

## 【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】	2023年3月24日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	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】

2023年3月25日から2024年3月22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。

## &lt;商品分類&gt;

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

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

- （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	<b>インデックス型</b>
<b>追加型</b>	海外	債券	
	<b>内外</b>	不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
		<b>資産複合</b>	

## 《属性区分表》

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本を含む)  日本			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年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)	日経225  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。

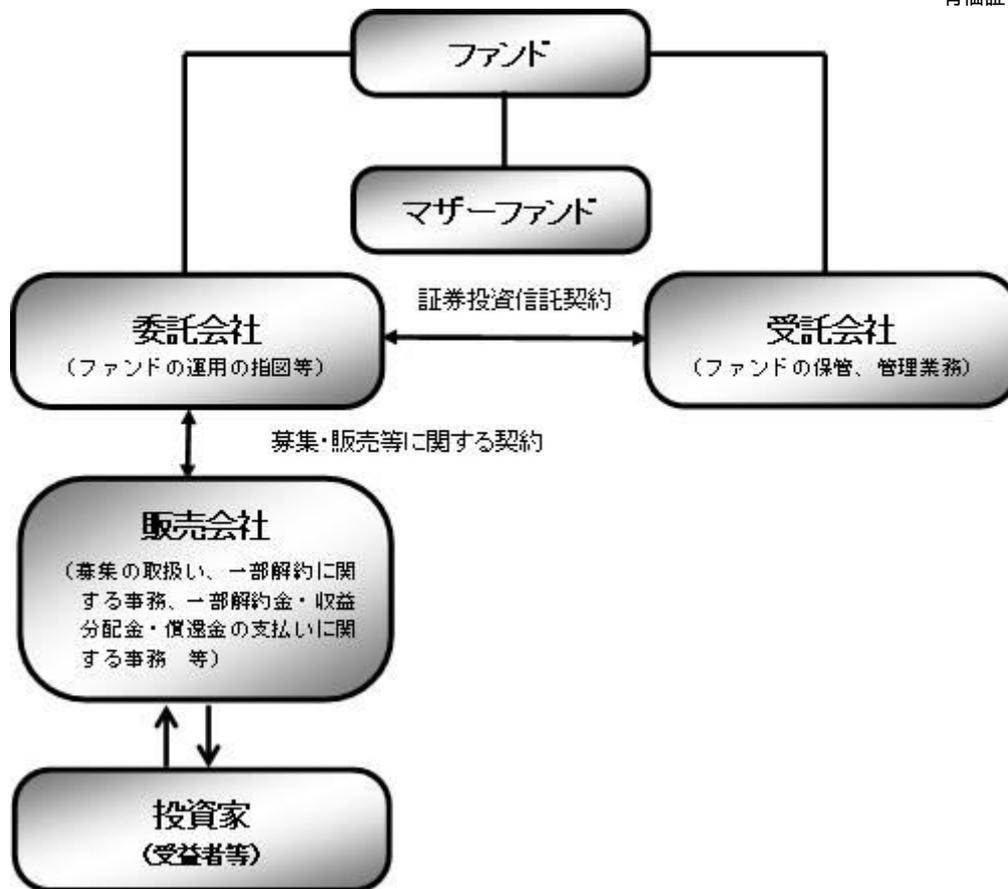
[ 特殊型 ]

- (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			

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



委託会社の概況(2023年2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】

「野村ターゲットデットファンド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

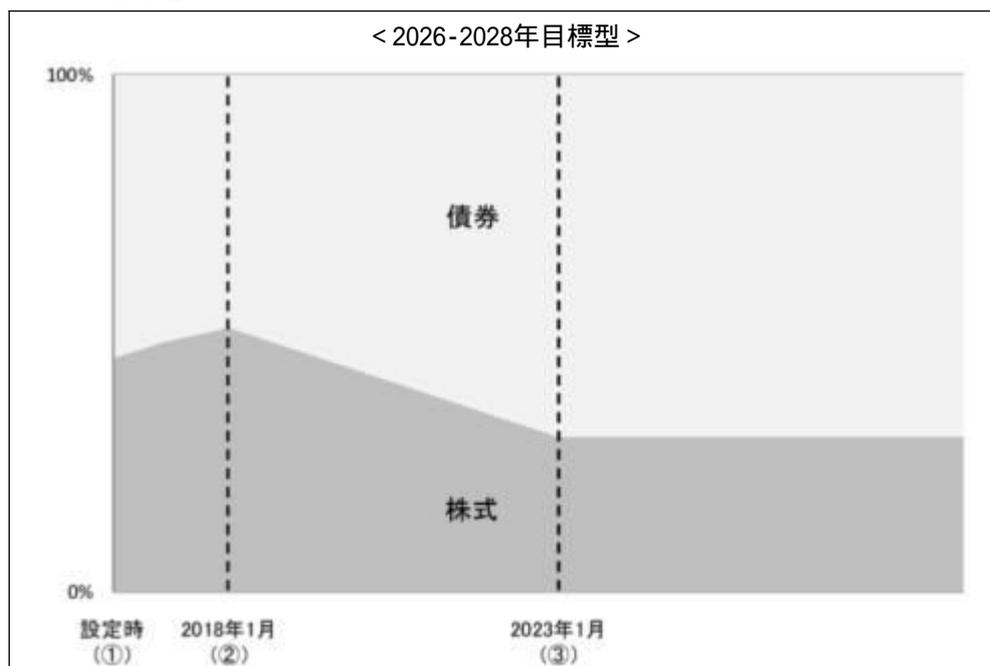
「投資基礎期」は、株式への実質投資割合を徐々に増やし、債券への実質投資割合を徐々に減らすことを基本とし、株式・債券配分を定期的に変化させます。

「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。

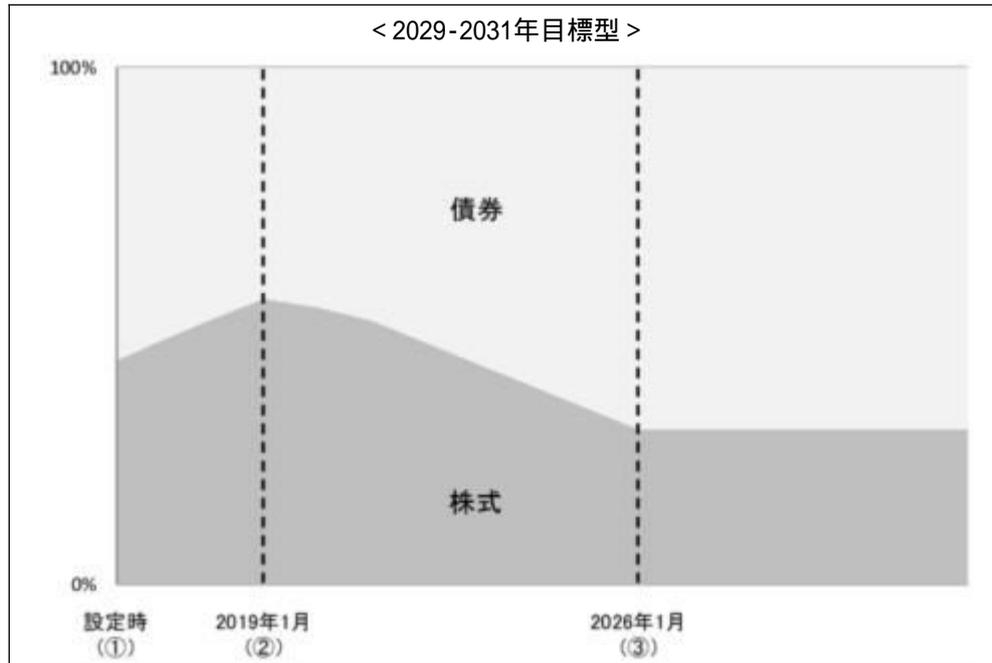
・期間中は、安定運用を行なう場合があります。

#### 株式・債券配分のイメージ図

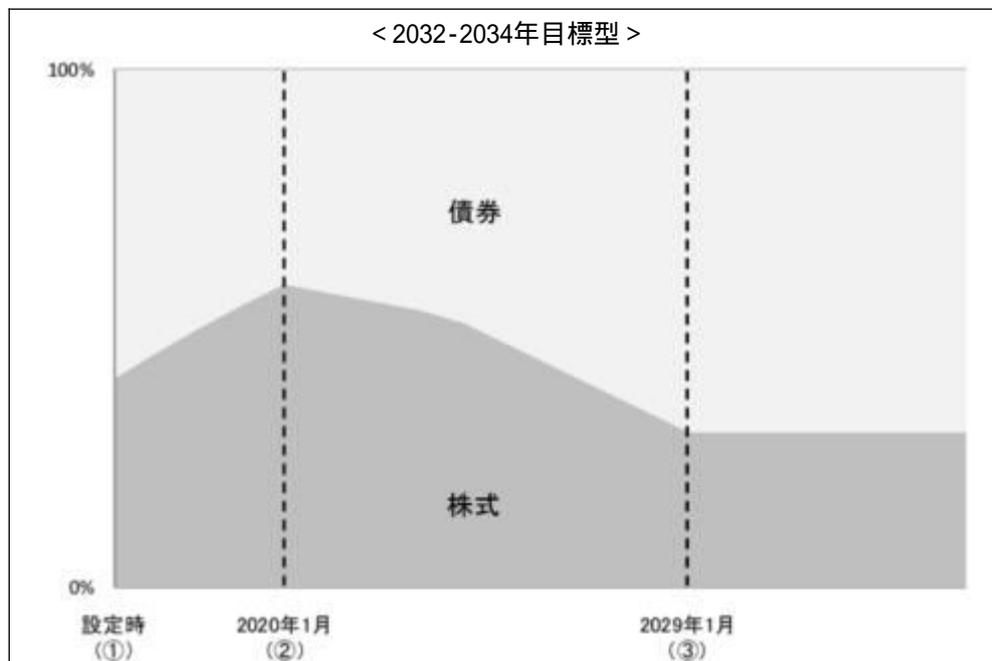


投資基礎期開始日	資産形成期開始日	目標前準備期開始日
株式45.2%	株式51.1%	株式30.0%

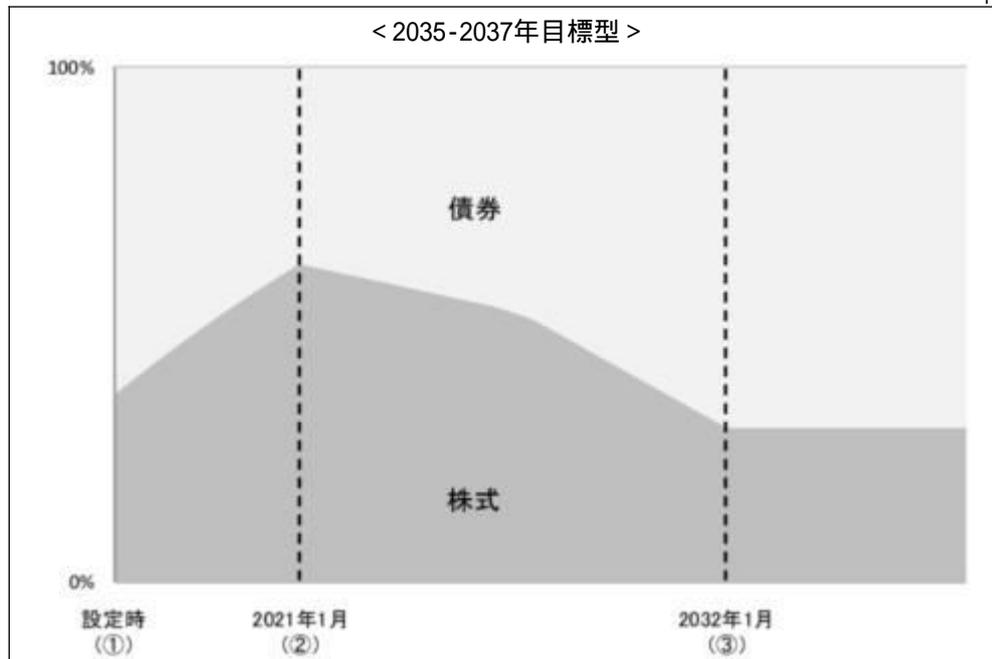
債券54.8%	債券48.9%	債券70.0%
---------	---------	---------



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
		2023年 3月	資産 形成期 開始日	2023年 3月	資産 形成期 開始日	2023年 3月	資産 形成期 開始日	2023年 3月	資産 形成期 開始日	
株式	国内株式マザーファンド	15.0%	25.5%	21.0%	27.6%	26.6%	29.2%	29.1%	30.9%	15.0%
	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	8.8%	15.4%	12.3%	16.6%	15.5%	17.6%	17.0%	18.6%	9.0%
	新興国株式マザーファンド	6.2%	10.2%	8.7%	11.0%	11.1%	11.7%	12.1%	12.3%	6.0%
債券	国内債券NOMURA-BPI 総合 マザーファンド	30.0%	17.0%	21.6%	14.9%	15.9%	13.2%	13.4%	11.6%	30.0%
	外国債券為替ヘッジ型 マザーファンド	30.0%	17.0%	21.6%	14.9%	15.9%	13.2%	13.4%	11.6%	30.0%
	外国債券マザーファンド	7.7%	12.2%	11.3%	12.3%	11.5%	12.3%	11.5%	12.3%	8.2%
	新興国債券（現地通貨建て） マザーファンド	2.3%	2.7%	3.5%	2.7%	3.5%	2.8%	3.5%	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、2023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。

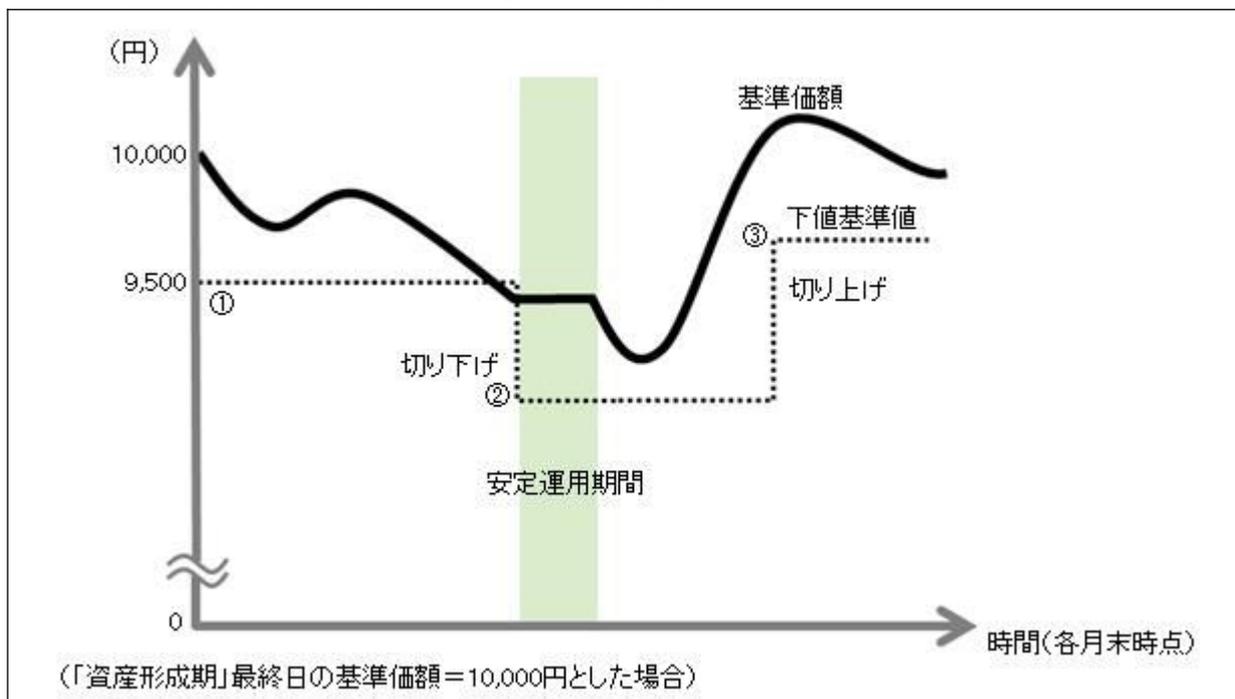
「目標前準備期」の各月末時点において、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、マザーファンドを通じて投資する株式および債券の実質的なエクスポージャーを引き下げ、短期有価証券等へ投資する安定運用を行ないます。なお、安定運用を行なうにあたっては、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等の売建てを行なう場合があります。

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） <sup>*2</sup>
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証券） <sup>*1</sup> 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） <sup>*3</sup>
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-ボンド・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） <sup>*4</sup>

\*1 Depositary 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。

各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について

## 東証株価指数（TOPIX）

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

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

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

J P Xは、東証株価指数（TOPIX）の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、J P Xは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではない。

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

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

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

## 「MSCI-KOKUSAI指数」、「MSCI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ため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問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIとその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、本ファンドまたは本ファンドの発行会社あるいは所有者に関わらず、MSCIにより決定、作成、及び計算されています。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、本ファンドの発行者または所有者の要求を考慮にいれる義務は一切ありません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの発行時期、発行価格または発行数量の決定について、また、本ファンドを現金に償還する方程式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者に対し、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

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

いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

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

#### NOMURA-BPI総合

NOMURA-BPI総合は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属しております。また、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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](mailto: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](http://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。

### 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」、「（６）及び（７）」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・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券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）
6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
  9. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
  10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券および新株予約権証券
  12. 外国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」

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1.基本方針

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

#### 2.運用方法

##### (1)投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

##### (2)投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

##### (3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

#### 運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1.基本方針

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

## 2.運用方法

### (1)投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

### (2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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。

「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」

## 運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

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

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

「外国債券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す。

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。

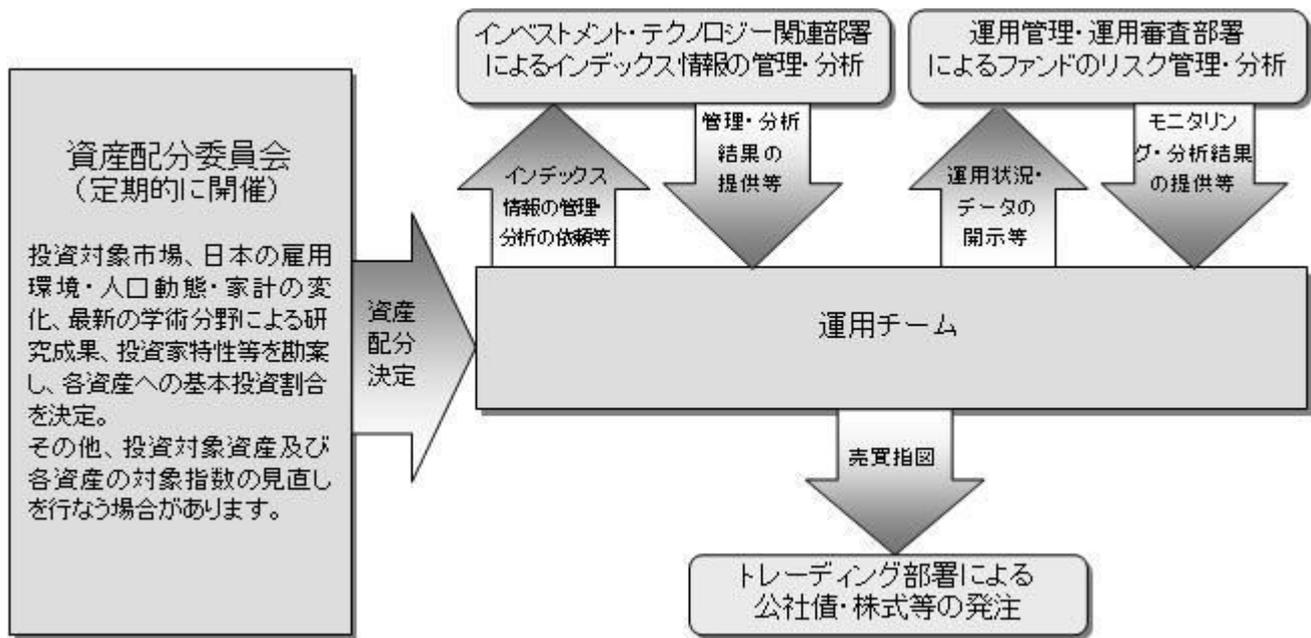
外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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います。）の利用は行ないません。

