782.28	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	4,002,018.42	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	650,203.44	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,527,297.38	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	3,160,470.75	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,194,243.00	
	銘柄数：13	21,600,000.00	23,356,998.73	(596,537,747)
	組入時価比率：6.7%			6.8%
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,200,000.00	7,430,612.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,329,973.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,157,024.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	16,700,000.00	18,005,211.88	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,171,026.70	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,900,000.00	24,735,720.86	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,625,055.20	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,700,000.00	11,570,057.66	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,900,000.00	14,693,697.27	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	13,250,378.34	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	28,300,000.00	29,376,667.84	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	7,386,682.20	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,200,000.00	10,283,193.60	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,000,000.00	13,275,823.60	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	15,645,582.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,900,000.00	7,348,427.58	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,300,000.00	15,912,360.73	
	小計	銘柄数：17	195,800,000.00	217,197,495.86
組入時価比率：8.4%			8.5%	
フィリピンペソ	REPUBLIC OF PHILIPPINES	10,000,000.00	12,848,198.00	
	小計	銘柄数：1	10,000,000.00	12,848,198.00
	組入時価比率：0.3%			(27,752,107)
ルピア	INDONESIA GOVERNMENT	5,380,000,000.00	5,601,656,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,700,000,000.00	2,791,407,690.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	7,730,000,000.00	8,502,145,062.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	8,800,000,000.00	9,714,648,240.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,700,000,000.00	3,872,975,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,580,000,000.00	1,945,533,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,250,000,000.00	6,745,710,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,079,000,000.00	

	INDONESIA GOVERNMENT	12,230,000,000.00	14,620,965,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,400,000,000.00	7,386,184,960.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,439,914,311.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	11,100,000,000.00	11,821,500,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,979,657,840.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,600,000,000.00	1,821,071,680.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,200,000,000.00	3,488,055,360.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	5,041,610,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,680,000,000.00	6,620,627,312.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,769,996,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,400,000,000.00	3,723,350,540.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,500,000,000.00	2,921,245,750.00	
小計	銘柄数：20	100,660,000,000.00	111,887,253,745.00	
			(816,776,952)	
	組入時価比率：9.2%		9.3%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,000,000.00	6,364,214.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,900,000.00	17,588,743.74	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	19,000,000.00	18,114,989.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,460,000.00	3,824,919.19	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,000,000.00	6,309,941.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,000,000.00	3,545,850.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000.00	3,336,035.52	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,200,000.00	9,329,723.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000.00	6,103,434.77	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,450,000.00	2,942,071.66	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000.00	9,756,434.70	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,500,000.00	9,512,389.45	
小計	銘柄数：12	106,210,000.00	96,728,747.93	
			(684,839,535)	
	組入時価比率：7.7%		7.8%	
オフショア人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	7,626,777.75	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,500,000.00	10,363,290.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,036,293.90	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,535,912.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,568,290.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,500,000.00	2,651,907.75	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,615,647.00	
小計	銘柄数：7	47,500,000.00	49,398,118.40	
			(785,430,082)	
	組入時価比率：8.8%		9.0%	
合計			8,768,901,099	
			(8,768,901,099)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

2021年1月29日現在

資産総額	133,670,947円
負債総額	122,594円
純資産総額（ - ）	133,548,353円
発行済口数	107,106,497口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2469円

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

2021年1月29日現在

資産総額	51,455,368円
負債総額	47,129円
純資産総額（ - ）	51,408,239円
発行済口数	40,646,472口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2648円

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

2021年1月29日現在

資産総額	33,808,299円
負債総額	32,092円
純資産総額（ - ）	33,776,207円
発行済口数	26,612,159口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2692円

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

2021年1月29日現在

資産総額	23,826,564円
負債総額	21,785円
純資産総額（ - ）	23,804,779円
発行済口数	18,767,007口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2684円

（参考）国内株式マザーファンド

2021年1月29日現在

資産総額	462,733,823,286円
負債総額	30,451,843,673円
純資産総額（ - ）	432,281,979,613円
発行済口数	230,881,992,743口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8723円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2021年1月29日現在

資産総額	821,642,199,015円
負債総額	2,458,417,638円
純資産総額（ - ）	819,183,781,377円
発行済口数	239,185,946,072口
1口当たり純資産額（ / ）	3.4249円

（参考）新興国株式マザーファンド

2021年1月29日現在

資産総額	60,512,115,893円
負債総額	554,229,819円
純資産総額（ - ）	59,957,886,074円
発行済口数	37,844,779,229口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5843円

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

2021年1月29日現在

資産総額	716,879,303,762円
負債総額	3,952,848,028円
純資産総額（ - ）	712,926,455,734円
発行済口数	537,423,872,611口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3266円

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

2021年1月29日現在

資産総額	157,680,428,798円
負債総額	79,655,105,782円
純資産総額（ - ）	78,025,323,016円
発行済口数	62,432,153,609口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2498円

（参考）外国債券マザーファンド

2021年1月29日現在

資産総額	585,131,529,636円
負債総額	1,108,666,279円
純資産総額（ - ）	584,022,863,357円
発行済口数	235,570,975,595口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4792円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2021年1月29日現在

資産総額	8,946,301,687円
負債総額	25,948,234円
純資産総額（ - ）	8,920,353,453円
発行済口数	6,466,408,419口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3795円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

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

記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取扱い

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

第三部【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

2021年1月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2020年12月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

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

追加型株式投資信託	998	34,903,928
単位型株式投資信託	189	821,114
追加型公社債投資信託	14	6,225,605
単位型公社債投資信託	486	1,664,140
合計	1,687	43,614,787

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(2019年4月1日から2020年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2020年4月1日から2020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 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020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			1,562		2,626
金銭の信託			45,493		41,524
有価証券			19,900		24,399
前払費用			27		106
未収入金			500		522
未収委託者報酬			25,246		23,936
未収運用受託報酬			5,933		4,336
その他			269		71
貸倒引当金			15		14
流動資産計			98,917		97,509
固定資産					
有形固定資産			714		645

建物	2	320		295	
器具備品	2	393		349	
無形固定資産			6,438		5,894
ソフトウェア		6,437		5,893	
その他		0		0	
投資その他の資産			18,608		16,486
投資有価証券		1,562		1,437	
関係会社株式		12,631		10,171	
従業員長期貸付金		-		16	
長期差入保証金		235		329	
長期前払費用		22		19	
前払年金費用		2,001		1,545	
繰延税金資産		2,694		2,738	
その他		168		229	
貸倒引当金		-		0	
投資損失引当金		707		-	
固定資産計			25,761		23,026
資産合計			124,679		120,536

区分	注記 番号	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020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			145		157
未払金			16,709		15,279
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		25		3	
未払手数料		7,724		6,948	
関係会社未払金		7,422		7,262	
その他未払金		1,535		1,063	
未払費用	1		11,704		10,290
未払法人税等			1,560		1,564
前受収益			29		26
賞与引当金			3,792		3,985
その他			-		67
流動負債計			33,942		31,371
固定負債					
退職給付引当金			3,219		3,311
時効後支払損引当金			558		572
固定負債計			3,777		3,883
負債合計			37,720		35,254
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			86,924		85,270
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			56,014		54,360
利益準備金		685		685	

その他利益剰余金		55,329		53,675
別途積立金		24,606		24,606
繰越利益剰余金		30,723		29,069
評価・換算差額等			33	10
その他有価証券評価差額金			33	10
純資産合計			86,958	85,281
負債・純資産合計			124,679	120,536