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

## （３）【運用体制】

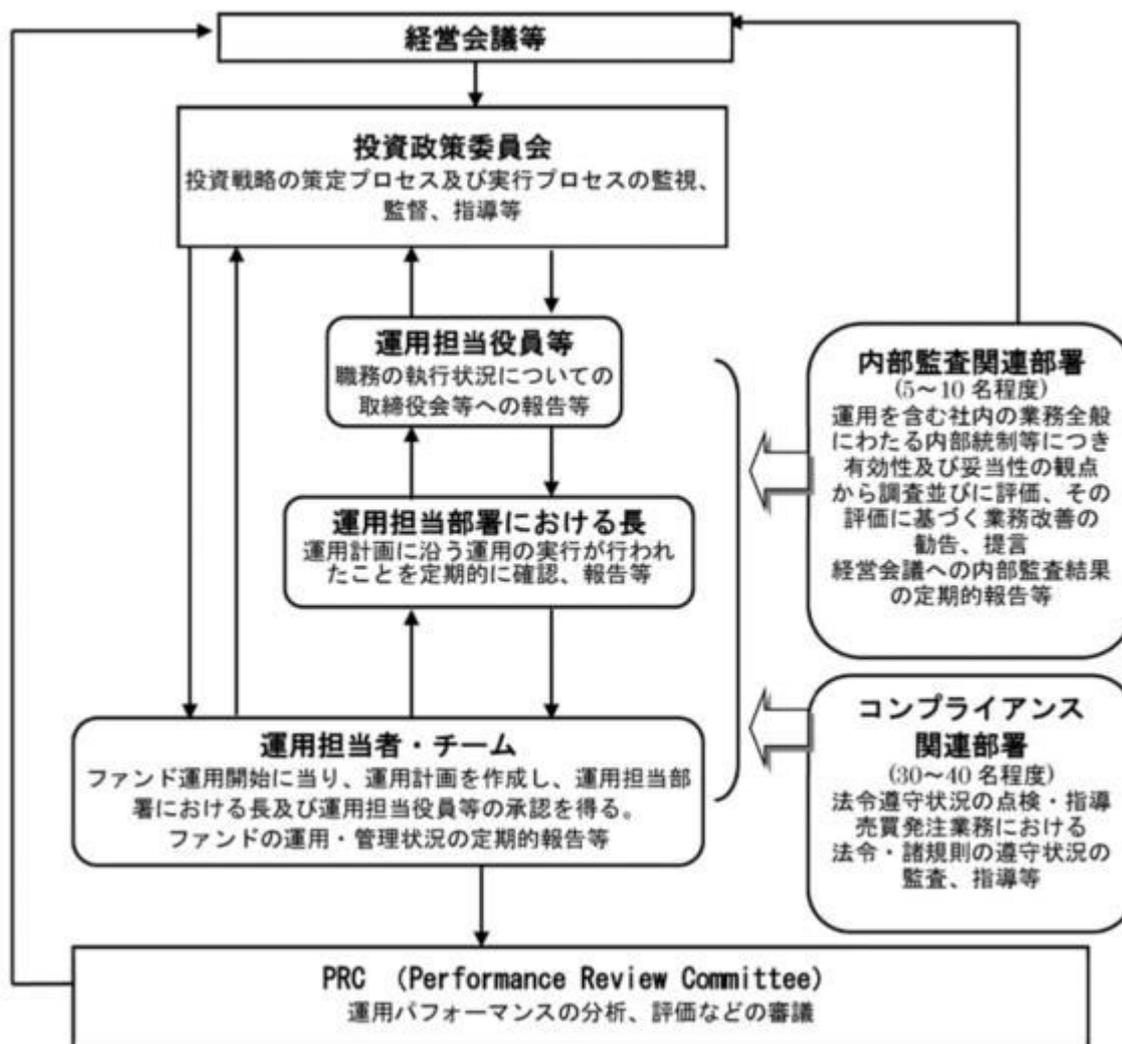
ファンドの運用体制は以下の通りです。



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

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

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

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

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券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券

## 4. 売り出しにより取得する株券

## 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券

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、投資者の皆様は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。

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

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

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

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

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。

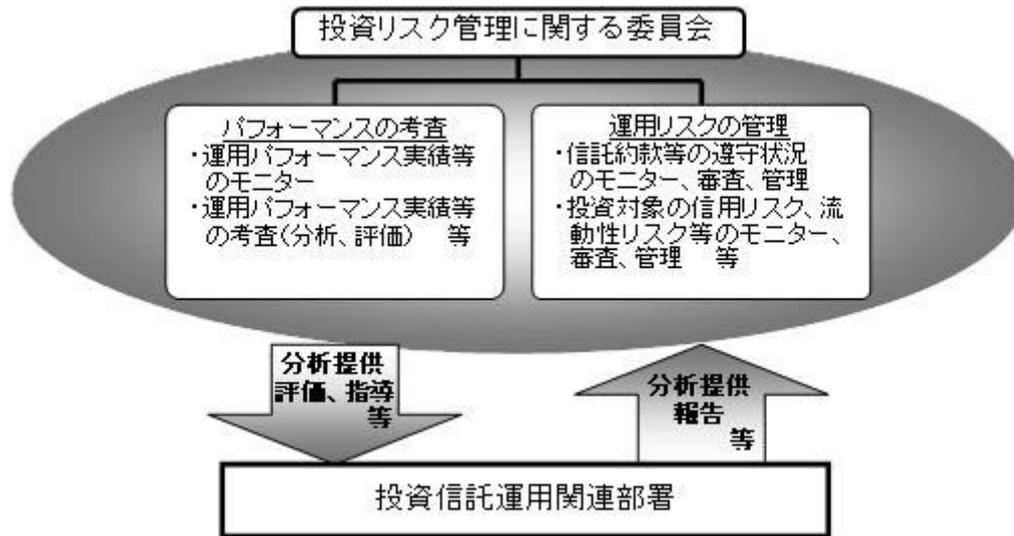
### 運用リスクの管理

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。

#### 流動性リスク管理について

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

### リスク管理体制図

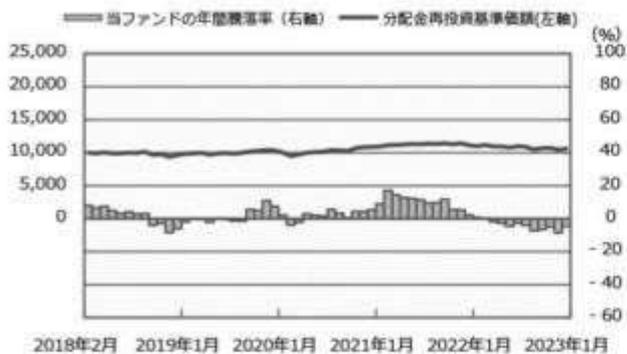


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

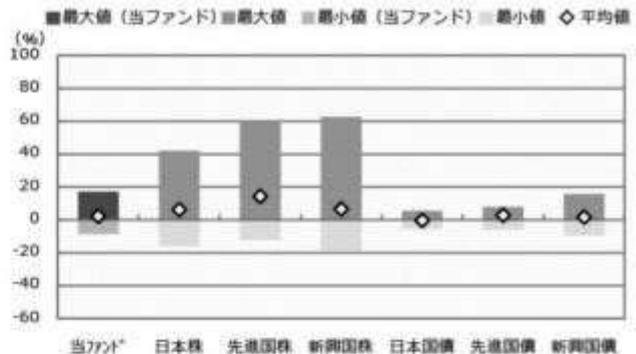
## ■ リスクの定量的比較 (2018年2月末～2023年1月末：月次)

### 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 (%)	17.1	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値 (%)	△ 8.6	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値 (%)	2.3	6.2	14.4	6.6	△ 0.2	2.8	1.6

\* 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。2018年2月末を10,000として指数化しております。

\* 年間騰落率は、2018年2月から2023年1月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

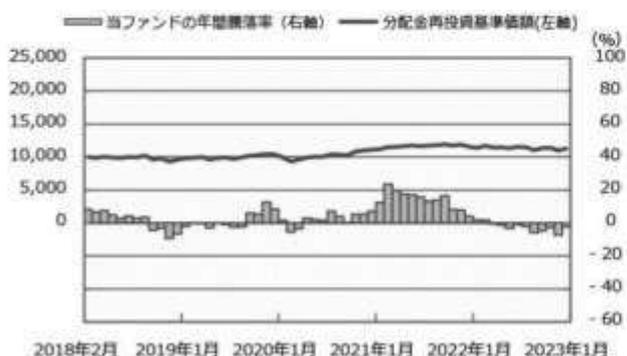
\* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。  
\* 2018年2月から2023年1月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

\* 決算日に対応した数値とは異なります。

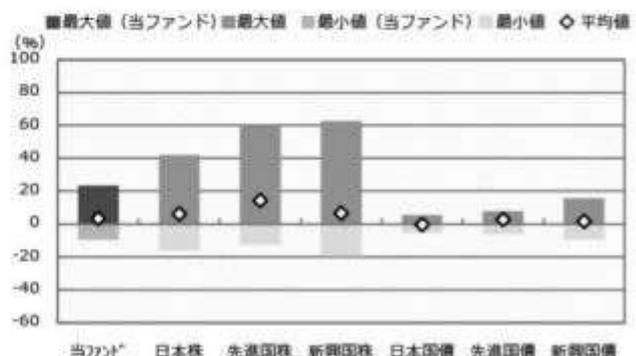
\* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

### 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 (%)	23.5	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値 (%)	△ 9.4	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値 (%)	3.4	6.2	14.4	6.6	△ 0.2	2.8	1.6

\* 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。2018年2月末を10,000として指数化しております。

\* 年間騰落率は、2018年2月から2023年1月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

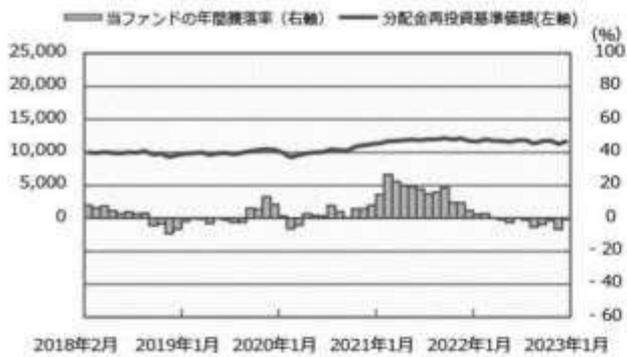
\* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。  
\* 2018年2月から2023年1月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

\* 決算日に対応した数値とは異なります。

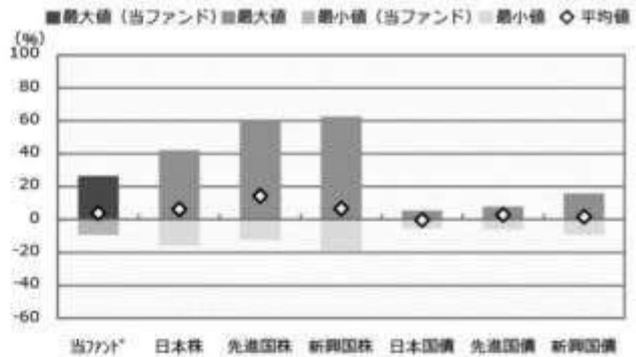
\* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## 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



### 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 (%)	26.5	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値 (%)	△ 9.3	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値 (%)	4.0	6.2	14.4	6.6	△ 0.2	2.8	1.6

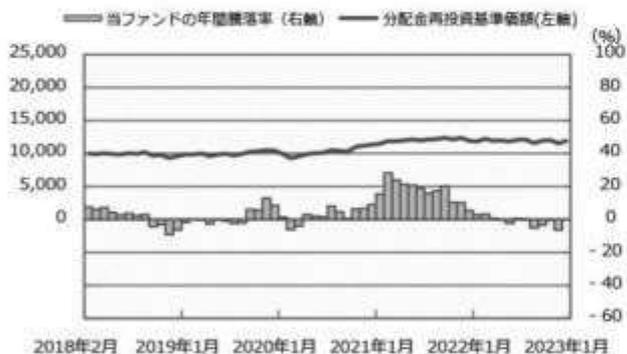
\* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2018年2月末を10,000として指数化しております。

\* 年間騰落率は、2018年2月から2023年1月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

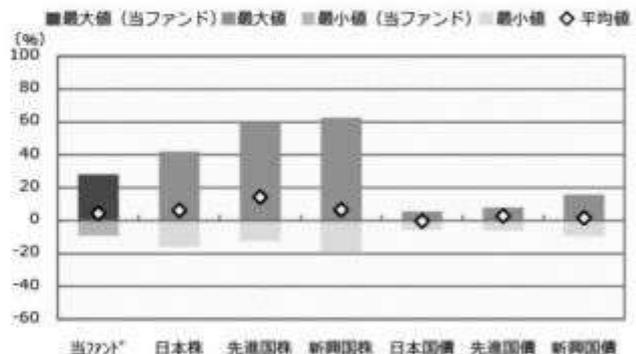
\* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。  
\* 2018年2月から2023年1月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。  
\* 決算日に対応した数値とは異なります。  
\* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## 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



### 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 (%)	28.1	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値 (%)	△ 9.1	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値 (%)	4.4	6.2	14.4	6.6	△ 0.2	2.8	1.6

\* 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。2018年2月末を10,000として指数化しております。

\* 年間騰落率は、2018年2月から2023年1月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

\* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。  
\* 2018年2月から2023年1月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。  
\* 決算日に対応した数値とは異なります。  
\* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

＜代表的な資産クラスの指数＞

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

■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標章又は商標は、株式会社J P X 総研又は株式会社J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P X が有します。J P X は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P X は責任を負いません。
  - MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
  - NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
  - FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
  - JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を兼ねてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または買主になっている可能性もあります。
- 米国のJ.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての奨励、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると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。
- JPMSLLCはNASDAQ、NYSE、SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### （1）【申込手数料】

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》 <sup>(注2)</sup>	《配当所得》
<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 特定公社債<sup>(注1)</sup>の利子</li> <li>・ 公募公社債投資信託の収益分配金</li> </ul>	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"> <li>・ 譲渡益</li> <li>・ 譲渡損</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 上場株式の配当</li> <li>・ 公募株式投資信託の収益分配金</li> </ul>

(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。

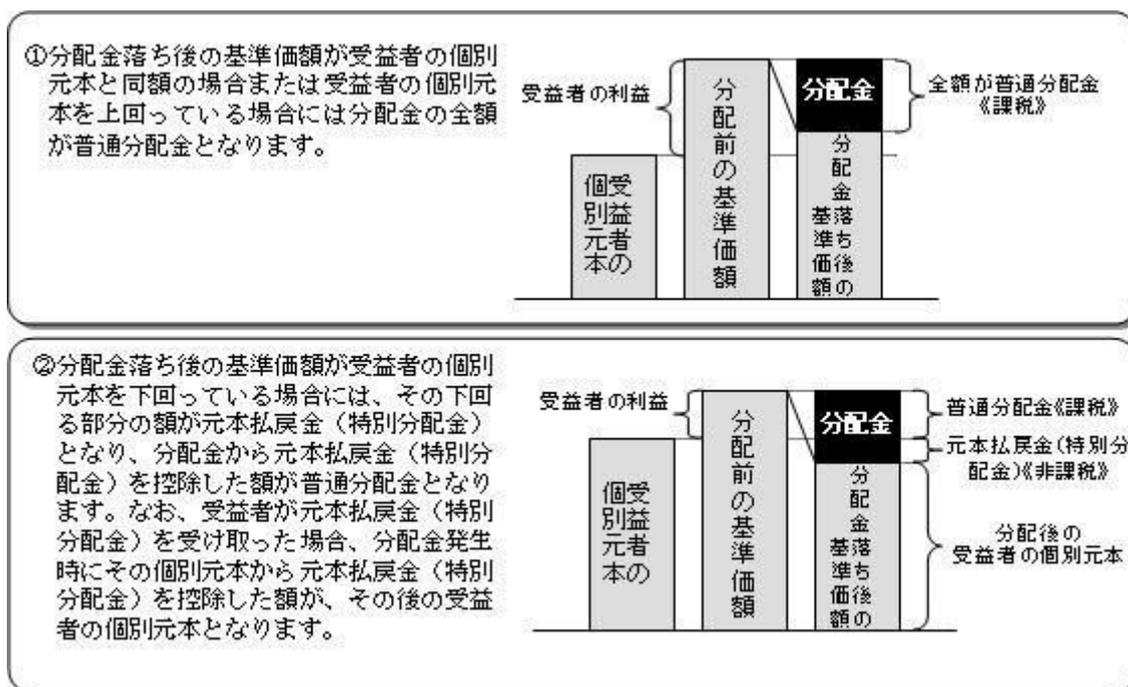
## 個別元本について

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（2023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2023年1月31日現在の運用状況であります。

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

## (1)【投資状況】

## 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	145,132,525	99.74
現金・預金・その他資産(負債控除後)		367,866	0.25
合計(純資産総額)		145,500,391	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	65,967,784	99.89
現金・預金・その他資産(負債控除後)		72,046	0.10
合計(純資産総額)		66,039,830	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	40,951,909	99.89
現金・預金・その他資産(負債控除後)		43,779	0.10
合計(純資産総額)		40,995,688	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	34,124,843	99.89
現金・預金・その他資産(負債控除後)		35,259	0.10
合計(純資産総額)		34,160,102	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	473,175,141,560	98.68

現金・預金・その他資産(負債控除後)		6,306,364,584	1.31
合計(純資産総額)		479,481,506,144	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	4,918,995,000	1.02

## (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	977,263,006,040	68.81
	カナダ	51,809,017,760	3.64
	ドイツ	36,643,175,471	2.58
	イタリア	10,310,825,538	0.72
	フランス	51,279,214,420	3.61
	オランダ	20,347,673,164	1.43
	スペイン	10,790,816,610	0.75
	ベルギー	3,522,113,874	0.24
	オーストリア	833,086,262	0.05
	ルクセンブルグ	332,913,164	0.02
	フィンランド	4,179,212,462	0.29
	アイルランド	3,133,879,062	0.22
	ポルトガル	948,216,160	0.06
	イギリス	64,743,153,191	4.55
	スイス	43,180,280,292	3.04
	スウェーデン	14,491,905,017	1.02
	ノルウェー	3,006,036,701	0.21
	デンマーク	12,199,417,281	0.85
	オーストラリア	33,201,541,026	2.33
	ニュージーランド	834,877,443	0.05
香港	11,756,943,920	0.82	
シンガポール	5,070,727,392	0.35	
イスラエル	1,967,454,297	0.13	
小計		1,361,845,486,547	95.89
投資証券	アメリカ	28,101,207,036	1.97
	カナダ	163,450,516	0.01
	フランス	615,061,354	0.04
	ベルギー	153,150,933	0.01
	イギリス	663,078,377	0.04