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			119,196		115,736
運用受託報酬			21,440		17,170
その他営業収益			355		340
営業収益計			140,992		133,247
営業費用					
支払手数料			42,675		39,435
広告宣伝費			1,210		1,006
公告費			0		-
調査費			30,082		26,833
調査費		5,998		5,696	
委託調査費		24,083		21,136	
委託計算費			1,311		1,342
営業雑経費			5,435		5,823
通信費		92		75	
印刷費		970		958	
協会費		86		92	
諸経費		4,286		4,696	
営業費用計			80,715		74,440
一般管理費					
給料			11,113		11,418
役員報酬		379		109	
給料・手当		7,067		7,173	
賞与		3,666		4,134	
交際費			107		86
旅費交通費			514		391
租税公課			1,048		1,029
不動産賃借料			1,223		1,227
退職給付費用			1,474		1,486
固定資産減価償却費			2,835		2,348
諸経費			10,115		10,067
一般管理費計			28,433		28,055
営業利益			31,843		30,751

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020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	6,538		4,936	
受取利息		0		0	
その他		424		309	
営業外収益計			6,964		5,246
営業外費用					
支払利息	1	1		-	
金銭の信託運用損		489		230	
投資事業組合等評価損		-		146	
時効後支払損引当金繰入額		43		18	
為替差損		34		23	
その他		17		23	
営業外費用計			585		443
経常利益			38,222		35,555
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		21	
関係会社清算益	3	29		-	
株式報酬受入益		85		59	
特別利益計			135		81
特別損失					
投資有価証券等評価損		938		119	
関係会社株式評価損		161		1,591	
固定資産除却損	2	310		67	
投資損失引当金繰入額		707		-	
特別損失計			2,118		1,778
税引前当期純利益			36,239		33,858
法人税、住民税及び事業税			10,196		9,896
法人税等調整額			370		34
当期純利益			25,672		23,996

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

資本金	株主資本							株主 資本 合計
	資本剰余金			利益剰余金				
	資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益 剰余金 合計	
					別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		

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

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金			
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金		利益 剰余金 合計	
						別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924
当期変動額									
剰余金の配当							25,650	25,650	25,650
当期純利益							23,996	23,996	23,996
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純 額)									

当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,653	1,653	1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(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
当期変動額			
剰余金の配当			25,650
当期純利益			23,996
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	23	23	23
当期変動額合計	23	23	1,676
当期末残高	10	10	85,281

[重要な会計方針]

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

<p>5 . 消費税等の会計処理方法</p> <p>6 . 連結納税制度の適用</p>	<p>(3) 退職給付引当金 従業員から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>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あります。</p> <p>連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</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 2020年3月31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 2020年3月31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せん。

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。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）

(1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針（以下「時価算定会計基準等」という。）が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

また「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」が改訂され、金融商品の時価のレベルごとの内訳等の注記事項が定められました。

(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。

- ・「会計方針の開示、会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 2020年3月31日）

(1) 概要

関連する会計基準等の定めが明らかでない場合に、採用した会計処理の原則及び手続きの概要を示すことを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

- ・「会計上の見積りの開示に関する会計基準（企業会計基準第31号 2020年3月31日）」

(1) 概要

当年度の財務諸表に計上した金額が会計上の見積りによるもののうち、翌年度の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目における会計上の見積りの内容について、財務諸表利用者の理解に資する情報を開示することを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2019年3月31日)	当事業年度末 (2020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。	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	未払費用 1,296百万円

<p>2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">736百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">3,106</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">3,842</td> </tr> </table>	建物	736百万円	器具備品	3,106	合計	3,842	<p>2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">761百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">2,347</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">3,109</td> </tr> </table>	建物	761百万円	器具備品	2,347	合計	3,109
建物	736百万円												
器具備品	3,106												
合計	3,842												
建物	761百万円												
器具備品	2,347												
合計	3,109												

損益計算書関係

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)																		
<p>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。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">6,531百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">1</td> </tr> </table> <p>2. 固定資産除却損</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">3百万円</td> </tr> <tr> <td>ソフトウェア</td> <td style="text-align: right;">307</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">310</td> </tr> </table> <p>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。</p>	受取配当金	6,531百万円	支払利息	1	器具備品	3百万円	ソフトウェア	307	合計	310	<p>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。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">4,931百万円</td> </tr> </table> <p>2. 固定資産除却損</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">7百万円</td> </tr> <tr> <td>ソフトウェア</td> <td style="text-align: right;">59</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">67</td> </tr> </table>	受取配当金	4,931百万円	器具備品	7百万円	ソフトウェア	59	合計	67
受取配当金	6,531百万円																		
支払利息	1																		
器具備品	3百万円																		
ソフトウェア	307																		
合計	310																		
受取配当金	4,931百万円																		
器具備品	7百万円																		
ソフトウェア	59																		
合計	67																		