	オーストラリア	1,988,910,146	0.14
	香港	538,334,460	0.03
	シンガポール	663,079,612	0.04
	小計	32,886,272,434	2.31
現金・預金・その他資産（負債控除後）		25,476,210,473	1.79
合計（純資産総額）		1,420,207,969,454	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	18,466,821,636	1.30
	買建	カナダ	944,014,855	0.06
	買建	ドイツ	2,624,338,368	0.18
	買建	イギリス	1,201,938,849	0.08
	買建	スイス	796,777,404	0.05
	買建	オーストラリア	648,625,898	0.04

## （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	3,180,575,547	3.53
	メキシコ	2,055,847,764	2.28
	ブラジル	4,390,848,302	4.87
	チリ	195,716,960	0.21
	コロンビア	52,780,277	0.05
	ギリシャ	291,606,732	0.32
	トルコ	492,663,445	0.54
	チェコ	126,016,268	0.13
	ハンガリー	160,121,835	0.17
	ポーランド	621,173,541	0.68
	香港	22,101,644,707	24.53
	マレーシア	1,300,886,612	1.44
	タイ	1,868,881,047	2.07
	フィリピン	649,262,166	0.72
	インドネシア	1,582,083,806	1.75
	韓国	10,367,416,457	11.50
	台湾	12,645,225,089	14.03
	インド	11,095,284,250	12.31
	カタール	815,623,111	0.90
エジプト	9,090,903	0.01	

	南アフリカ	3,085,843,696	3.42
	アラブ首長国連邦	1,034,673,577	1.14
	クウェート	748,695,333	0.83
	サウジアラビア	3,342,365,970	3.71
	小計	82,214,327,395	91.26
投資信託受益証券	アメリカ	3,820,423,616	4.24
投資証券	メキシコ	73,601,492	0.08
	南アフリカ	31,812,360	0.03
	小計	105,413,852	0.11
現金・預金・その他資産（負債控除後）		3,940,058,804	4.37
合計（純資産総額）		90,080,223,667	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	3,109,181,586	3.45
	買建	香港	743,804,249	0.82

## （参考）国内債券NOMURA - B P I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	692,182,266,550	80.96
地方債証券	日本	55,472,141,024	6.48
特殊債券	日本	62,715,258,088	7.33
社債券	日本	40,296,942,150	4.71
現金・預金・その他資産（負債控除後）		4,284,934,037	0.50
合計（純資産総額）		854,951,541,849	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	54,586,399,879	49.29
	カナダ	2,276,741,420	2.05
	メキシコ	898,163,208	0.81
	ドイツ	7,350,680,260	6.63
	イタリア	8,513,104,611	7.68
	フランス	9,466,508,580	8.54
	オランダ	1,745,511,205	1.57
	スペイン	5,557,604,325	5.01

	ベルギー	2,033,066,613	1.83
	オーストリア	1,300,981,220	1.17
	フィンランド	525,754,556	0.47
	アイルランド	705,156,127	0.63
	イギリス	5,398,732,354	4.87
	スウェーデン	223,005,370	0.20
	ノルウェー	212,399,192	0.19
	デンマーク	367,139,521	0.33
	ポーランド	467,417,043	0.42
	オーストラリア	1,811,049,273	1.63
	ニュージーランド	254,018,750	0.22
	シンガポール	1,130,976,343	1.02
	中国	4,409,104,464	3.98
	イスラエル	357,708,665	0.32
	小計	109,591,222,979	98.96
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,141,673,923	1.03
合計（純資産総額）		110,732,896,902	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	328,704,708,978	49.24
	カナダ	13,796,516,105	2.06
	メキシコ	5,487,171,485	0.82
	ドイツ	37,926,127,844	5.68
	イタリア	57,983,917,022	8.68
	フランス	50,195,714,588	7.51
	オランダ	8,740,383,031	1.30
	スペイン	38,933,503,784	5.83
	ベルギー	13,522,422,173	2.02
	オーストリア	8,327,910,347	1.24
	フィンランド	2,225,916,280	0.33
	アイルランド	4,438,630,122	0.66
	イギリス	32,605,215,946	4.88
	スウェーデン	1,332,803,184	0.19
	ノルウェー	1,387,146,247	0.20
	デンマーク	2,196,326,163	0.32
	ポーランド	3,036,257,134	0.45
	オーストラリア	10,914,930,451	1.63
	ニュージーランド	1,485,082,006	0.22
	シンガポール	3,138,277,905	0.47

	マレーシア	3,799,051,032	0.56
	中国	26,544,173,276	3.97
	イスラエル	2,266,276,292	0.33
	小計	658,988,461,395	98.72
現金・預金・その他資産（負債控除後）		8,514,936,150	1.27
合計（純資産総額）		667,503,397,545	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	793,487,956	9.92
	ブラジル	777,206,620	9.72
	チリ	182,008,589	2.27
	コロンビア	289,374,148	3.62
	ペルー	169,978,945	2.12
	ウルグアイ	12,590,410	0.15
	セルビア	22,293,351	0.27
	トルコ	61,710,969	0.77
	チェコ	441,023,331	5.51
	ハンガリー	250,180,441	3.13
	ポーランド	561,477,178	7.02
	ロシア	0	0.00
	ルーマニア	263,068,621	3.29
	マレーシア	799,702,703	10.00
	タイ	808,357,693	10.11
	インドネシア	789,056,712	9.87
	中国	778,627,313	9.74
	エジプト	64,233,618	0.80
	南アフリカ	741,147,094	9.27
	小計	7,805,525,692	97.67
現金・預金・その他資産（負債控除後）		186,152,679	2.32
合計（純資産総額）		7,991,678,371	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	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	42,011,965	1.0221	42,940,430	1.0325	43,377,353	29.81
2	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	33,909,554	1.2646	42,882,022	1.2554	42,570,054	29.25
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	10,385,282	2.0632	21,426,914	2.1461	22,287,853	15.31
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド	2,846,809	4.3715	12,444,826	4.5652	12,996,252	8.93
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	4,458,805	2.4584	10,961,527	2.4885	11,095,736	7.62
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	5,879,818	1.4904	8,763,281	1.6059	9,442,399	6.48
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	2,299,561	1.4251	3,277,105	1.4624	3,362,878	2.31

## 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	99.74
合計	99.74

## 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	6,666,276	2.0636	13,756,528	2.1461	14,306,494	21.66
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	13,420,825	1.0224	13,721,452	1.0325	13,857,001	20.98
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	10,829,426	1.2646	13,695,516	1.2554	13,595,261	20.58
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド	1,827,942	4.3720	7,991,763	4.5652	8,344,920	12.63
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	2,983,828	2.4588	7,336,671	2.4885	7,425,255	11.24
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	3,815,389	1.4917	5,691,416	1.6059	6,127,133	9.27
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	1,580,772	1.4253	2,253,169	1.4624	2,311,720	3.50

## 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	5,184,276	2.0632	10,696,199	2.1461	11,125,974	27.13
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	1,410,024	4.3715	6,163,920	4.5652	6,437,041	15.70
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	6,143,172	1.0221	6,278,937	1.0325	6,342,825	15.47
4	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	4,957,078	1.2646	6,268,721	1.2554	6,223,115	15.17
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	2,941,179	1.4906	4,384,122	1.6059	4,723,239	11.52
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,860,547	2.4584	4,573,969	2.4885	4,629,971	11.29
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	1,005,022	1.4250	1,432,157	1.4624	1,469,744	3.58

## 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 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	4,713,290	2.0633	9,724,932	2.1461	10,115,191	29.61
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	1,285,291	4.3736	5,621,349	4.5652	5,867,610	17.17
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	4,295,070	1.0222	4,390,421	1.0325	4,434,659	12.98
4	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	3,466,503	1.2645	4,383,612	1.2554	4,351,847	12.73
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	2,688,200	1.4919	4,010,526	1.6059	4,316,980	12.63
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,547,191	2.4590	3,804,543	2.4885	3,850,184	11.27
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	812,618	1.4255	1,158,387	1.4624	1,188,372	3.47

## 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	9,150,500	2,150.84	19,681,337,860	1,896.50	17,353,923,250	3.61
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,178,800	10,575.49	12,466,397,750	11,580.00	13,650,504,000	2.84
3	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,420,900	750.26	7,818,467,509	952.70	9,927,991,430	2.07
4	日本	株式	キーエンス	電気機器	166,700	50,478.44	8,414,756,061	59,280.00	9,881,976,000	2.06
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,141,600	3,867.26	8,282,143,839	3,892.00	8,335,107,200	1.73
6	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,199,400	3,976.52	4,769,449,197	5,652.00	6,779,008,800	1.41
7	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,479,100	3,786.43	5,600,518,257	4,090.00	6,049,519,000	1.26
8	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	966,300	4,985.85	4,817,827,407	6,144.00	5,936,947,200	1.23
9	日本	株式	任天堂	その他製品	1,052,100	5,668.76	5,964,103,580	5,625.00	5,918,062,500	1.23
10	日本	株式	第一三共	医薬品	1,456,000	3,435.44	5,002,004,287	4,064.00	5,917,184,000	1.23
11	日本	株式	日立製作所	電気機器	818,400	6,474.53	5,298,755,352	6,782.00	5,550,388,800	1.15
12	日本	株式	信越化学工業	化学	281,700	17,677.28	4,979,692,374	19,075.00	5,373,427,500	1.12
13	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	117,600	52,386.60	6,160,664,860	45,170.00	5,311,992,000	1.10
14	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,268,300	4,365.76	5,537,094,362	4,144.00	5,255,835,200	1.09
15	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,291,500	4,336.27	5,600,295,406	4,059.00	5,242,198,500	1.09
16	日本	株式	HOYA	精密機器	355,900	12,599.04	4,483,998,578	14,200.00	5,053,780,000	1.05
17	日本	株式	三井物産	卸売業	1,290,100	3,169.12	4,088,486,962	3,820.00	4,928,182,000	1.02
18	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,373,600	1,591.99	3,778,764,756	2,027.50	4,812,474,000	1.00
19	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,102,400	4,137.37	4,561,037,550	4,336.00	4,780,006,400	0.99
20	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,086,400	3,711.38	4,032,053,071	4,183.00	4,544,411,200	0.94
21	日本	株式	ダイキン工業	機械	200,900	19,905.57	3,999,029,950	22,470.00	4,514,223,000	0.94
22	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,652,700	2,363.13	3,905,555,909	2,714.00	4,485,427,800	0.93
23	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,354,600	3,342.08	4,527,194,677	3,207.00	4,344,202,200	0.90
24	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,685,000	1,509.51	4,053,034,770	1,486.50	3,991,252,500	0.83
25	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	181,300	17,434.61	3,160,895,327	21,580.00	3,912,454,000	0.81
26	日本	株式	ファナック	電気機器	163,600	19,723.09	3,226,698,280	22,905.00	3,747,258,000	0.78
27	日本	株式	村田製作所	電気機器	505,400	8,154.43	4,121,253,071	7,394.00	3,736,927,600	0.77
28	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	607,700	5,690.94	3,458,386,154	6,127.00	3,723,377,900	0.77
29	日本	株式	SMC	機械	54,600	61,683.19	3,367,902,209	65,350.00	3,568,110,000	0.74
30	日本	株式	富士通	電気機器	167,700	19,207.70	3,221,132,494	18,510.00	3,104,127,000	0.64

## 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	0.30
		建設業	1.92
		食料品	3.37
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.17

化学	6.12
医薬品	5.29
石油・石炭製品	0.48
ゴム製品	0.70
ガラス・土石製品	0.70
鉄鋼	0.83
非鉄金属	0.73
金属製品	0.56
機械	5.16
電気機器	17.15
輸送用機器	7.31
精密機器	2.58
その他製品	2.28
電気・ガス業	1.22
陸運業	2.94
海運業	0.59
空運業	0.50
倉庫・運輸関連業	0.13
情報・通信業	8.80
卸売業	5.84
小売業	4.48
銀行業	6.48
証券、商品先物取引業	0.75
保険業	2.37
その他金融業	1.12
不動産業	1.87
サービス業	5.24
合 計	98.68

## (参考) 外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	3,468,400	22,656.97	78,583,464,503	18,657.21	64,710,667,164	4.55
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,529,100	39,956.56	61,097,590,387	31,666.37	48,421,052,025	3.40
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	1,978,800	20,732.54	41,025,553,371	13,118.75	25,959,399,320	1.82
4	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	1,294,100	17,911.05	23,178,702,076	12,647.76	16,367,468,545	1.15

5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1,197,100	18,030.22	21,583,980,356	12,779.53	15,298,383,144	1.07
6	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	537,440	34,129.25	18,342,428,003	25,000.66	13,436,355,463	0.94
7	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	899,500	11,100.83	9,985,199,053	14,816.17	13,327,147,793	0.93
8	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	201,870	67,732.69	13,673,199,294	63,381.02	12,794,726,770	0.90
9	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	574,800	44,826.18	25,766,091,585	21,744.13	12,498,526,039	0.88
10	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	567,400	23,326.74	13,235,593,932	21,136.14	11,992,645,836	0.84
11	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	632,900	18,005.16	11,395,471,498	18,152.29	11,488,585,037	0.80
12	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	280,800	45,539.59	12,787,517,954	40,097.34	11,259,334,504	0.79
13	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	352,900	28,849.53	10,181,000,382	29,890.67	10,548,419,913	0.74
14	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	514,800	19,952.20	10,271,396,248	18,397.57	9,471,071,456	0.66
15	アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	492,200	28,616.71	14,085,149,397	19,186.91	9,443,801,138	0.66
16	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	593,500	16,866.96	10,010,544,850	15,683.05	9,307,890,650	0.65
17	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	401,300	21,517.80	8,635,093,284	22,727.87	9,120,695,836	0.64
18	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	220,900	40,033.27	8,843,350,059	40,998.89	9,056,655,420	0.63
19	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	186,200	46,726.81	8,700,532,868	48,420.02	9,015,808,916	0.63
20	アメリカ	株式	ELI LILLY & CO.	医薬品	174,300	38,374.71	6,688,712,686	44,425.03	7,743,283,600	0.54
21	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	546,700	10,953.92	5,988,510,216	13,841.56	7,567,182,109	0.53
22	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	87,730	85,719.16	7,520,142,172	85,417.30	7,493,660,080	0.52
23	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	381,600	21,125.75	8,061,587,501	19,002.95	7,251,527,819	0.51
24	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,561,000	5,455.23	8,515,626,528	4,605.59	7,189,327,551	0.50
25	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	886,700	8,108.27	7,189,607,430	7,911.70	7,015,305,099	0.49
26	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	1,211,500	6,781.72	8,216,056,384	5,681.96	6,883,704,838	0.48
27	フランス	株式	LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	繊維・アパレル・贅沢品	59,740	92,868.74	5,547,979,060	113,078.12	6,755,287,367	0.47
28	アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	87,150	80,658.19	7,029,361,635	75,861.78	6,611,354,258	0.46
29	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	297,900	21,970.83	6,545,111,479	22,112.05	6,587,181,363	0.46
30	デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品	357,300	14,500.95	5,181,190,746	18,297.34	6,537,641,368	0.46

## 種類別及び業種別投資比率

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

株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.04
		メディア	0.81
		娯楽	1.18
		不動産管理・開発	0.35
		エネルギー設備・サービス	0.30
		石油・ガス・消耗燃料	5.37
		化学	2.09
		建設資材	0.26
		容器・包装	0.25
		金属・鉱業	1.83
		紙製品・林産品	0.10
		航空宇宙・防衛	1.69
		建設関連製品	0.58
		建設・土木	0.28
		電気設備	0.84
		コングロマリット	0.93
		機械	1.83
		商社・流通業	0.38
		商業サービス・用品	0.48
		航空貨物・物流サービス	0.54
		旅客航空輸送業	0.06
		海運業	0.06
		陸運・鉄道	1.02
		運送インフラ	0.11
		自動車部品	0.19
		自動車	1.54
		家庭用耐久財	0.29
		レジャー用品	0.02
		繊維・アパレル・贅沢品	1.42
		ホテル・レストラン・レジャー	1.95
		販売	0.11
		インターネット販売・通信販売	2.23
		複合小売り	0.46
		専門小売り	1.68
		食品・生活必需品小売り	1.50
		飲料	1.76
		食品	1.69
		タバコ	0.68
		家庭用品	1.11
		パーソナル用品	0.64
		ヘルスケア機器・用品	2.37
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.32		

	バイオテクノロジー	2.06
	医薬品	5.28
	銀行	6.22
	各種金融サービス	1.06
	保険	3.39
	情報技術サービス	3.73
	ソフトウェア	6.49
	通信機器	0.66
	コンピュータ・周辺機器	4.77
	電子装置・機器・部品	0.54
	半導体・半導体製造装置	4.53
	各種電気通信サービス	1.17
	無線通信サービス	0.28
	電力	1.85
	ガス	0.13
	総合公益事業	0.81
	水道	0.11
	消費者金融	0.41
	資本市場	3.34
	各種消費者サービス	0.00
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.15
	ヘルスケア・テクノロジー	0.04
	ライフサイエンス・ツール/サービス	1.50
	専門サービス	0.69
投資証券		2.31
合計		98.20

## (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	2,378,000	2,236.52	5,318,448,081	2,354.23	5,598,360,842	6.21
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	603,100	5,495.92	3,314,590,428	6,446.88	3,888,113,328	4.31
3	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF		5,517,100	619.80	3,419,512,172	692.46	3,820,423,616	4.24

4	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピューター・周辺機器	460,750	6,896.67	3,177,643,640	6,716.12	3,094,456,897	3.43
5	香港	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	インターネット販売・通信販売	1,430,380	1,529.34	2,187,546,573	1,814.85	2,595,925,143	2.88
6	香港	株式	MEITUAN-CLASS B	インターネット販売・通信販売	485,540	2,725.75	1,323,465,331	2,888.77	1,402,615,814	1.55
7	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	293,700	4,077.95	1,197,695,245	3,799.19	1,115,824,306	1.23
8	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	369,052	1,965.21	725,265,157	2,418.50	892,553,825	0.99
9	香港	株式	JD.COM, INC.	インターネット販売・通信販売	208,067	3,808.15	792,351,109	3,952.71	822,428,512	0.91
10	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	324,800	2,510.64	815,456,475	2,477.46	804,681,606	0.89
11	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	9,278,000	90.09	835,902,146	85.58	794,020,518	0.88
12	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	各種金融サービス	166,400	3,582.58	596,141,331	4,263.60	709,463,373	0.78
13	インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	497,000	1,183.67	588,284,689	1,325.83	658,939,995	0.73
14	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	610,500	821.07	501,266,129	1,013.98	619,037,843	0.68
15	アメリカ	株式	PINDUODUO INC ADR	インターネット販売・通信販売	48,790	5,744.98	280,297,644	12,675.16	618,421,081	0.68
16	サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	192,000	3,725.26	715,251,322	2,850.93	547,380,288	0.60
17	南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インターネット販売・通信販売	21,020	12,544.00	263,675,036	25,194.62	529,590,978	0.58
18	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・機器・部品	1,204,649	451.20	543,543,667	425.32	512,364,156	0.56
19	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	52,680	11,076.43	583,506,528	9,623.27	506,953,864	0.56
20	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術サービス	88,300	5,500.13	485,662,254	5,528.17	488,137,985	0.54

21	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュー タ・周辺機 器	79,400	6,183.22	490,947,968	6,079.53	482,714,682	0.53
22	香港	株式	BAIDU INC-CLASS A	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	212,760	1,819.39	387,094,682	2,266.06	482,127,989	0.53
23	台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半 導体製造装 置	146,538	3,380.94	495,437,463	3,204.00	469,508,983	0.52
24	香港	株式	NETEASE, INC.	娯楽	190,150	2,332.75	443,572,928	2,342.65	445,455,848	0.49
25	インドネ シア	株式	BANK CENTRAL ASIA	銀行	5,320,000	66.82	355,503,440	75.69	402,670,800	0.44
26	香港	株式	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	ライフサイ エンス・ ツール/ サービス	349,500	882.67	308,495,476	1,115.55	389,884,725	0.43
27	韓国	株式	SAMSUNG SDI CO,LTD	電子装置・ 機器・部品	5,307	62,995.82	334,318,856	72,890.70	386,830,945	0.42
28	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	7,660,000	50.02	383,180,103	50.11	383,892,390	0.42
29	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	5,440,000	74.84	407,133,553	69.93	380,419,200	0.42
30	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信 サービス	2,678,000	127.67	341,926,134	138.36	370,550,915	0.41

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	5.80
		メディア	0.16
		娯楽	1.03
		不動産管理・開発	1.67
		エネルギー設備・サービス	0.06
		石油・ガス・消耗燃料	4.22
		化学	2.75
		建設資材	0.89
		容器・包装	0.06
		金属・鉱業	3.97
		紙製品・林産品	0.15
		航空宇宙・防衛	0.13

建設関連製品	0.01
建設・土木	0.46
電気設備	0.71
コングロマリット	1.12
機械	0.36
商社・流通業	0.15
商業サービス・用品	0.05
航空貨物・物流サービス	0.24
旅客航空輸送業	0.22
海運業	0.36
陸運・鉄道	0.23
運送インフラ	0.71
自動車部品	0.47
自動車	2.53
家庭用耐久財	0.29
レジャー用品	0.02
繊維・アパレル・贅沢品	1.16
ホテル・レストラン・レジャー	1.17
インターネット販売・通信販売	7.01
複合小売り	0.18
専門小売り	0.77
食品・生活必需品小売り	1.30
飲料	1.07
食品	1.64
タバコ	0.33
家庭用品	0.08
パーソナル用品	0.72
ヘルスケア機器・用品	0.16
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.70
バイオテクノロジー	0.62
医薬品	1.05
銀行	14.16
各種金融サービス	1.50
保険	2.57
情報技術サービス	2.17
ソフトウェア	0.19

	通信機器	0.11
	コンピュータ・周辺機器	4.99
	電子装置・機器・部品	2.39
	半導体・半導体製造装置	8.62
	各種電気通信サービス	1.23
	無線通信サービス	1.55
	電力	1.01
	ガス	0.57
	総合公益事業	0.02
	水道	0.12
	消費者金融	0.56
	資本市場	0.69
	各種消費者サービス	0.17
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.72
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.84
	その他の業種	0.00
投資信託受益証券		4.24
投資証券		0.11
合 計		95.62

## (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347回	12,000,000,000	100.39	12,047,224,000	99.84	11,981,640,000	0.1	2027/6/20	1.40
2	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第365回	12,000,000,000	98.90	11,868,525,000	96.14	11,537,760,000	0.1	2031/12/20	1.34
3	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第153回	11,500,000,000	99.94	11,493,440,000	99.43	11,434,795,000	0.005	2027/6/20	1.33
4	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第363回	11,450,000,000	99.11	11,348,245,500	96.43	11,041,578,500	0.1	2031/6/20	1.29
5	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第364回	11,150,000,000	98.53	10,986,620,000	96.25	10,731,986,500	0.1	2031/9/20	1.25
6	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第139回	10,200,000,000	100.29	10,229,625,000	100.16	10,217,238,000	0.1	2024/3/20	1.19
7	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第350回	10,150,000,000	100.20	10,171,112,000	99.41	10,090,724,000	0.1	2028/3/20	1.18
8	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第360回	10,000,000,000	99.31	9,931,800,000	97.13	9,713,000,000	0.1	2030/9/20	1.13

9	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第361回	10,000,000,000	99.20	9,920,616,000	96.85	9,685,600,000	0.1	2030/12/20	1.13
10	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第141回	9,600,000,000	100.33	9,631,968,000	100.21	9,620,352,000	0.1	2024/9/20	1.12
11	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第362回	9,700,000,000	99.16	9,619,306,000	96.64	9,374,856,000	0.1	2031/3/20	1.09
12	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第338回	9,000,000,000	101.29	9,116,280,000	100.87	9,078,480,000	0.4	2025/3/20	1.06
13	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第359回	9,200,000,000	99.31	9,136,680,000	97.43	8,963,560,000	0.1	2030/6/20	1.04
14	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第346回	8,600,000,000	100.38	8,633,382,000	99.95	8,596,388,000	0.1	2027/3/20	1.00
15	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第148回	7,300,000,000	100.00	7,300,000,000	99.88	7,291,313,000	0.005	2026/6/20	0.85
16	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第339回	7,000,000,000	101.35	7,094,810,000	100.94	7,065,800,000	0.4	2025/6/20	0.82
17	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第345回	7,000,000,000	100.35	7,024,710,000	100.05	7,004,060,000	0.1	2026/12/20	0.81
18	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第367回	7,000,000,000	100.03	7,002,640,000	98.90	6,923,490,000	0.2	2032/6/20	0.80
19	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第358回	6,970,000,000	99.04	6,903,543,000	97.85	6,820,284,400	0.1	2030/3/20	0.79
20	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第348回	6,800,000,000	100.25	6,817,030,000	99.74	6,782,796,000	0.1	2027/9/20	0.79
21	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第334回	6,600,000,000	101.42	6,693,786,000	100.87	6,657,882,000	0.6	2024/6/20	0.77
22	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第351回	6,500,000,000	100.06	6,503,935,000	99.25	6,451,640,000	0.1	2028/6/20	0.75
23	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第344回	6,400,000,000	100.37	6,424,256,000	100.14	6,409,216,000	0.1	2026/9/20	0.74
24	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第150回	6,300,000,000	100.03	6,301,890,000	99.69	6,280,470,000	0.005	2026/12/20	0.73
25	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第143回	6,070,000,000	100.40	6,094,280,000	100.23	6,084,203,800	0.1	2025/3/20	0.71
26	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第343回	6,000,000,000	100.40	6,024,000,000	100.20	6,012,120,000	0.1	2026/6/20	0.70
27	日本	国債証券	国庫債券 利付(20年)第174回	6,970,000,000	95.35	6,646,218,000	85.85	5,984,302,600	0.4	2040/9/20	0.69
28	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第341回	5,900,000,000	101.13	5,966,800,000	100.82	5,948,439,000	0.3	2025/12/20	0.69
29	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第335回	5,600,000,000	101.30	5,673,178,000	100.86	5,648,440,000	0.5	2024/9/20	0.66
30	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第147回	5,600,000,000	100.03	5,602,184,000	99.93	5,596,472,000	0.005	2026/3/20	0.65

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	80.96
地方債証券	6.48
特殊債証券	7.33
社債券	4.71
合計	99.49

## (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	7,000,000	12,743.24	892,027,467	12,721.58	890,511,177	3.125	2027/8/31	0.80
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	13,660.06	887,904,514	13,663.67	888,138,829	4.125	2032/11/15	0.80
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	11,746.92	704,815,760	11,738.73	704,323,899	0.375	2026/1/31	0.63
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	12,771.02	702,406,381	12,691.26	698,019,542	2.5	2024/5/15	0.63
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	10,677.06	672,655,400	10,576.22	666,302,136	0.625	2030/8/15	0.60
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,340.04	667,002,393	13,320.42	666,021,299	4	2029/10/31	0.60
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	12,550.12	640,056,262	12,475.17	636,233,848	2	2025/2/15	0.57
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,896.14	644,807,203	12,670.36	633,518,482	3.125	2028/11/15	0.57
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,851.16	592,558,052	11,784.09	589,204,542	0.25	2025/10/31	0.53
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,787.14	589,357,453	11,676.55	583,827,743	0.625	2026/7/31	0.52
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	11,996.63	563,841,781	12,121.98	569,733,402	2.375	2029/3/31	0.51
12	ドイツ	国債証券	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	3,800,000	14,075.67	534,875,541	14,039.92	533,516,990	2.2	2024/12/12	0.48
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,200,000	10,184.43	529,590,454	10,029.37	521,527,297	2.375	2051/5/15	0.47
14	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	27,000,000	1,921.45	518,791,614	1,918.69	518,047,272	2.28	2025/11/25	0.46
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	14,446.71	505,635,033	14,666.66	513,333,184	5.375	2031/2/15	0.46
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,618.28	504,731,352	12,578.88	503,155,469	2	2024/6/30	0.45
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,418.02	496,721,200	12,388.02	495,520,937	0.375	2024/4/15	0.44
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,299.21	491,968,722	12,247.10	489,884,268	0.375	2024/8/15	0.44
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,158.59	486,343,763	12,219.33	488,773,237	2.75	2032/8/15	0.44
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,300,000	11,297.13	485,776,953	11,235.70	483,135,464	0.5	2027/10/31	0.43
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,900,000	12,566.12	490,078,976	12,368.14	482,357,757	2.875	2032/5/15	0.43
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,400,000	11,090.08	487,963,907	10,949.79	481,791,046	1.375	2031/11/15	0.43
23	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,300,000	14,856.19	490,254,428	14,537.50	479,737,638	3.5	2026/4/25	0.43
24	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,320,000	14,561.33	483,436,403	14,321.76	475,482,657	3.8	2024/4/30	0.42

25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,911.50	476,460,131	11,842.70	473,708,023	0.25	2025/8/31	0.42
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	12,493.52	474,753,816	12,332.21	468,624,265	2.375	2027/5/15	0.42
27	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,500,000	13,479.47	471,781,541	13,344.86	467,070,141	2.8	2029/6/15	0.42
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,650.05	466,002,152	11,544.55	461,782,230	1.25	2028/4/30	0.41
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,700,000	12,600.54	466,220,293	12,477.72	461,675,698	2.75	2028/2/15	0.41
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,372.62	454,904,949	11,375.35	455,014,125	1.125	2028/8/31	0.41

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.96
合計	98.96

## (参考) 外国債券マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	157,450,000	15,345.55	24,161,573,412	14,666.66	23,092,659,962	5.375	2031/2/15	3.45
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	140,750,000	14,649.06	20,618,557,523	14,107.57	19,856,415,448	5.25	2028/11/15	2.97
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	132,000,000	14,126.01	18,646,336,757	13,808.92	18,227,779,581	6	2026/2/15	2.73
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	83,400,000	15,623.70	13,030,173,786	15,227.27	12,699,547,380	6.25	2030/5/15	1.90
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	86,600,000	12,977.97	11,238,930,315	12,691.26	10,990,634,981	2.5	2024/5/15	1.64
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	75,000,000	12,302.01	9,226,512,225	12,042.99	9,032,243,700	1.625	2026/11/30	1.35
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	67,500,000	12,667.82	8,550,779,555	12,332.21	8,324,246,810	2.375	2027/5/15	1.24
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	62,000,000	12,918.59	8,009,528,305	12,631.12	7,831,298,663	2.375	2024/8/15	1.17
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	75,850,000	10,819.12	8,206,302,978	10,029.37	7,607,277,988	2.375	2051/5/15	1.13
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	53,600,000	12,910.92	6,920,255,106	12,529.45	6,715,786,060	2.875	2028/5/15	1.00
11	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	40,150,000	18,012.94	7,232,197,842	16,552.61	6,645,873,237	5.5	2029/4/25	0.99
12	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	38,850,000	18,880.65	7,335,135,911	16,724.83	6,497,597,502	4.75	2035/4/25	0.97
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,850,000	12,920.91	6,570,287,028	12,665.27	6,440,290,902	2.125	2024/3/31	0.96
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,300,000	12,759.18	6,545,460,261	12,446.37	6,384,992,296	2.25	2025/11/15	0.95
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	44,200,000	14,785.12	6,535,025,514	14,408.78	6,368,681,037	6.125	2027/11/15	0.95
16	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	40,550,000	16,607.20	6,734,219,983	15,472.50	6,274,101,994	5.25	2029/11/1	0.93
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,800,000	13,044.72	6,365,826,721	12,685.40	6,190,477,005	2.875	2025/4/30	0.92
18	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	35,450,000	17,236.92	6,110,488,999	16,001.94	5,672,688,581	6.5	2027/11/1	0.84
19	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	34,000,000	17,992.61	6,117,489,804	16,519.51	5,616,633,821	6	2029/1/31	0.84

20	ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	32,100,000	19,091.46	6,128,360,240	17,414.00	5,589,895,091	5.5	2031/1/4	0.83
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,700,000	12,981.76	5,673,031,305	12,751.97	5,572,611,239	2.25	2023/12/31	0.83
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,750,000	13,073.42	5,719,624,347	12,701.45	5,556,887,890	3	2025/9/30	0.83
23	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	36,400,000	15,598.04	5,677,689,047	14,537.50	5,291,651,529	3.5	2026/4/25	0.79
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,050,000	12,844.34	5,401,048,977	12,575.31	5,287,921,907	2.25	2024/11/15	0.79
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,300,000	12,771.78	5,402,466,828	12,450.71	5,266,650,478	2.375	2026/4/30	0.78
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,700,000	11,025.73	5,479,789,783	10,417.21	5,177,355,389	2.5	2046/2/15	0.77
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	44,800,000	12,003.21	5,377,439,998	11,457.91	5,133,146,299	3	2044/11/15	0.76
28	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	32,050,000	16,862.62	5,404,472,018	15,592.08	4,997,262,836	5.9	2026/7/30	0.74
29	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	27,950,000	18,854.37	5,269,798,204	17,100.44	4,779,575,216	5.75	2032/7/30	0.71
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	44,700,000	11,024.69	4,928,037,127	10,478.37	4,683,832,228	2.5	2045/2/15	0.70

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.72
合 計	98.72

## (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	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	10,600,000	1,751.77	185,687,907	1,762.29	186,803,427		2026/1/1	2.33
2	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	8,000,000	1,940.82	155,265,715	1,933.08	154,646,491	2.47	2024/9/2	1.93
3	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,800,000	1,948.35	151,971,650	1,934.47	150,889,392	2.69	2026/8/12	1.88
4	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	7,000,000	2,104.48	147,314,270	2,089.42	146,259,777		2024/1/1	1.83
5	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,200,000	1,951.44	140,504,038	1,944.59	140,010,834	2.91	2028/10/14	1.75
6	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	20,000,000	681.85	136,371,395	656.95	131,390,333	7.75	2031/5/29	1.64
7	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	6,400,000	2,043.35	130,774,946	2,037.21	130,381,767		2024/7/1	1.63
8	南アフリ カ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	15,300,000	820.48	125,534,565	809.26	123,817,979	10.5	2026/12/21	1.54
9	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,800,000	2,545.10	122,165,240	2,505.93	120,284,902	2.75	2029/10/25	1.50
10	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000	1,961.63	117,698,033	1,954.41	117,264,744	3.02	2031/5/27	1.46
11	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000	3,026.69	105,934,161	2,969.89	103,946,455	4	2023/10/25	1.30
12	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,100,000	733.63	103,442,673	696.78	98,247,261	10	2024/12/5	1.22
13	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	391,000	2,501.25	97,799,265	2,450.09	95,798,606	10	2025/1/1	1.19
14	南アフリ カ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,600,000	695.59	94,601,072	687.72	93,531,042	8	2030/1/31	1.17

15	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,500,000	645.61	93,614,287	629.69	91,305,676	5.75	2026/3/5	1.14
16	マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	2,850,000	3,106.86	88,545,777	3,119.27	88,899,259	3.899	2027/11/16	1.11
17	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,300,000	648.82	86,293,800	659.75	87,747,215	8.25	2032/3/31	1.09
18	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,100,000	2,804.11	86,927,435	2,828.36	87,679,396	2.25	2024/10/25	1.09
19	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,200,000	644.10	91,462,955	595.54	84,567,106	8.75	2048/2/28	1.05
20	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	14,000,000	561.61	78,626,081	568.19	79,547,124	0.45	2023/10/25	0.99
21	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000	3,095.91	77,397,804	3,086.00	77,150,096	3.733	2028/6/15	0.96
22	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000	3,150.60	75,614,481	3,115.82	74,779,717	3.9	2026/11/30	0.93
23	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,400,000	2,000.21	68,007,278	2,137.57	72,677,539	1.75	2032/4/25	0.90
24	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,100,000	1,779.74	72,969,732	1,755.66	71,982,219		2025/7/1	0.90
25	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,300,000	724.71	74,645,615	688.46	70,911,903	8.5	2029/5/31	0.88
26	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000	3,165.68	69,644,962	3,112.95	68,485,035	3.955	2025/9/15	0.85
27	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000	3,053.52	67,177,581	3,100.14	68,203,235	3.885	2029/8/15	0.85
28	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,600,000	676.94	71,756,699	639.08	67,742,534	8	2047/11/7	0.84
29	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,700,000	2,409.48	65,056,032	2,464.75	66,548,412	0.25	2026/10/25	0.83
30	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,660,000	627.46	66,887,379	623.70	66,487,006	7	2031/2/28	0.83

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.67
合計	97.67

## 【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 - KOKUSAI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(2023年03月限)	買建	249	日本円	4,777,061,456	4,918,995,000	1.02

## (参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴマーカンタイル取引所	E-mini S&P500株価指数先物(2023年03月限)	買建	702	米ドル	138,438,262.5	18,062,040,106	141,540,750	18,466,821,636	1.30
	カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2023年03月限)	買建	39	カナダドル	9,433,900	919,144,877	9,689,160	944,014,855	0.06
	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(2023年03月限)	買建	445	ユーロ	17,863,220	2,528,717,424	18,538,700	2,624,338,368	0.18
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200株価指数先物(2023年03月限)	買建	38	豪ドル	6,841,750	628,962,077	7,055,650	648,625,898	0.04
	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(2023年03月限)	買建	96	英ポンド	7,346,310	1,184,739,412	7,452,960	1,201,938,849	0.08
	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(2023年03月限)	買建	50	スイスフラン	5,516,810	778,201,221	5,648,500	796,777,404	0.05

## (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	MSCIエマージング・マーケット指数先物(2023年03月限)	買建	455	米ドル	23,802,655	3,105,532,415	23,830,625	3,109,181,586	3.45
	香港	香港先物取引所	MSCI China A 50 Connect 指数先物(2023年02月限)	買建	96	米ドル	5,559,980	725,410,590	5,700,960	743,804,249	0.82

## (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。

（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

2023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
第6計算期間 (2021年12月27日)	150	150	1.3015	1.3015
第7計算期間 (2022年12月26日)	143	143	1.1958	1.1958
2022年 1月末日	147		1.2734	
2月末日	146		1.2579	
3月末日	150		1.2763	
4月末日	148		1.2523	
5月末日	148		1.2493	
6月末日	145		1.2333	
7月末日	147		1.2548	
8月末日	147		1.2457	
9月末日	142		1.2019	
10月末日	145		1.2226	
11月末日	147		1.2287	
12月末日	143		1.1925	
2023年 1月末日	145		1.2150	