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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

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

(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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されており、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	-	-	-
----	--------	---	---	---

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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

2020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	2,626	2,626	-
(2)金銭の信託	41,524	41,524	-
(3)未収委託者報酬	23,936	23,936	-
(4)未収運用受託報酬	4,336	4,336	-
(5)有価証券及び投資有価証券	24,399	24,399	-
その他有価証券	24,399	24,399	-
資産計	96,823	96,823	-
(6)未払金	15,279	15,279	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	3	3	-
未払手数料	6,948	6,948	-
関係会社未払金	7,262	7,262	-
その他未払金	1,063	1,063	-
(7)未払費用	10,290	10,290	-
(8)未払法人税等	1,564	1,564	-
負債計	27,134	27,134	-

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

譲渡性預金及びコマーシャル・ペーパー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1,437百万円、関係会社株式10,171百万円）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。当事業年度において、非上場株式について2,416百万円（投資有価証券117百万円、関係会社株式2,298百万円）減損処理を行っております。なお、関係会社株式に係る評価損は、過年度に計上してありました関係会社株式に対する投資損失引当金の戻入益707百万円と相殺し、関係会社株式評価損1,591百万円を特別損失に計上しております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	2,626	-	-	-
金銭の信託	41,524	-	-	-
未収委託者報酬	23,936	-	-	-
未収運用受託報酬	4,336	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	24,399	-	-	-
合計	96,823	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（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。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

- 1．売買目的有価証券(2020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(2020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(2020年3月31日)
該当事項はありません。
- 4．その他有価証券(2020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	4,400	4,400	-
コマーシャル・ペーパー	19,999	19,999	-
小計	24,399	24,399	-
合計	24,399	24,399	-

- 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2019年4月1日 至 2020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 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	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

確定給付型企業年金制度の割引率	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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,551 百万円
勤務費用	1,034
利息費用	154
数理計算上の差異の発生額	138
退職給付の支払額	858
その他	17
退職給付債務の期末残高	23,761

(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	17,469 百万円
期待運用収益	436
数理計算上の差異の発生額	393
事業主からの拠出額	566
退職給付の支払額	666
年金資産の期末残高	17,413

(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	20,462 百万円
年金資産	17,413
	3,048
非積立型制度の退職給付債務	3,299
未積立退職給付債務	6,347
未認識数理計算上の差異	4,764
未認識過去勤務費用	185
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766
退職給付引当金	3,311
前払年金費用	1,545
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	1,034 百万円
利息費用	154
期待運用収益	436
数理計算上の差異の費用処理額	572
過去勤務費用の費用処理額	35
確定給付制度に係る退職給付費用	1,289
(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	57%
株式	24%
生保一般勘定	12%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%
長期期待運用収益率の設定方法	
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。	
(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企業年金制度の割引率	0.6%
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、202百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2019年3月31日)		当事業年度末 (2020年3月31日)	
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
繰延税金資産	百万円	繰延税金資産	百万円
賞与引当金	1,175	賞与引当金	1,235
退職給付引当金	998	退職給付引当金	1,026
関係会社株式評価減	51	関係会社株式評価減	762
投資有価証券評価減	708	投資有価証券評価減	462
未払事業税	288	未払事業税	285
時効後支払損引当金	172	時効後支払損引当金	177
減価償却超過額	171	減価償却超過額	171
ゴルフ会員権評価減	192	ゴルフ会員権評価減	167
関係会社株式売却損	148	関係会社株式売却損	148
未払社会保険料	82	未払社会保険料	97
その他	633	その他	219
繰延税金資産小計	4,625	繰延税金資産小計	4,754
評価性引当額	1,295	評価性引当額	1,532
繰延税金資産合計	3,329	繰延税金資産合計	3,222
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	15	その他有価証券評価差額金	4
前払年金費用	620	前払年金費用	478
繰延税金負債合計	635	繰延税金負債合計	483
繰延税金資産の純額	2,694	繰延税金資産の純額	2,738