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

2023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
第6計算期間 (2021年12月27日)	59	59	1.3469	1.3469
第7計算期間 (2022年12月26日)	63	63	1.2541	1.2541
2022年 1月末日	58		1.3136	
2月末日	58		1.2985	
3月末日	60		1.3320	
4月末日	60		1.3040	
5月末日	60		1.3030	
6月末日	61		1.2892	
7月末日	62		1.3118	
8月末日	62		1.3086	
9月末日	60		1.2584	
10月末日	62		1.2903	
11月末日	65		1.2970	
12月末日	63		1.2518	
2023年 1月末日	66		1.2825	

#### 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

2023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
第6計算期間 (2021年12月27日)	39	39	1.3648	1.3648
第7計算期間 (2022年12月26日)	39	39	1.2801	1.2801
2022年 1月末日	38		1.3281	
2月末日	38		1.3134	
3月末日	40		1.3562	
4月末日	39		1.3250	

5月末日	39	1.3255
6月末日	39	1.3122
7月末日	40	1.3362
8月末日	40	1.3370
9月末日	39	1.2816
10月末日	40	1.3209
11月末日	41	1.3297
12月末日	39	1.2786
2023年 1月末日	40	1.3158

## 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

2023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
第6計算期間 (2021年12月27日)	30	30	1.3742	1.3742
第7計算期間 (2022年12月26日)	32	32	1.2940	1.2940
2022年 1月末日	29		1.3354	
2月末日	29		1.3210	
3月末日	31		1.3690	
4月末日	31		1.3360	
5月末日	31		1.3373	
6月末日	31		1.3243	
7月末日	32		1.3490	
8月末日	32		1.3521	
9月末日	31		1.2940	
10月末日	32		1.3370	
11月末日	33		1.3468	
12月末日	32		1.2928	
2023年 1月末日	34		1.3332	

## 【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
第6計算期間	2020年12月29日 ~ 2021年12月27日	0.0000円
第7計算期間	2021年12月28日 ~ 2022年12月26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
第6計算期間	2020年12月29日 ~ 2021年12月27日	0.0000円
第7計算期間	2021年12月28日 ~ 2022年12月26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
第6計算期間	2020年12月29日 ~ 2021年12月27日	0.0000円
第7計算期間	2021年12月28日 ~ 2022年12月26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
第6計算期間	2020年12月29日 ~ 2021年12月27日	0.0000円
第7計算期間	2021年12月28日 ~ 2022年12月26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%
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	5.4%
第7計算期間	2021年12月28日～2022年12月26日	8.1%

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%
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	8.0%
第7計算期間	2021年12月28日～2022年12月26日	6.9%

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%
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	9.4%
第7計算期間	2021年12月28日～2022年12月26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。

#### 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%
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	10.3%
第7計算期間	2021年12月28日～2022年12月26日	5.8%

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

#### （４）【設定及び解約の実績】

#### 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
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	10,754,745	1,432,534	115,529,058
第7計算期間	2021年12月28日～2022年12月26日	8,316,670	3,620,858	120,224,870

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
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	7,570,614	3,926,197	43,860,554
第7計算期間	2021年12月28日～2022年12月26日	7,523,978	822,143	50,562,389

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
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	3,237,613	4,394,649	28,849,788
第7計算期間	2021年12月28日～2022年12月26日	2,250,616	95,937	31,004,467

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
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	4,315,249	953,733	21,870,142
第7計算期間	2021年12月28日～2022年12月26日	4,045,002	850,461	25,064,683

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

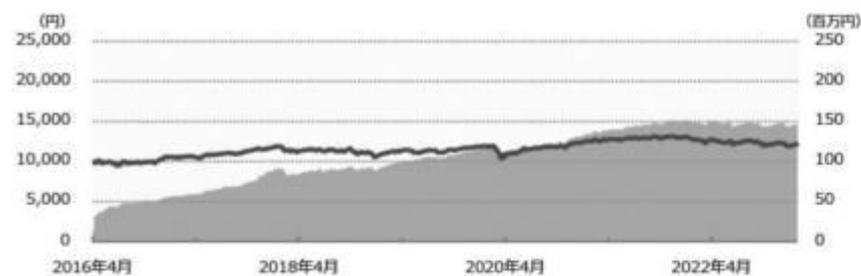


# 運用実績 (2023年1月31日現在)

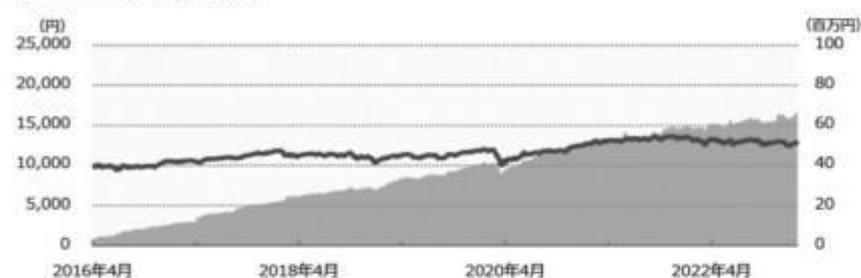
## ■ 基準価額・純資産の推移 (日次：設定来)

— 基準価額（分配後、1万口あたり）（左軸） — 純資産総額（右軸）

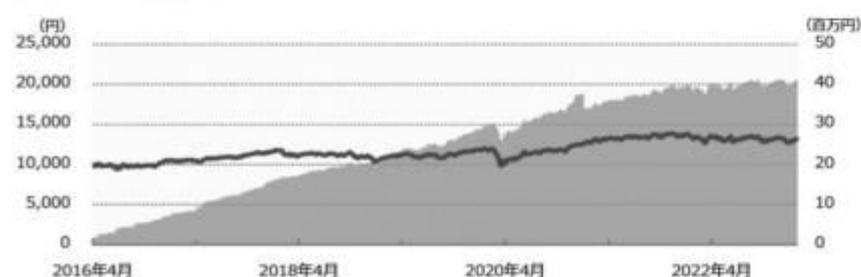
### ■ 2026-2028年目標型



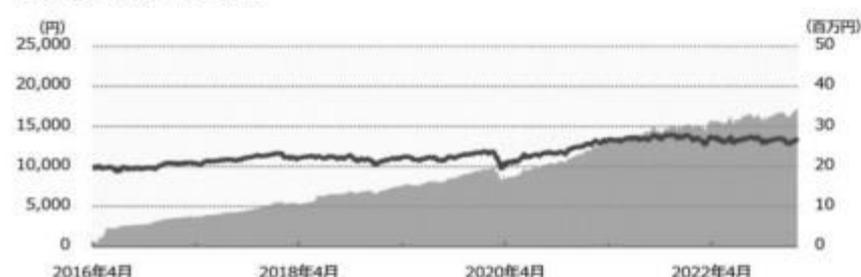
### ■ 2029-2031年目標型



### ■ 2032-2034年目標型



### ■ 2035-2037年目標型



## ■ 分配の推移

(1万口あたり、課税前)

### ■ 2026-2028年目標型

2022年12月	0 円
2021年12月	0 円
2020年12月	0 円
2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
設定来累計	0 円

### ■ 2029-2031年目標型

2022年12月	0 円
2021年12月	0 円
2020年12月	0 円
2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
設定来累計	0 円

### ■ 2032-2034年目標型

2022年12月	0 円
2021年12月	0 円
2020年12月	0 円
2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
設定来累計	0 円

### ■ 2035-2037年目標型

2022年12月	0 円
2021年12月	0 円
2020年12月	0 円
2019年12月	0 円
2018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	15.3	21.7	27.1	29.6
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	8.9	12.6	15.7	17.2
新興国株式マザーファンド	6.5	9.3	11.5	12.6
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	29.3	20.6	15.2	12.7
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	29.8	21.0	15.5	13.0
外国債券マザーファンド	7.6	11.2	11.3	11.3
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	2.3	3.5	3.6	3.5

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	0.8	1.0	1.1
2	ソニーグループ	電気機器	0.4	0.6	0.8	0.8
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.3	0.4	0.6	0.6
4	キーエンス	電気機器	0.3	0.4	0.6	0.6
5	日本電信電話	情報・通信業	0.3	0.4	0.5	0.5

・「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	0.4	0.6	0.7	0.8
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.3	0.4	0.5	0.6
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.2	0.2	0.3	0.3
4	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.1	0.2	0.2
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.1	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	0.4	0.6	0.7	0.8
2	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.3	0.4	0.5	0.5
3	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	—	0.3	0.4	0.5	0.5
4	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.2	0.3	0.4	0.4
5	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	インターネット販売・通信販売	0.2	0.3	0.3	0.4

## ・「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347回	国債証券	0.4	0.3	0.2	0.2
2	国庫債券 利付（10年）第365回	国債証券	0.4	0.3	0.2	0.2
3	国庫債券 利付（5年）第153回	国債証券	0.4	0.3	0.2	0.2
4	国庫債券 利付（10年）第363回	国債証券	0.4	0.3	0.2	0.2
5	国庫債券 利付（10年）第364回	国債証券	0.4	0.3	0.2	0.2

## ・「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	0.2	0.1	0.1
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.2	0.1	0.1
3	US TREASURY N/B	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	US TREASURY N/B	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

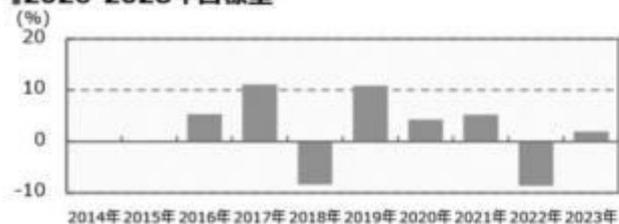
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.3	0.4	0.4	0.4
2	US TREASURY BOND	国債証券	0.2	0.3	0.3	0.3
3	US TREASURY BOND	国債証券	0.2	0.3	0.3	0.3
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.2	0.2	0.2
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.2	0.2	0.2

## ・「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	LETRA TESOURO NACIONAL	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
2	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0	0.1	0.1	0.1
3	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0	0.1	0.1	0.1
4	LETRA TESOURO NACIONAL	国債証券	0.0	0.1	0.1	0.1
5	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0	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。
- ・2023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。

- ・取得申込みの受付けについては、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け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号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があります。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けを中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付け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時までには、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 <sup>1</sup> の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> における以下のいずれかの価額で評価します。 <sup>2</sup> 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く） 価格情報会社の提供する価額
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行いません。

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

## （２）【保管】

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

## （３）【信託期間】

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るときは、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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- ( ) 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、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ( ) 上記( )の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- ( ) 上記( )から( )までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記( )から( )までに規定するこの信託契約の解約の手続を行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、知っている受益者に対して交付します。

(d) 信託約款の変更等

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

その理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知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7期計算期間(2021年12月28日から2022年12月26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6期 (2021年12月27日現在)	第7期 (2022年12月26日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	895,932	892,389
親投資信託受益証券	150,207,527	143,640,556
未収入金	25,256	-
流動資産合計	151,128,715	144,532,945
<b>資産合計</b>	151,128,715	144,532,945
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払受託者報酬	40,423	40,123
未払委託者報酬	727,475	722,224
未払利息	-	1
その他未払費用	2,376	2,361
流動負債合計	770,274	764,709
<b>負債合計</b>	770,274	764,709
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	115,529,058	120,224,870
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	34,829,383	23,543,366
（分配準備積立金）	23,725,539	24,406,639
元本等合計	150,358,441	143,768,236
<b>純資産合計</b>	150,358,441	143,768,236
<b>負債純資産合計</b>	151,128,715	144,532,945

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自	2020年12月29日	自	2021年12月28日
	至	2021年12月27日	至	2022年12月26日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		8,757,890		10,921,147
<b>営業収益合計</b>		<b>8,757,890</b>		<b>10,921,147</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		18		62
受託者報酬		78,334		80,741
委託者報酬		1,409,764		1,453,331
その他費用		4,583		4,742
<b>営業費用合計</b>		<b>1,492,699</b>		<b>1,538,876</b>
営業利益又は営業損失（ ）		7,265,191		12,460,023
経常利益又は経常損失（ ）		7,265,191		12,460,023
当期純利益又は当期純損失（ ）		7,265,191		12,460,023
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（ ）		69,331		161,750
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		24,929,466		34,829,383
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>3,039,018</b>		<b>2,085,683</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,039,018		2,085,683
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>334,961</b>		<b>1,073,427</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		334,961		1,073,427
<b>分配金</b>		<b>-</b>		<b>-</b>
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		34,829,383		23,543,366

## （ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年12月28日から2022年12月 26日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

第6期 2021年12月27日現在	第7期 2022年12月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 115,529,058口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 120,224,870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 1.3015円 (10,000口当たり純資産額) (13,015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 1.1958円 (10,000口当たり純資産額) (11,958円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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>2,175,141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>5,020,719円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>11,837,403円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>16,529,679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>35,562,942円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>115,529,058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>3,078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	2,175,141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	5,020,719円	収益調整金額	C	11,837,403円	分配準備積立金額	D	16,529,679円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	35,562,942円	当ファンドの期末残存口数	F	115,529,058口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	3,078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>1,383,062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>14,015,077円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>23,023,577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>38,421,716円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>120,224,870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>3,195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	1,383,062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	14,015,077円	分配準備積立金額	D	23,023,577円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	38,421,716円	当ファンドの期末残存口数	F	120,224,870口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	3,195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	2,175,141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	5,020,719円																																																											
収益調整金額	C	11,837,403円																																																											
分配準備積立金額	D	16,529,679円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	35,562,942円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	115,529,058口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	3,078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	1,383,062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	14,015,077円																																																											
分配準備積立金額	D	23,023,577円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	38,421,716円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	120,224,870口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	3,195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6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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6期 2021年12月27日現在	第7期 2022年12月26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6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26日
期首元本額 106,206,847円	期首元本額 115,529,058円
期中追加設定元本額 10,754,745円	期中追加設定元本額 8,316,670円
期中一部解約元本額 1,432,534円	期中一部解約元本額 3,620,858円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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	7,088,720	10,808,486
合計	7,088,720	10,808,486

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2022年12月26日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2022年12月26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	10,410,738	21,481,516	
		外国債券マザーファンド	4,449,540	10,938,749	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	2,801,809	12,245,866	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	34,349,023	43,444,644	
		新興国株式マザーファンド	5,962,286	8,886,191	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	2,425,088	3,455,992	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	42,253,790	43,187,598	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	102,652,274	143,640,556 100.0%	
合計			143,640,556		

(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6期 (2021年12月27日現在)	第7期 (2022年12月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	347,478	387,205
親投資信託受益証券	59,025,755	63,349,498
流動資産合計	59,373,233	63,736,703
資産合計	59,373,233	63,736,703
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	15,529	17,219
未払委託者報酬	279,488	309,994
その他未払費用	870	954
流動負債合計	295,887	328,167
負債合計	295,887	328,167
純資産の部		
元本等		
元本	43,860,554	50,562,389
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,216,792	12,846,147
（分配準備積立金）	9,539,443	10,085,174
元本等合計	59,077,346	63,408,536
純資産合計	59,077,346	63,408,536
負債純資産合計	59,373,233	63,736,703

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自	2020年12月29日	自	2021年12月28日
	至	2021年12月27日	至	2022年12月26日
営業収益				
有価証券売買等損益		4,694,687		3,788,584
その他収益		-		1
営業収益合計		4,694,687		3,788,583
営業費用				
支払利息		8		6
受託者報酬		30,090		33,575
委託者報酬		541,574		604,310
その他費用		1,665		1,883
営業費用合計		573,337		639,774
営業利益又は営業損失（ ）		4,121,350		4,428,357
経常利益又は経常損失（ ）		4,121,350		4,428,357
当期純利益又は当期純損失（ ）		4,121,350		4,428,357
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（ ）		243,202		54,203
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		9,922,426		15,216,792
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,387,905		2,282,578
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,387,905		2,282,578
剰余金減少額又は欠損金増加額		971,687		279,069
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		971,687		279,069
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		15,216,792		12,846,147

## （ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年12月28日から2022年12月 26日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

第6期 2021年12月27日現在		第7期 2022年12月26日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	43,860,554口	1. 計算期間の末日における受益権の総数	50,562,389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		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	1.3469円	1口当たり純資産額	1.2541円
(10,000口当たり純資産額)	(13,469円)	(10,000口当たり純資産額)	(12,541円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日			第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	932,456円	費用控除後の配当等収益額	A	703,944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	2,945,692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	6,432,403円	収益調整金額	C	9,048,698円
分配準備積立金額	D	5,661,295円	分配準備積立金額	D	9,381,230円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,971,846円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	19,133,872円
当ファンドの期末残存口数	F	43,860,554口	当ファンドの期末残存口数	F	50,562,389口
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	3,641円	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	3,784円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	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6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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6期 2021年12月27日現在	第7期 2022年12月26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6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26日
期首元本額 40,216,137円	期首元本額 43,860,554円
期中追加設定元本額 7,570,614円	期中追加設定元本額 7,523,978円
期中一部解約元本額 3,926,197円	期中一部解約元本額 822,143円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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	3,768,428	3,784,306
合計	3,768,428	3,784,306

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2022年12月26日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2022年12月26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	6,537,343	13,489,153	
		外国債券マザーファンド	2,912,427	7,159,910	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,760,938	7,696,531	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	10,781,883	13,636,925	
		新興国株式マザーファンド	3,739,264	5,572,999	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	1,570,069	2,237,505	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	13,263,355	13,556,475	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	40,565,279	63,349,498 100.0%	
合計			63,349,498		

(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6期 (2021年12月27日現在)	第7期 (2022年12月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	234,036	246,459
親投資信託受益証券	39,340,566	39,652,739
流動資産合計	39,574,602	39,899,198
資産合計	39,574,602	39,899,198
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	10,501	11,073
未払委託者報酬	189,011	199,252
その他未払費用	574	590
流動負債合計	200,086	210,915
負債合計	200,086	210,915
純資産の部		
元本等		
元本	28,849,788	31,004,467
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	10,524,728	8,683,816
(分配準備積立金)	7,138,223	7,611,514
元本等合計	39,374,516	39,688,283
純資産合計	39,374,516	39,688,283
負債純資産合計	39,574,602	39,899,198

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自	2020年12月29日	自	2021年12月28日
	至	2021年12月27日	至	2022年12月26日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		3,549,935		2,132,797
<b>営業収益合計</b>		<b>3,549,935</b>		<b>2,132,797</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		13		-
受託者報酬		20,281		21,829
委託者報酬		364,961		392,743
その他費用		1,125		1,169
<b>営業費用合計</b>		<b>386,380</b>		<b>415,741</b>
営業利益又は営業損失（ ）		3,163,555		2,548,538
経常利益又は経常損失（ ）		3,163,555		2,548,538
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,163,555		2,548,538
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（ ）		33,882		4,098
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		7,439,997		10,524,728
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>1,029,524</b>		<b>738,041</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,029,524		738,041
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>1,074,466</b>		<b>34,513</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,074,466		34,513
<b>分配金</b>		<b>-</b>		<b>-</b>
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		10,524,728		8,683,816

## （ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年12月28日から2022年12月 26日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

第6期 2021年12月27日現在	第7期 2022年12月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 28,849,788口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 31,004,467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 1.3648円 (10,000口当たり純資産額) (13,648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 1.2801円 (10,000口当たり純資産額) (12,801円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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>659,819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>2,469,854円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>3,773,421円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>4,008,550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>10,911,644円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>28,849,788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>3,782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	659,819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	2,469,854円	収益調整金額	C	3,773,421円	分配準備積立金額	D	4,008,550円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,911,644円	当ファンドの期末残存口数	F	28,849,788口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	3,782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>495,694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>4,616,355円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>7,115,820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>12,227,869円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>31,004,467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>3,943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	495,694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	4,616,355円	分配準備積立金額	D	7,115,820円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,227,869円	当ファンドの期末残存口数	F	31,004,467口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	3,943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	659,819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	2,469,854円																																																											
収益調整金額	C	3,773,421円																																																											
分配準備積立金額	D	4,008,550円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,911,644円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	28,849,788口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	3,782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	495,694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	4,616,355円																																																											
分配準備積立金額	D	7,115,820円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,227,869円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	31,004,467口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	3,943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6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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6期 2021年12月27日現在	第7期 2022年12月26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6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26日
期首元本額 30,006,824円	期首元本額 28,849,788円
期中追加設定元本額 3,237,613円	期中追加設定元本額 2,250,616円
期中一部解約元本額 4,394,649円	期中一部解約元本額 95,937円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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	3,056,902	2,154,093
合計	3,056,902	2,154,093

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2022年12月26日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2022年12月26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	5,141,694	10,609,371	
		外国債券マザーファンド	1,830,763	4,500,747	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,379,318	6,028,585	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	5,034,987	6,368,251	
		新興国株式マザーファンド	2,958,058	4,408,689	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	986,963	1,406,520	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	6,193,696	6,330,576	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	23,525,479	39,652,739 100.0%	
合計			39,652,739		

(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6期 (2021年12月27日現在)	第7期 (2022年12月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	179,691	202,267
親投資信託受益証券	30,024,981	32,401,609
流動資産合計	30,204,672	32,603,876
資産合計	30,204,672	32,603,876
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	7,941	8,913
未払委託者報酬	142,865	160,374
その他未払費用	405	445
流動負債合計	151,211	169,732
負債合計	151,211	169,732
純資産の部		
元本等		
元本	21,870,142	25,064,683
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	8,183,319	7,369,461
(分配準備積立金)	5,432,233	5,653,793
元本等合計	30,053,461	32,434,144
純資産合計	30,053,461	32,434,144
負債純資産合計	30,204,672	32,603,876

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自	2020年12月29日 至 2021年12月27日	自	2021年12月28日 至 2022年12月26日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		2,814,020		1,548,399
<b>営業収益合計</b>		<b>2,814,020</b>		<b>1,548,399</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		2		-
受託者報酬		15,015		17,308
委託者報酬		270,002		311,416
その他費用		786		867
<b>営業費用合計</b>		<b>285,805</b>		<b>329,591</b>
営業利益又は営業損失（ ）		2,528,215		1,877,990
経常利益又は経常損失（ ）		2,528,215		1,877,990
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,528,215		1,877,990
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（ ）		106,894		6,709
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,547,448		8,183,319
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,457,366		1,369,333
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,457,366		1,369,333
剰余金減少額又は欠損金増加額		242,816		311,910
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		242,816		311,910
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,183,319		7,369,461

## （３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年12月28日から2022年12月 26日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

第6期 2021年12月27日現在	第7期 2022年12月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 21,870,142口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 25,064,683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 1.3742円 (10,000口当たり純資産額) (13,742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 1.2940円 (10,000口当たり純資産額) (12,940円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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>495,986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>1,925,335円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>3,025,834円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>3,010,912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>8,458,067円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>21,870,142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>3,867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	495,986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	1,925,335円	収益調整金額	C	3,025,834円	分配準備積立金額	D	3,010,912円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,458,067円	当ファンドの期末残存口数	F	21,870,142口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	3,867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>407,086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>4,459,570円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>5,246,707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>10,113,363円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>25,064,683口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象 額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>4,034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	407,086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	4,459,570円	分配準備積立金額	D	5,246,707円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,113,363円	当ファンドの期末残存口数	F	25,064,683口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	4,034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	495,986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	1,925,335円																																																											
収益調整金額	C	3,025,834円																																																											
分配準備積立金額	D	3,010,912円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,458,067円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	21,870,142口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	3,867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	407,086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	4,459,570円																																																											
分配準備積立金額	D	5,246,707円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,113,363円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	25,064,683口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	4,034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6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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6期 2021年12月27日現在	第7期 2022年12月26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6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26日
期首元本額 18,508,626円	期首元本額 21,870,142円
期中追加設定元本額 4,315,249円	期中追加設定元本額 4,045,002円
期中一部解約元本額 953,733円	期中一部解約元本額 850,461円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	第7期 自 2021年12月28日 至 2022年12月26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	2,379,091	1,574,690
合計	2,379,091	1,574,690

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2022年12月26日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2022年12月26日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	4,585,061	9,460,814	
		外国債券マザーファンド	1,498,958	3,685,038	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,229,941	5,375,703	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	3,487,818	4,411,392	
		新興国株式マザーファンド	2,637,964	3,931,621	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	808,064	1,151,572	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	4,290,646	4,385,469	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	18,538,452	32,401,609 100.0%	
合計			32,401,609		

(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)

(2022年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	18,181,194,296
株式	449,299,523,080
派生商品評価勘定	2,672,130
未収配当金	33,702,105

(2022年12月26日現在)

未収利息	335,947
その他未収収益	6,661,423
差入委託証拠金	754,049,800
流動資産合計	468,278,138,781
資産合計	468,278,138,781
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	339,746,510
未払解約金	141,739,707
未払利息	27,959
有価証券貸借取引受入金	9,286,366,048
流動負債合計	9,767,880,224
負債合計	9,767,880,224
純資産の部	
元本等	
元本	222,211,207,076
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	236,299,051,481
元本等合計	458,510,258,557
純資産合計	458,510,258,557
負債純資産合計	468,278,138,781

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2022年12月26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	2.0634円
(10,000口当たり純資産額)	(20,634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	
	8,807,679,080円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年12月28日 至 2022年12月26日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>    市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>    信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>    流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2022年12月26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</p> <p>ます。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年12月26日現在		
期首		2021年12月28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		203,088,871,279円
同期中における追加設定元本額		41,983,140,503円
同期中における一部解約元本額		22,860,804,706円
期末元本額		222,211,207,076円
期末元本額の内訳*		
バランスセレクト30		127,191,856円
バランスセレクト50		293,877,019円
バランスセレクト70		439,975,926円
野村世界6資産分散投信（安定コース）		2,119,846,404円
野村世界6資産分散投信（分配コース）		2,767,407,368円
野村世界6資産分散投信（成長コース）		9,023,039,300円
野村資産設計ファンド2015		33,547,247円
野村資産設計ファンド2020		35,973,818円
野村資産設計ファンド2025		59,556,623円
野村資産設計ファンド2030		93,244,103円
野村資産設計ファンド2035		88,214,809円
野村資産設計ファンド2040		157,164,687円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）		13,162,254,273円
のむらップ・ファンド（保守型）		2,435,215,031円
のむらップ・ファンド（普通型）		16,051,974,102円
のむらップ・ファンド（積極型）		5,929,505,049円
野村資産設計ファンド2045		34,221,292円
野村インデックスファンド・TOPIX		2,271,536,261円
マイ・ロード		3,054,756,898円
ネクストコア		19,440,496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		1,438,714,889円
野村TOPIXインデックス（野村SMA・EW向け）		2,724,648,084円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）		1,049,310,340円
野村資産設計ファンド2050		39,609,507円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		10,410,738円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		6,537,343円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		5,141,694円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		4,585,061円
のむらップ・ファンド（やや保守型）		450,589,718円
のむらップ・ファンド（やや積極型）		874,330,479円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		4,301,910円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		3,867,490円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		23,522,466円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		8,215,115円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		32,844,709円
野村6資産均等バランス		3,476,458,668円
世界6資産分散ファンド		85,443,363円

野村資産設計ファンド2060	30,714,764円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	2,743,223,295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)	242,249,155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)	130,853,387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)	338,619,946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)	191,742,100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)	1,565,901円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	7,348,035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)	1,033,483円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	1,871,036,627円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	3,046,890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)	31,749,810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)	49,577,282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)	11,515,806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)	83,918,944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)	170,410,985円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	3,874,330,132円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	36,625,536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)	182,680,458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)	4,175,599,132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)	40,456,415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)	81,086,012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)	2,284,184円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	5,808,323円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	28,706,156円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	32,299,450円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	115,069,615円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	8,832,999,405円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	25,358,086,963円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	30,085,094,168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)	37,112,959,448円
マイバランスDC30	3,640,038,291円
マイバランスDC50	6,294,408,636円
マイバランスDC70	6,988,386,721円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	12,040,915,040円
野村DC運用戦略ファンド	705,450,228円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	57,504,151円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	1,720,072,362円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,617,663,088円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,389,558,397円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	14,208,947円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	6,710,433円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	109,594,778円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	37,242,083円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	35,233,367円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	26,279,445円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	866,558,772円

マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	673,052,760円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	450,407,405円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	598,641,376円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	19,664,160円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	209,034,842円
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	186,220,723円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	173,186,793円
野村DCバランスファンド(年金運用戦略タイプ)	42,008,335円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年12月26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	8,700	3,720.00	32,364,000	
		ニッセイ	229,300	544.00	124,739,200	貸付有価証券 900株
		マルハニチロ	35,400	2,470.00	87,438,000	
		雪国まいたけ	19,500	981.00	19,129,500	貸付有価証券 100株
		カネコ種苗	7,600	1,426.00	10,837,600	
		サカタのタネ	29,000	4,370.00	126,730,000	貸付有価証券 400株
		ホクト	20,400	1,863.00	38,005,200	
		ホクリヨウ	3,300	706.00	2,329,800	
		住石ホールディングス	35,700	396.00	14,137,200	貸付有価証券 16,700株
		日鉄鉱業	9,200	3,170.00	29,164,000	
		三井松島ホールディングス	10,400	3,060.00	31,824,000	貸付有価証券 2,300株(1,100株)
		INPEX	848,100	1,461.00	1,239,074,100	
		石油資源開発	26,600	3,875.00	103,075,000	
		K&Oエナジーグループ	10,400	2,007.00	20,872,800	貸付有価証券 500株(400株)
ショーボンドホールディングス	31,200	5,750.00	179,400,000	貸付有価証券 6,500株		

ミライト・ワン	79,500	1,522.00	120,999,000	
タマホーム	16,200	2,494.00	40,402,800	貸付有価証券 5,600株(100株)
サンヨーホームズ	2,800	705.00	1,974,000	
日本アクア	9,600	832.00	7,987,200	
ファーストコーポレーション	5,900	700.00	4,130,000	貸付有価証券 800株
ベステラ	4,900	902.00	4,419,800	貸付有価証券 2,300株
Robot Home	39,000	161.00	6,279,000	貸付有価証券 11,600株(11,400株)
キャンディル	3,500	490.00	1,715,000	貸付有価証券 1,600株
ダイセキ環境ソリューション	4,600	793.00	3,647,800	
第一カッター興業	5,900	1,001.00	5,905,900	
安藤・間	132,900	834.00	110,838,600	貸付有価証券 600株
東急建設	65,300	637.00	41,596,100	
コムシスホールディングス	77,600	2,346.00	182,049,600	
ビーアールホールディングス	36,400	325.00	11,830,000	貸付有価証券 100株
高松コンストラクショングループ	14,900	1,900.00	28,310,000	
東建コーポレーション	7,400	7,370.00	54,538,000	
ソネック	2,500	941.00	2,352,500	貸付有価証券 1,100株
ヤマウラ	11,600	998.00	11,576,800	貸付有価証券 2,200株
オリエンタル白石	82,400	278.00	22,907,200	
大成建設	159,700	4,265.00	681,120,500	貸付有価証券 1,700株
大林組	573,600	1,013.00	581,056,800	貸付有価証券 2,300株
清水建設	482,200	710.00	342,362,000	貸付有価証券 1,300株
飛島建設	17,700	1,000.00	17,700,000	
長谷工コーポレーション	165,600	1,474.00	244,094,400	
松井建設	15,000	553.00	8,295,000	
銭高組	2,000	2,621.00	5,242,000	

鹿島建設	355,700	1,530.00	544,221,000	
不動テトラ	11,100	1,480.00	16,428,000	
大末建設	5,800	1,146.00	6,646,800	
鉄建建設	11,500	1,752.00	20,148,000	
西松建設	27,200	3,930.00	106,896,000	貸付有価証券 100株
三井住友建設	129,300	416.00	53,788,800	
大豊建設	6,600	3,955.00	26,103,000	貸付有価証券 500株
佐田建設	10,300	436.00	4,490,800	
ナカノフドー建設	11,400	313.00	3,568,200	貸付有価証券 300株
奥村組	26,000	2,987.00	77,662,000	
東鉄工業	22,100	2,630.00	58,123,000	
イチケン	3,600	1,778.00	6,400,800	
富士ピー・エス	7,200	436.00	3,139,200	貸付有価証券 3,300株（500株）
浅沼組	12,800	2,966.00	37,964,800	
戸田建設	197,300	715.00	141,069,500	貸付有価証券 100株
熊谷組	27,800	2,634.00	73,225,200	
北野建設	3,000	2,502.00	7,506,000	
植木組	4,500	1,287.00	5,791,500	
矢作建設工業	21,800	747.00	16,284,600	
ピーエス三菱	20,300	602.00	12,220,600	
日本ハウスホールディングス	31,800	364.00	11,575,200	貸付有価証券 1,700株（100株）
新日本建設	22,500	724.00	16,290,000	
東亜道路工業	3,200	5,700.00	18,240,000	貸付有価証券 100株
日本道路	3,200	5,950.00	19,040,000	貸付有価証券 100株
東亜建設工業	13,800	2,335.00	32,223,000	貸付有価証券 6,100株
日本国土開発	48,100	566.00	27,224,600	貸付有価証券 400株
若築建設	7,100	2,797.00	19,858,700	
東洋建設	51,900	852.00	44,218,800	貸付有価証券 6,800株（4,800株）

五洋建設	227,400	619.00	140,760,600	貸付有価証券 7,200株
世紀東急工業	21,100	785.00	16,563,500	
福田組	6,000	4,490.00	26,940,000	貸付有価証券 2,800株
住友林業	123,100	2,435.00	299,748,500	貸付有価証券 31,600株
日本基礎技術	10,200	457.00	4,661,400	貸付有価証券 800株(100株)
巴コーポレーション	17,900	399.00	7,142,100	
大和ハウス工業	448,200	3,077.00	1,379,111,400	
ライト工業	30,600	1,899.00	58,109,400	
積水ハウス	502,500	2,355.00	1,183,387,500	
日特建設	15,300	918.00	14,045,400	
北陸電気工事	11,000	662.00	7,282,000	
ユアテック	35,300	720.00	25,416,000	
日本リーテック	10,600	828.00	8,776,800	
四電工	6,700	1,700.00	11,390,000	
中電工	24,900	2,085.00	51,916,500	
関電工	87,900	868.00	76,297,200	
きんでん	112,900	1,437.00	162,237,300	貸付有価証券 200株
東京エネシス	16,000	909.00	14,544,000	
トーエネック	5,300	3,415.00	18,099,500	
住友電設	15,300	2,419.00	37,010,700	貸付有価証券 100株
日本電設工業	26,300	1,539.00	40,475,700	
エクシオグループ	78,600	2,224.00	174,806,400	貸付有価証券 8,600株
新日本空調	8,900	1,847.00	16,438,300	
九電工	39,000	3,215.00	125,385,000	
三機工業	35,600	1,560.00	55,536,000	
日揮ホールディングス	158,700	1,726.00	273,916,200	
中外炉工業	5,200	1,619.00	8,418,800	
ヤマト	13,300	695.00	9,243,500	
太平電業	10,000	3,295.00	32,950,000	
高砂熱学工業	38,700	1,772.00	68,576,400	
三晃金属工業	2,000	3,060.00	6,120,000	

朝日工業社	6,700	2,101.00	14,076,700	
明星工業	27,600	762.00	21,031,200	
大気社	19,300	3,340.00	64,462,000	
ダイダン	10,500	2,168.00	22,764,000	
日比谷総合設備	13,800	1,941.00	26,785,800	
フィル・カンパニー	2,800	902.00	2,525,600	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
テスホールディングス	17,200	992.00	17,062,400	貸付有価証券 200株（100株）
インフロニア・ホールディングス	168,100	1,015.00	170,621,500	貸付有価証券 700株
レイズネクスト	23,200	1,284.00	29,788,800	
ニッポン	43,400	1,621.00	70,351,400	
日清製粉グループ本社	148,900	1,628.00	242,409,200	貸付有価証券 500株
日東富士製粉	2,900	4,440.00	12,876,000	
昭和産業	14,000	2,486.00	34,804,000	
鳥越製粉	12,900	610.00	7,869,000	貸付有価証券 6,000株（400株）
中部飼料	22,300	1,070.00	23,861,000	
フィード・ワン	23,500	714.00	16,779,000	
東洋精糖	3,000	871.00	2,613,000	
日本甜菜製糖	9,400	1,643.00	15,444,200	
D M三井製糖ホールディングス	16,000	2,014.00	32,224,000	
塩水港精糖	19,300	193.00	3,724,900	貸付有価証券 300株
日新製糖	8,300	1,931.00	16,027,300	貸付有価証券 3,900株
森永製菓	33,100	3,955.00	130,910,500	貸付有価証券 1,400株
中村屋	4,000	3,080.00	12,320,000	
江崎グリコ	46,100	3,690.00	170,109,000	
名糖産業	6,300	1,620.00	10,206,000	貸付有価証券 100株
井村屋グループ	8,800	2,226.00	19,588,800	
不二家	11,000	2,598.00	28,578,000	貸付有価証券 5,100株
山崎製パン	107,800	1,618.00	174,420,400	

第一屋製パン	3,100	399.00	1,236,900	
モロゾフ	5,200	3,570.00	18,564,000	
亀田製菓	10,200	4,365.00	44,523,000	貸付有価証券 400株
寿スピリッツ	17,100	7,340.00	125,514,000	
カルビー	73,700	3,040.00	224,048,000	貸付有価証券 600株
森永乳業	29,300	5,040.00	147,672,000	貸付有価証券 1,100株
六甲バター	11,800	1,317.00	15,540,600	
ヤクルト本社	115,100	8,690.00	1,000,219,000	
明治ホールディングス	99,800	6,830.00	681,634,000	貸付有価証券 300株
雪印メグミルク	38,900	1,807.00	70,292,300	貸付有価証券 1,100株
プリマハム	21,600	2,178.00	47,044,800	貸付有価証券 700株
日本ハム	63,000	3,675.00	231,525,000	貸付有価証券 100株
林兼産業	4,900	450.00	2,205,000	貸付有価証券 1,100株（1,000株）
丸大食品	16,200	1,418.00	22,971,600	貸付有価証券 2,500株（500株）
S Foods	17,800	2,977.00	52,990,600	貸付有価証券 1,300株
柿安本店	6,300	2,050.00	12,915,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	125,200	701.00	87,765,200	貸付有価証券 1,300株
サッポロホールディングス	53,000	3,320.00	175,960,000	貸付有価証券 100株
アサヒグループホールディングス	372,100	4,153.00	1,545,331,300	
キリンホールディングス	726,700	2,054.50	1,493,005,150	
宝ホールディングス	109,900	1,031.00	113,306,900	貸付有価証券 900株
オエノンホールディングス	48,100	270.00	12,987,000	貸付有価証券 3,600株（100株）
養命酒製造	5,300	1,802.00	9,550,600	貸付有価証券 100株（100株）
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	126,200	1,443.00	182,106,600	