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率 (調整)	法定実効税率 (調整)
31.0%	31.0%
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
0.1%	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	受取配当金等永久に益金に算入されない項目
5.6%	4.4%
タックスヘイブン税制	タックスヘイブン税制
2.6%	2.6%
外国税額控除	外国税額控除
0.6%	0.7%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税
0.3%	0.2%
その他	その他
1.3%	0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	税効果会計適用後の法人税等の負担率
29.1%	29.1%

セグメント情報等

前事業年度(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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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 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上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*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㈱（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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1)	31,378	未払手数料	5,536
							コマーシャル・ペーパーの購入(*2)	20,000	有価証券	19,999
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(*2) コマーシャル・ペーパーの購入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

ニューヨーク証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,882円89銭	1株当たり純資産額	16,557円31銭
1株当たり当期純利益	4,984円30銭	1株当たり当期純利益	4,658円88銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	25,672百万円	損益計算書上の当期純利益	23,996百万円
普通株式に係る当期純利益	25,672百万円	普通株式に係る当期純利益	23,996百万円
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

		2020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		2,307
金銭の信託		40,828
有価証券		10,500
未収委託者報酬		24,249
未収運用受託報酬		4,560
その他		894
貸倒引当金		14
流動資産計		83,326
固定資産		
有形固定資産	1	2,998
無形固定資産		5,462
ソフトウェア		5,461
その他		0
投資その他の資産		15,942
投資有価証券		1,701
関係会社株式		10,171
前払年金費用		1,429
繰延税金資産		2,003
その他		636
固定資産計		24,403

資産合計		107,730
2020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		11,513
未払収益分配金		0
未払償還金		0
未払手数料		6,651
関係会社未払金		4,007
その他未払金	2	853
未払費用		9,953
未払法人税等		1,444
賞与引当金		2,005
その他		147
流動負債計		25,063
固定負債		
退職給付引当金		3,350
時効後支払損引当金		579
資産除去債務		1,371
固定負債計		5,300
負債合計		30,364
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		77,365
資本剰余金		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		46,455
利益準備金		685
その他利益剰余金		45,770
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		21,163
評価・換算差額等		0
その他有価証券評価差額金		0
純資産合計		77,366
負債・純資産合計		107,730

中間損益計算書

		自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日
区分	注記 番号	金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		52,814
運用受託報酬		7,648
その他営業収益		178
営業収益計		60,641
営業費用		
支払手数料		16,811
調査費		11,994
その他営業費用		3,835

営業費用計		32,641
一般管理費	1	13,883
営業利益		14,115
営業外収益	2	6,145
営業外費用	3	33
経常利益		20,227
特別利益	4	2,228
特別損失	5	445
税引前中間純利益		22,011
法人税、住民税及び事業税		5,226
法人税等調整額		739
中間純利益		16,045

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270
当中間期変動額									
剰余金の配当							23,950	23,950	23,950
中間純利益							16,045	16,045	16,045
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	-	-	-	-	-	-	7,905	7,905	7,905
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	21,163	46,455	77,365

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	

当期首残高	10	10	85,281
当中間期変動額			
剰余金の配当			23,950
中間純利益			16,045
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	10	10	10
当中間期変動額合計	10	10	7,915
当中間期末残高	0	0	77,366

[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。
4 引当金の計上基準	(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。 (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。 (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。

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

[注記事項]