サントリー食品インターナショナル	113,400	4,615.00	523,341,000	
ダイドーグループホールディングス	9,100	4,855.00	44,180,500	貸付有価証券 1,300株
伊藤園	60,000	4,785.00	287,100,000	貸付有価証券 5,200株
キーコーヒー	18,000	2,073.00	37,314,000	
ユニカフェ	5,300	970.00	5,141,000	貸付有価証券 2,500株（100株）
ジャパンフーズ	2,500	1,067.00	2,667,500	
日清オイリオグループ	22,700	3,240.00	73,548,000	貸付有価証券 500株
不二製油グループ本社	37,500	2,016.00	75,600,000	貸付有価証券 800株
かどや製油	1,900	3,500.00	6,650,000	
J - オイルミルズ	16,400	1,517.00	24,878,800	
キッコーマン	106,700	7,080.00	755,436,000	
味の素	394,100	4,155.00	1,637,485,500	貸付有価証券 1,700株
ブルドックソース	6,400	1,776.00	11,366,400	貸付有価証券 1,000株（200株）
キューピー	86,500	2,449.00	211,838,500	貸付有価証券 1,800株
ハウス食品グループ本社	49,300	2,771.00	136,610,300	貸付有価証券 3,100株
カゴメ	75,000	3,080.00	231,000,000	
焼津水産化学工業	7,200	838.00	6,033,600	
アリアケジャパン	14,000	4,390.00	61,460,000	
ピエトロ	2,300	1,807.00	4,156,100	貸付有価証券 1,100株
エバラ食品工業	4,300	3,030.00	13,029,000	貸付有価証券 100株（100株）
やまみ	1,500	1,397.00	2,095,500	
ニチレイ	73,800	2,831.00	208,927,800	貸付有価証券 1,400株
東洋水産	81,400	5,270.00	428,978,000	
イトアンドホールディングス	6,800	2,316.00	15,748,800	
大冷	2,000	1,868.00	3,736,000	
ヨシムラ・フード・ホー	10,200	538.00	5,487,600	貸付有価証券

ルディングス				200株(200株)
日清食品ホールディングス	57,400	10,590.00	607,866,000	
永谷園ホールディングス	7,900	2,013.00	15,902,700	
一正蒲鉾	6,900	717.00	4,947,300	貸付有価証券 400株
フジッコ	16,500	1,908.00	31,482,000	貸付有価証券 200株
ロック・フィールド	19,700	1,520.00	29,944,000	貸付有価証券 8,200株
日本たばこ産業	1,060,100	2,842.50	3,013,334,250	
ケンコーマヨネーズ	11,100	1,416.00	15,717,600	
わらべや日洋ホールディングス	11,900	1,840.00	21,896,000	
なとり	10,100	2,042.00	20,624,200	
イフジ産業	2,800	948.00	2,654,400	
ファーマフーズ	24,900	1,352.00	33,664,800	貸付有価証券 10,200株(5,700株)
ユーグレナ	103,700	954.00	98,929,800	貸付有価証券 21,100株
紀文食品	12,600	940.00	11,844,000	貸付有価証券 300株(200株)
ピクルスホールディングス	9,400	1,050.00	9,870,000	
ミヨシ油脂	5,700	974.00	5,551,800	貸付有価証券 2,600株
理研ビタミン	13,900	1,915.00	26,618,500	
片倉工業	15,100	1,758.00	26,545,800	貸付有価証券 500株
グンゼ	12,300	4,175.00	51,352,500	
東洋紡	70,800	1,007.00	71,295,600	貸付有価証券 300株
ユニチカ	49,400	248.00	12,251,200	貸付有価証券 8,400株
富士紡ホールディングス	6,500	3,210.00	20,865,000	
倉敷紡績	12,200	2,137.00	26,071,400	
シキボウ	9,100	973.00	8,854,300	
日本毛織	43,200	975.00	42,120,000	
ダイトウボウ	26,600	81.00	2,154,600	貸付有価証券 4,300株

トーア紡コーポレーション	6,400	365.00	2,336,000	貸付有価証券 600株
ダイドーリミテッド	24,900	251.00	6,249,900	貸付有価証券 11,100株
帝国繊維	18,500	1,626.00	30,081,000	貸付有価証券 8,600株
帝人	157,400	1,294.00	203,675,600	貸付有価証券 1,900株
東レ	1,097,600	744.80	817,492,480	貸付有価証券 9,700株
住江織物	3,000	1,807.00	5,421,000	
日本フェルト	9,000	401.00	3,609,000	
イチカワ	2,100	1,305.00	2,740,500	
日東製網	1,900	1,398.00	2,656,200	
アツギ	9,500	388.00	3,686,000	
ダイニック	4,200	612.00	2,570,400	
セーレン	31,600	2,451.00	77,451,600	貸付有価証券 15,500株（5,600株）
ソトー	5,200	830.00	4,316,000	
東海染工	1,600	1,125.00	1,800,000	
小松マテーレ	23,700	766.00	18,154,200	
ワコールホールディングス	31,600	2,325.00	73,470,000	
ホギメディカル	22,000	3,435.00	75,570,000	
クラウドシアホールディングス	3,700	285.00	1,054,500	貸付有価証券 1,600株
T S Iホールディングス	58,600	434.00	25,432,400	貸付有価証券 900株
マツオカコーポレーション	4,400	1,036.00	4,558,400	貸付有価証券 200株
ワールド	21,000	1,268.00	26,628,000	
三陽商会	6,300	1,212.00	7,635,600	
ナイガイ	5,400	273.00	1,474,200	貸付有価証券 100株
オンワードホールディングス	106,200	306.00	32,497,200	
ルックホールディングス	4,700	2,315.00	10,880,500	貸付有価証券 2,200株（300株）
ゴールドウイン	29,000	9,540.00	276,660,000	
デサント	28,200	3,195.00	90,099,000	貸付有価証券

				1,600株(1,600株)
キング	7,200	488.00	3,513,600	
ヤマトインターナショナル	12,900	237.00	3,057,300	貸付有価証券 5,900株(2,300株)
特種東海製紙	7,300	2,759.00	20,140,700	貸付有価証券 300株
王子ホールディングス	682,400	529.00	360,989,600	貸付有価証券 900株
日本製紙	85,300	960.00	81,888,000	貸付有価証券 2,100株(1,900株)
三菱製紙	19,700	284.00	5,594,800	貸付有価証券 900株
北越コーポレーション	103,500	782.00	80,937,000	貸付有価証券 34,400株
中越パルプ工業	6,600	968.00	6,388,800	
巴川製紙所	5,100	654.00	3,335,400	
大王製紙	72,400	1,009.00	73,051,600	貸付有価証券 14,500株
阿波製紙	3,900	300.00	1,170,000	
レンゴー	149,200	907.00	135,324,400	貸付有価証券 14,700株
トーモク	9,500	1,630.00	15,485,000	
ザ・パック	12,200	2,400.00	29,280,000	貸付有価証券 4,500株
北の達人コーポレーション	69,000	265.00	18,285,000	貸付有価証券 20,900株(11,500株)
クラレ	260,400	1,098.00	285,919,200	貸付有価証券 400株
旭化成	1,023,000	956.20	978,192,600	貸付有価証券 300株
共和レザー	9,400	493.00	4,634,200	貸付有価証券 300株
昭和電工	158,300	2,102.00	332,746,600	
住友化学	1,215,200	474.00	576,004,800	貸付有価証券 23,600株
住友精化	6,800	4,020.00	27,336,000	
日産化学	77,800	6,030.00	469,134,000	貸付有価証券 200株
ラサ工業	6,300	1,846.00	11,629,800	貸付有価証券 100株
クレハ	14,000	8,200.00	114,800,000	貸付有価証券

				1,000株
多木化学	6,400	4,590.00	29,376,000	貸付有価証券 2,900株
テイカ	11,000	1,153.00	12,683,000	
石原産業	29,600	1,059.00	31,346,400	
片倉コープアグリ	3,400	1,521.00	5,171,400	
日本曹達	17,600	4,300.00	75,680,000	
東ソー	218,700	1,582.00	345,983,400	
トクヤマ	52,900	1,806.00	95,537,400	
セントラル硝子	26,300	2,834.00	74,534,200	貸付有価証券 100株
東亜合成	84,200	1,134.00	95,482,800	
大阪ソーダ	9,800	3,940.00	38,612,000	
関東電化工業	31,700	929.00	29,449,300	貸付有価証券 300株
デンカ	59,600	3,020.00	179,992,000	
信越化学工業	280,300	16,930.00	4,745,479,000	貸付有価証券 3,800株
日本カーバイド工業	6,200	1,251.00	7,756,200	貸付有価証券 100株
堺化学工業	12,500	1,765.00	22,062,500	貸付有価証券 3,500株
第一稀元素化学工業	14,900	1,003.00	14,944,700	
エア・ウォーター	154,600	1,531.00	236,692,600	
日本酸素ホールディングス	158,900	1,920.00	305,088,000	
日本化学工業	5,500	1,725.00	9,487,500	貸付有価証券 100株
東邦アセチレン	3,500	1,096.00	3,836,000	
日本パーカライジング	81,100	932.00	75,585,200	貸付有価証券 100株
高圧ガス工業	23,800	662.00	15,755,600	
チタン工業	2,000	1,454.00	2,908,000	
四国化成工業	19,400	1,315.00	25,511,000	貸付有価証券 1,300株
戸田工業	3,700	2,426.00	8,976,200	貸付有価証券 600株（300株）
ステラ ケミファ	9,700	2,454.00	23,803,800	
保土谷化学工業	4,600	2,742.00	12,613,200	
日本触媒	25,000	5,310.00	132,750,000	

大日精化工業	11,400	1,698.00	19,357,200	
カネカ	37,400	3,315.00	123,981,000	
三菱瓦斯化学	122,300	1,842.00	225,276,600	
三井化学	137,800	3,015.00	415,467,000	
J S R	152,900	2,613.00	399,527,700	貸付有価証券 2,200株
東京応化工業	28,700	6,160.00	176,792,000	
大阪有機化学工業	12,300	1,923.00	23,652,900	
三菱ケミカルグループ	1,105,500	691.00	763,900,500	
K H ネオケム	27,300	2,701.00	73,737,300	貸付有価証券 200株
ダイセル	240,900	959.00	231,023,100	
住友ベークライト	24,300	3,920.00	95,256,000	
積水化学工業	340,200	1,878.00	638,895,600	
日本ゼオン	98,300	1,323.00	130,050,900	
アイカ工業	41,300	3,170.00	130,921,000	貸付有価証券 1,000株
U B E	84,400	1,957.00	165,170,800	
積水樹脂	23,800	1,800.00	42,840,000	
タキロンシーアイ	35,800	502.00	17,971,600	貸付有価証券 600株
旭有機材	10,900	2,808.00	30,607,200	
ニチバン	10,100	1,826.00	18,442,600	貸付有価証券 400株
リケンテクノス	35,300	477.00	16,838,100	
大倉工業	7,600	1,980.00	15,048,000	貸付有価証券 3,500株
積水化成成品工業	23,000	388.00	8,924,000	
群栄化学工業	3,900	2,340.00	9,126,000	
タイガースポリマー	7,500	394.00	2,955,000	貸付有価証券 200株
ミライアル	5,000	1,419.00	7,095,000	貸付有価証券 500株
ダイキアクシス	6,000	712.00	4,272,000	貸付有価証券 2,800株
ダイキョーニシカワ	36,200	550.00	19,910,000	貸付有価証券 100株
竹本容器	5,500	751.00	4,130,500	
森六ホールディングス	8,300	1,696.00	14,076,800	

恵和	5,300	3,225.00	17,092,500	貸付有価証券 2,400株
日本化薬	125,100	1,160.00	145,116,000	
カーリットホールディングス	14,700	750.00	11,025,000	
日本精化	9,300	2,213.00	20,580,900	貸付有価証券 100株
扶桑化学工業	15,200	3,340.00	50,768,000	貸付有価証券 100株
トリケミカル研究所	21,900	1,968.00	43,099,200	貸付有価証券 600株
A D E K A	57,100	2,189.00	124,991,900	
日油	50,700	5,350.00	271,245,000	
新日本理化	22,600	242.00	5,469,200	貸付有価証券 600株
ハリマ化成グループ	11,500	822.00	9,453,000	貸付有価証券 100株
花王	398,900	5,349.00	2,133,716,100	
第一工業製薬	5,900	1,926.00	11,363,400	
石原ケミカル	7,500	1,227.00	9,202,500	
日華化学	6,600	826.00	5,451,600	貸付有価証券 3,100株
ニイタカ	3,300	1,917.00	6,326,100	
三洋化成工業	10,100	4,025.00	40,652,500	貸付有価証券 100株
有機合成薬品工業	12,100	285.00	3,448,500	貸付有価証券 700株
大日本塗料	20,000	752.00	15,040,000	
日本ペイントホールディングス	724,900	1,027.00	744,472,300	
関西ペイント	150,100	1,611.00	241,811,100	
神東塗料	13,700	125.00	1,712,500	貸付有価証券 5,300株
中国塗料	30,300	954.00	28,906,200	貸付有価証券 100株
日本特殊塗料	10,400	849.00	8,829,600	
藤倉化成	22,000	402.00	8,844,000	
太陽ホールディングス	24,900	2,250.00	56,025,000	
D I C	64,000	2,389.00	152,896,000	
サカティンクス	36,400	1,048.00	38,147,200	

東洋インキ S C ホールディングス	32,100	1,868.00	59,962,800	
T & K T O K A	14,600	1,078.00	15,738,800	
富士フイルムホールディングス	314,700	6,736.00	2,119,819,200	貸付有価証券 6,900株
資生堂	342,500	6,114.00	2,094,045,000	
ライオン	196,800	1,514.00	297,955,200	
高砂香料工業	11,100	2,591.00	28,760,100	
マンダム	35,400	1,424.00	50,409,600	貸付有価証券 400株
ミルボン	24,300	5,560.00	135,108,000	
ファンケル	71,800	2,463.00	176,843,400	
コーセー	33,400	14,210.00	474,614,000	
コタ	13,700	1,683.00	23,057,100	貸付有価証券 300株(300株)
シーボン	2,100	1,547.00	3,248,700	
ポーラ・オルビスホールディングス	84,100	1,832.00	154,071,200	貸付有価証券 400株(100株)
ノエビアホールディングス	14,600	5,740.00	83,804,000	
アジュバンホールディングス	4,000	944.00	3,776,000	
新日本製薬	9,400	1,278.00	12,013,200	貸付有価証券 400株
エステー	12,700	1,510.00	19,177,000	
アグロ カネショウ	6,600	1,648.00	10,876,800	貸付有価証券 3,100株
コニシ	27,400	1,641.00	44,963,400	
長谷川香料	34,000	2,887.00	98,158,000	貸付有価証券 1,500株
星光 P M C	8,300	540.00	4,482,000	
小林製薬	50,200	8,730.00	438,246,000	
荒川化学工業	13,900	959.00	13,330,100	
メック	13,500	2,122.00	28,647,000	貸付有価証券 2,500株
日本高純度化学	4,200	2,385.00	10,017,000	
タカラバイオ	44,200	1,657.00	73,239,400	貸付有価証券 700株
J C U	18,500	3,015.00	55,777,500	
新田ゼラチン	10,100	868.00	8,766,800	貸付有価証券

				2,000株(100株)
O A T アグリオ	6,700	1,506.00	10,090,200	貸付有価証券 3,100株
デクセリアルズ	47,400	2,557.00	121,201,800	貸付有価証券 10,000株
アース製薬	14,900	5,090.00	75,841,000	
北興化学工業	16,500	801.00	13,216,500	
大成ラミック	5,200	2,905.00	15,106,000	
クミアイ化学工業	65,200	929.00	60,570,800	貸付有価証券 6,300株
日本農薬	30,100	705.00	21,220,500	貸付有価証券 300株
アキレス	10,700	1,235.00	13,214,500	
有沢製作所	26,800	1,281.00	34,330,800	貸付有価証券 200株
日東電工	119,100	7,820.00	931,362,000	
レック	23,300	881.00	20,527,300	貸付有価証券 1,300株
三光合成	22,500	420.00	9,450,000	
きもと	24,100	218.00	5,253,800	貸付有価証券 5,100株(300株)
藤森工業	13,000	3,115.00	40,495,000	
前澤化成工業	10,600	1,363.00	14,447,800	貸付有価証券 4,900株
未来工業	5,900	1,439.00	8,490,100	
ウェーブロックホール ディングス	4,900	630.00	3,087,000	貸付有価証券 800株(800株)
J S P	11,500	1,482.00	17,043,000	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	31,000	3,775.00	117,025,000	貸付有価証券 200株
天馬	13,900	2,029.00	28,203,100	
信越ポリマー	30,300	1,153.00	34,935,900	
東リ	36,800	226.00	8,316,800	
ニフコ	59,200	3,175.00	187,960,000	
バルカー	13,700	2,645.00	36,236,500	
ユニ・チャーム	341,700	5,049.00	1,725,243,300	
ショーエイコーポレー ション	4,800	552.00	2,649,600	貸付有価証券 200株(200株)
協和キリン	198,200	3,035.00	601,537,000	

武田薬品工業	1,451,600	4,102.00	5,954,463,200	貸付有価証券 17,500株
アステラス製薬	1,571,900	2,035.50	3,199,602,450	貸付有価証券 19,500株
住友ファーマ	121,700	1,001.00	121,821,700	
塩野義製薬	209,600	6,752.00	1,415,219,200	
わかもと製薬	15,300	217.00	3,320,100	貸付有価証券 300株（100株）
日本新薬	38,700	7,470.00	289,089,000	
中外製薬	513,400	3,417.00	1,754,287,800	
科研製薬	28,100	3,875.00	108,887,500	貸付有価証券 100株
エーザイ	199,500	8,666.00	1,728,867,000	
ロート製薬	79,400	4,635.00	368,019,000	
小野薬品工業	316,500	3,186.00	1,008,369,000	
久光製薬	36,500	3,840.00	140,160,000	
持田製薬	19,600	3,450.00	67,620,000	
参天製薬	308,700	1,090.00	336,483,000	
扶桑薬品工業	5,200	1,946.00	10,119,200	
日本ケミファ	1,600	1,645.00	2,632,000	
ツムラ	51,600	2,901.00	149,691,600	
キッセイ薬品工業	25,300	2,584.00	65,375,200	
生化学工業	31,300	899.00	28,138,700	
栄研化学	26,600	1,703.00	45,299,800	
鳥居薬品	8,800	2,859.00	25,159,200	貸付有価証券 600株
J C R ファーマ	55,500	1,621.00	89,965,500	貸付有価証券 1,600株
東和薬品	25,200	2,103.00	52,995,600	貸付有価証券 100株
富士製薬工業	10,600	1,000.00	10,600,000	
ゼリア新薬工業	22,700	2,231.00	50,643,700	貸付有価証券 900株
第一三共	1,428,900	4,248.00	6,069,967,200	貸付有価証券 21,700株
キョーリン製薬ホールディングス	35,600	1,711.00	60,911,600	
大幸薬品	29,700	376.00	11,167,200	貸付有価証券 4,400株