中間貸借対照表関係

2020年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	648百万円
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 2020年4月 1日	至 2020年9月30日
1 減価償却実施額			
	有形固定資産	180百万円	
	無形固定資産	1,125百万円	
2 営業外収益のうち主要なもの			
	受取配当金	4,540百万円	
	金銭信託運用益	1,360百万円	
3 営業外費用のうち主要なもの			
	時効後支払引当金繰入	10百万円	
	為替差損	9百万円	
4 特別利益の内訳			
	投資有価証券等売却益	71百万円	
	株式報酬受入益	26百万円	
	移転補償金	2,130百万円	
5 特別損失の内訳			
	投資有価証券等評価損	36百万円	
	固定資産除却損	2百万円	
	事務所移転費用	406百万円	

中間株主資本等変動計算書関係

自 2020年4月 1日 至 2020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	当中間会計期間末
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株
2 配当に関する事項				
配当金支払額				
2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。				
・普通株式の配当に関する事項				
(1) 配当金の総額			23,950百万円	
(2) 1株当たり配当額			4,650円	
(3) 基準日			2020年3月31日	
(4) 効力発生日			2020年6月30日	

金融商品関係

当中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

2020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	2,307	2,307	-
(2)金銭の信託	40,828	40,828	-
(3)未収委託者報酬	24,249	24,249	-
(4)未収運用受託報酬	4,560	4,560	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	10,500	10,500	-
資産計	82,445	82,445	-
(6)未払金	11,513	11,513	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	0	0	-
未払手数料	6,651	6,651	-
関係会社未払金	4,007	4,007	-
その他未払金	853	853	-
(7)未払費用	9,953	9,953	-
(8)未払法人税等	1,444	1,444	-
負債計	22,911	22,911	-

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1,701百万円、関係会社株式10,171百万円）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。なお、当中間会計期間において、非上場株式について35百万円（投資有価証券35百万円）減損処理を行っております。

有価証券関係

当中間会計期間末（2020年9月30日）

1．満期保有目的の債券(2020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(2020年9月30日)

該当事項はありません。

3．その他有価証券(2020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	10,500	10,500	-
小計	10,500	10,500	-
合計	10,500	10,500	-

資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

当該資産除去債務の総額の増減 (単位：百万円)

	自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日
期首残高	-
有形固定資産の取得に伴う増加	1,371
時の経過による調整額	-
中間期末残高	1,371

セグメント情報等

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020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 2020年4月 1日 至 2020年9月30日

1株当たり純資産額	15,020円52銭
-----------	------------

1株当たり中間純利益	3,115円15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	16,045百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	16,045百万円
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。)

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

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託者

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

* 2020年12月末現在

(2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村証券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

* 2020年12月末現在

2【関係業務の概要】

(1) 受託者

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

(1)目論見書の表紙にロゴ・マークや図案を採用すること、またファンドの形態などの記載をすることがあります。

(2)目論見書の巻末に約款を掲載する場合があります。

(3)届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表等を付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

- (5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用場合があります。
- (6)目論見書の表紙裏等にインターネットホームページに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含む）も掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載する場合があります。
- (7)目論見書に当該委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額および目論見書の使用を開始する日を記載する場合があります。
- (8)目論見書に投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載する場合があります。

独立監査人の監査報告書

2020年6月10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 櫻井 雄一郎
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 津村 健二郎
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、「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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成すること

が適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

2021年2月19日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀井純子

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」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016-2026-2028年目標型の2019年12月27日から2020年12月28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、野村ターゲットデートファンド2016-2026-2028年目標型の2020年12月28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。

独立監査人の監査報告書

2021年2月19日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀井純子

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」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型の2019年12月27日から2020年12月28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、野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型の2020年12月28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。

独立監査人の監査報告書

2021年2月19日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀井純子

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」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016-2032-2034年目標型の2019年12月27日から2020年12月28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、野村ターゲットデートファンド2016-2032-2034年目標型の2020年12月28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。

独立監査人の監査報告書

2021年2月19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

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」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型の2019年12月27日から2020年12月28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、野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型の2020年12月28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

2020年11月25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 津村健二郎
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 水永真太郎
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020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。

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2020年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020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。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる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。

中間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中間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中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的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。
- ・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中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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

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。