ダイト	12,300	2,451.00	30,147,300	貸付有価証券 1,200株
大塚ホールディングス	375,300	4,408.00	1,654,322,400	貸付有価証券 900株
大正製薬ホールディングス	36,400	5,870.00	213,668,000	
ペプチドリーム	79,500	1,637.00	130,141,500	貸付有価証券 17,100株
あすか製薬ホールディングス	16,800	1,275.00	21,420,000	
サワイグループホールディングス	37,500	4,115.00	154,312,500	
日本コークス工業	147,900	86.00	12,719,400	貸付有価証券 14,500株（6,700株）
ニチレキ	19,400	1,257.00	24,385,800	
ユシロ化学工業	8,500	772.00	6,562,000	
ピーピー・カストロール	6,300	911.00	5,739,300	貸付有価証券 300株（200株）
富士石油	33,500	256.00	8,576,000	貸付有価証券 13,900株（800株）
MORESCO	5,300	1,146.00	6,073,800	貸付有価証券 200株（100株）
出光興産	182,200	3,110.00	566,642,000	
ENEOSホールディングス	2,963,400	446.50	1,323,158,100	
コスモエネルギーホールディングス	62,200	3,595.00	223,609,000	貸付有価証券 600株
横浜ゴム	93,300	2,130.00	198,729,000	
TOYO TIRE	94,300	1,580.00	148,994,000	貸付有価証券 200株
ブリヂストン	523,800	4,835.00	2,532,573,000	貸付有価証券 26,800株
住友ゴム工業	160,900	1,187.00	190,988,300	貸付有価証券 12,800株
藤倉コンポジット	11,600	809.00	9,384,400	貸付有価証券 100株
オカモト	9,100	3,760.00	34,216,000	
フコク	8,600	1,048.00	9,012,800	
ニッタ	16,700	2,803.00	46,810,100	
住友理工	31,800	597.00	18,984,600	
三ツ星ベルト	23,900	3,445.00	82,335,500	

バンドー化学	26,000	956.00	24,856,000	
日東紡績	19,500	1,857.00	36,211,500	貸付有価証券 900株
A G C	166,900	4,535.00	756,891,500	
日本板硝子	83,600	549.00	45,896,400	貸付有価証券 1,200株
石塚硝子	2,600	1,418.00	3,686,800	貸付有価証券 100株（100株）
日本山村硝子	6,100	543.00	3,312,300	
日本電気硝子	67,000	2,448.00	164,016,000	
オハラ	7,800	1,018.00	7,940,400	貸付有価証券 3,100株（1,900株）
住友大阪セメント	23,100	3,235.00	74,728,500	貸付有価証券 200株
太平洋セメント	104,400	2,046.00	213,602,400	貸付有価証券 2,600株
日本ヒューム	14,400	640.00	9,216,000	
日本コンクリート工業	31,800	218.00	6,932,400	
三谷セキサン	6,900	3,995.00	27,565,500	貸付有価証券 3,200株
アジアパイルホールディングス	25,600	524.00	13,414,400	
東海カーボン	137,600	1,115.00	153,424,000	
日本カーボン	9,400	4,335.00	40,749,000	
東洋炭素	10,300	3,685.00	37,955,500	貸付有価証券 900株
ノリタケカンパニーリミテド	8,200	3,945.00	32,349,000	
T O T O	108,200	4,500.00	486,900,000	貸付有価証券 200株
日本碍子	194,100	1,697.00	329,387,700	貸付有価証券 1,700株
日本特殊陶業	124,900	2,489.00	310,876,100	貸付有価証券 100株
ダントーホールディングス	11,600	218.00	2,528,800	貸付有価証券 5,400株
M A R U W A	6,100	15,520.00	94,672,000	
品川リフラクトリーズ	4,600	3,820.00	17,572,000	
黒崎播磨	3,300	4,920.00	16,236,000	
ヨータイ	11,000	1,343.00	14,773,000	

東京窯業	15,000	261.00	3,915,000	貸付有価証券 200株
ニッカトー	7,300	470.00	3,431,000	貸付有価証券 100株(100株)
フジインコーポレー テッド	13,100	6,300.00	82,530,000	貸付有価証券 600株
クニミネ工業	4,800	802.00	3,849,600	
エーアンドエーマテリア ル	3,000	875.00	2,625,000	
ニチアス	41,500	2,342.00	97,193,000	
ニチハ	20,500	2,628.00	53,874,000	
日本製鉄	755,600	2,276.50	1,720,123,400	貸付有価証券 23,000株
神戸製鋼所	339,400	645.00	218,913,000	貸付有価証券 10,100株
中山製鋼所	34,700	793.00	27,517,100	
合同製鐵	8,400	2,099.00	17,631,600	
J F E ホールディングス	450,900	1,552.00	699,796,800	貸付有価証券 1,200株
東京製鐵	47,400	1,195.00	56,643,000	
共英製鋼	19,200	1,246.00	23,923,200	貸付有価証券 400株
大和工業	27,800	4,540.00	126,212,000	
東京鐵鋼	8,000	1,401.00	11,208,000	
大阪製鐵	7,800	1,135.00	8,853,000	貸付有価証券 200株
淀川製鋼所	19,200	2,543.00	48,825,600	
丸一鋼管	51,400	2,703.00	138,934,200	
モリ工業	3,800	2,760.00	10,488,000	
大同特殊鋼	21,300	4,310.00	91,803,000	
日本高周波鋼業	5,700	312.00	1,778,400	
日本冶金工業	12,300	4,160.00	51,168,000	
山陽特殊製鋼	16,700	2,138.00	35,704,600	
愛知製鋼	9,700	2,087.00	20,243,900	
日本金属	3,700	893.00	3,304,100	
大平洋金属	12,000	1,930.00	23,160,000	貸付有価証券 100株
新日本電工	107,800	366.00	39,454,800	貸付有価証券 1,200株

栗本鐵工所	8,000	1,747.00	13,976,000	
虹技	2,000	880.00	1,760,000	
日本鑄鉄管	1,600	906.00	1,449,600	
三菱製鋼	10,600	976.00	10,345,600	
日亜鋼業	17,100	246.00	4,206,600	貸付有価証券 100株
日本精線	2,300	4,210.00	9,683,000	
エンビプロ・ホールディングス	11,600	708.00	8,212,800	貸付有価証券 5,500株（3,000株）
シンニッタン	18,200	219.00	3,985,800	貸付有価証券 3,500株（400株）
新家工業	3,700	1,989.00	7,359,300	
大紀アルミニウム工業所	24,000	1,224.00	29,376,000	貸付有価証券 6,300株
日本軽金属ホールディングス	45,500	1,512.00	68,796,000	貸付有価証券 900株
三井金属鉱業	49,100	3,090.00	151,719,000	貸付有価証券 200株
東邦亜鉛	10,000	2,048.00	20,480,000	貸付有価証券 100株
三菱マテリアル	112,600	2,092.00	235,559,200	
住友金属鉱山	195,600	4,662.00	911,887,200	貸付有価証券 6,300株
DOWAホールディングス	37,900	4,110.00	155,769,000	
古河機械金属	24,700	1,287.00	31,788,900	
大阪チタニウムテクノロジーズ	24,800	4,020.00	99,696,000	貸付有価証券 1,200株
東邦チタニウム	30,500	2,928.00	89,304,000	貸付有価証券 500株
UACJ	23,600	2,172.00	51,259,200	貸付有価証券 8,800株
CKサンエツ	4,100	3,955.00	16,215,500	
古河電気工業	56,200	2,512.00	141,174,400	貸付有価証券 2,200株
住友電気工業	582,700	1,517.50	884,247,250	
フジクラ	180,900	1,009.00	182,528,100	
昭和電線ホールディングス	18,900	1,730.00	32,697,000	
東京特殊電線	2,200	5,650.00	12,430,000	貸付有価証券

				300株(200株)
タツタ電線	34,300	710.00	24,353,000	貸付有価証券 11,600株
カナレ電気	2,600	1,432.00	3,723,200	貸付有価証券 1,200株(300株)
平河ヒューテック	9,700	1,104.00	10,708,800	
リヨービ	18,000	1,158.00	20,844,000	
アーレスティ	18,700	451.00	8,433,700	
アサヒホールディングス	68,200	1,960.00	133,672,000	貸付有価証券 2,900株
稲葉製作所	9,900	1,380.00	13,662,000	貸付有価証券 3,800株
宮地エンジニアリンググループ	4,700	3,400.00	15,980,000	
トーカロ	46,400	1,173.00	54,427,200	貸付有価証券 100株
アルファC o	6,200	908.00	5,629,600	
SUMCO	321,200	1,839.00	590,686,800	貸付有価証券 55,800株
川田テクノロジーズ	4,000	3,235.00	12,940,000	
RS Technologies	5,500	7,240.00	39,820,000	
ジェイテックコーポレーション	2,300	2,791.00	6,419,300	貸付有価証券 1,000株(700株)
信和	9,300	779.00	7,244,700	
東洋製罐グループホールディングス	111,700	1,621.00	181,065,700	貸付有価証券 1,400株
ホッカンホールディングス	9,100	1,353.00	12,312,300	
コロナ	9,400	877.00	8,243,800	
横河ブリッジホールディングス	22,300	1,864.00	41,567,200	貸付有価証券 100株
駒井ハルテック	2,700	1,467.00	3,960,900	
高田機工	1,400	2,419.00	3,386,600	
三和ホールディングス	155,400	1,216.00	188,966,400	
文化シャッター	48,600	1,093.00	53,119,800	貸付有価証券 19,700株(10,800株)
三協立山	23,200	524.00	12,156,800	貸付有価証券 1,300株
アルインコ	12,900	985.00	12,706,500	

東洋シャッター	3,900	508.00	1,981,200	
L I X I L	245,800	2,004.00	492,583,200	貸付有価証券 2,700株
日本フィルコン	11,000	442.00	4,862,000	貸付有価証券 400株
ノーリツ	24,900	1,481.00	36,876,900	
長府製作所	17,000	1,915.00	32,555,000	
リンナイ	30,600	9,610.00	294,066,000	貸付有価証券 200株
ダイニチ工業	8,400	653.00	5,485,200	
日東精工	24,500	495.00	12,127,500	
三洋工業	1,900	1,723.00	3,273,700	
岡部	27,100	708.00	19,186,800	貸付有価証券 800株
ジーテクト	18,800	1,435.00	26,978,000	
東プレ	29,700	1,118.00	33,204,600	貸付有価証券 100株
高周波熱錬	27,500	666.00	18,315,000	
東京製綱	9,900	852.00	8,434,800	
サンコール	15,000	622.00	9,330,000	貸付有価証券 400株
モリテック スチール	12,400	219.00	2,715,600	貸付有価証券 5,800株
パイオラックス	23,300	1,696.00	39,516,800	
エイチワン	17,400	605.00	10,527,000	
日本発條	149,300	839.00	125,262,700	
中央発條	9,400	713.00	6,702,200	
アドバネクス	2,100	1,024.00	2,150,400	貸付有価証券 300株
立川ブラインド工業	7,600	1,152.00	8,755,200	貸付有価証券 3,500株
三益半導体工業	15,200	2,409.00	36,616,800	貸付有価証券 200株
日本ドライケミカル	4,000	1,455.00	5,820,000	貸付有価証券 100株（100株）
日本製鋼所	45,500	2,659.00	120,984,500	
三浦工業	69,000	2,983.00	205,827,000	貸付有価証券 500株
タクマ	50,800	1,244.00	63,195,200	貸付有価証券 100株

ツガミ	36,700	1,106.00	40,590,200	貸付有価証券 400株
オークマ	16,500	4,745.00	78,292,500	
芝浦機械	18,300	2,543.00	46,536,900	
アマダ	263,600	1,043.00	274,934,800	
アイダエンジニアリング	34,000	790.00	26,860,000	
TAKISAWA	4,300	1,039.00	4,467,700	
FUJI	71,800	1,923.00	138,071,400	貸付有価証券 2,900株
牧野フライス製作所	18,300	4,385.00	80,245,500	
オーエスジー	78,900	1,854.00	146,280,600	
ダイジェット工業	1,600	816.00	1,305,600	
旭ダイヤモンド工業	47,700	667.00	31,815,900	貸付有価証券 700株
DMG森精機	100,100	1,834.00	183,583,400	貸付有価証券 300株(300株)
ソディック	45,600	711.00	32,421,600	
ディスコ	26,500	38,100.00	1,009,650,000	
日東工器	8,000	1,486.00	11,888,000	
日進工具	13,800	1,018.00	14,048,400	
パンチ工業	13,900	401.00	5,573,900	
富士ダイス	7,700	569.00	4,381,300	
豊和工業	9,000	961.00	8,649,000	
ニデックオーケー	6,600	889.00	5,867,400	貸付有価証券 3,100株
東洋機械金属	11,400	544.00	6,201,600	
津田駒工業	3,000	582.00	1,746,000	貸付有価証券 100株
エンシュウ	3,500	651.00	2,278,500	貸付有価証券 100株(100株)
島精機製作所	26,300	1,862.00	48,970,600	貸付有価証券 1,800株
オプトラン	24,400	2,321.00	56,632,400	
NCホールディングス	3,400	2,008.00	6,827,200	
イワキポンプ	11,000	1,230.00	13,530,000	
フリー	17,300	1,094.00	18,926,200	
ヤマシンフィルタ	39,400	465.00	18,321,000	貸付有価証券 1,700株(1,600株)
日阪製作所	16,000	816.00	13,056,000	貸付有価証券

				200株
やまびこ	27,000	1,123.00	30,321,000	
野村マイクロ・サイエンス	5,600	4,125.00	23,100,000	貸付有価証券 100株
平田機工	7,900	5,270.00	41,633,000	
ペガサスマシン製造	18,200	765.00	13,923,000	
マルマエ	8,000	1,441.00	11,528,000	貸付有価証券 3,700株
タツモ	9,100	1,565.00	14,241,500	貸付有価証券 100株
ナプテスコ	103,700	3,355.00	347,913,500	
三井海洋開発	20,700	1,341.00	27,758,700	
レオン自動機	17,400	1,063.00	18,496,200	貸付有価証券 200株
S M C	53,600	56,820.00	3,045,552,000	
ホソカワミクロン	12,600	2,656.00	33,465,600	
ユニオンツール	7,300	3,240.00	23,652,000	貸付有価証券 100株(100株)
オイレス工業	23,100	1,446.00	33,402,600	
日精イー・エス・ビー機械	7,500	4,225.00	31,687,500	
サトーホールディングス	23,500	1,909.00	44,861,500	
技研製作所	17,200	2,890.00	49,708,000	
日本エアテック	8,300	1,181.00	9,802,300	
カワタ	4,800	808.00	3,878,400	
日精樹脂工業	12,300	908.00	11,168,400	
オカダアイヨン	5,100	1,496.00	7,629,600	
ワイエイシイホールディングス	7,000	1,567.00	10,969,000	貸付有価証券 3,200株(700株)
小松製作所	774,000	2,932.00	2,269,368,000	
住友重機械工業	97,700	2,751.00	268,772,700	
日立建機	65,800	2,993.00	196,939,400	
日工	24,500	614.00	15,043,000	
巴工業	7,100	2,346.00	16,656,600	貸付有価証券 1,500株
井関農機	15,500	1,188.00	18,414,000	
T O W A	16,800	1,729.00	29,047,200	貸付有価証券 1,600株
丸山製作所	2,800	1,516.00	4,244,800	貸付有価証券

				100株(100株)
北川鉄工所	6,500	1,140.00	7,410,000	
ローツェ	8,600	7,150.00	61,490,000	貸付有価証券 900株(400株)
タカキタ	4,600	417.00	1,918,200	貸付有価証券 2,500株(200株)
クボタ	874,100	1,833.50	1,602,662,350	
荏原実業	8,200	2,233.00	18,310,600	
三菱化工機	5,300	1,996.00	10,578,800	
月島機械	22,300	975.00	21,742,500	貸付有価証券 100株
帝国電機製作所	12,500	2,180.00	27,250,000	
東京機械製作所	3,800	525.00	1,995,000	貸付有価証券 500株(100株)
新東工業	33,400	646.00	21,576,400	
澁谷工業	15,500	2,313.00	35,851,500	
アイチ コーポレーショ ン	23,400	771.00	18,041,400	
小森コーポレーション	38,300	802.00	30,716,600	
鶴見製作所	12,600	1,974.00	24,872,400	
住友精密工業	2,300	3,640.00	8,372,000	貸付有価証券 100株(100株)
日本ギア工業	5,500	322.00	1,771,000	
酒井重工業	2,700	3,405.00	9,193,500	
荏原製作所	67,600	4,795.00	324,142,000	
石井鐵工所	1,900	2,255.00	4,284,500	
西島製作所	14,200	1,426.00	20,249,200	
北越工業	16,600	1,241.00	20,600,600	
ダイキン工業	197,200	20,730.00	4,087,956,000	貸付有価証券 1,200株
オルガノ	22,700	3,025.00	68,667,500	
トーヨーカネツ	6,300	2,558.00	16,115,400	
栗田工業	92,400	5,540.00	511,896,000	貸付有価証券 1,700株
椿本チエイン	23,400	2,959.00	69,240,600	
大同工業	6,600	710.00	4,686,000	貸付有価証券 100株
木村化工機	12,600	695.00	8,757,000	貸付有価証券 2,600株

アネスト岩田	28,100	853.00	23,969,300	
ダイフク	85,200	6,190.00	527,388,000	貸付有価証券 600株
サムコ	5,400	3,420.00	18,468,000	
加藤製作所	7,800	702.00	5,475,600	
油研工業	2,500	1,772.00	4,430,000	
タダノ	87,100	926.00	80,654,600	
フジテック	60,500	3,065.00	185,432,500	貸付有価証券 200株
C K D	45,700	1,874.00	85,641,800	
キトー	5,100	2,720.00	13,872,000	
平和	54,900	2,438.00	133,846,200	
理想科学工業	14,700	2,038.00	29,958,600	
S A N K Y O	32,500	5,340.00	173,550,000	貸付有価証券 100株
日本金銭機械	18,100	1,020.00	18,462,000	貸付有価証券 400株
マースグループホールディングス	9,700	2,400.00	23,280,000	
フクシマガリレイ	12,100	4,110.00	49,731,000	
オーイズミ	6,200	476.00	2,951,200	
ダイコク電機	9,000	2,032.00	18,288,000	貸付有価証券 3,000株
竹内製作所	30,000	2,916.00	87,480,000	
アマノ	46,900	2,450.00	114,905,000	貸付有価証券 100株
J U K I	25,600	636.00	16,281,600	貸付有価証券 500株
ジャノメ	16,700	572.00	9,552,400	
マックス	20,400	1,922.00	39,208,800	
グローリー	42,800	2,139.00	91,549,200	貸付有価証券 1,400株
新晃工業	16,600	1,401.00	23,256,600	貸付有価証券 100株
大和冷機工業	25,300	1,128.00	28,538,400	
セガサミーホールディングス	132,800	1,983.00	263,342,400	貸付有価証券 3,700株
日本ピストンリング	5,500	1,205.00	6,627,500	
リケン	6,500	2,224.00	14,456,000	

T P R	19,300	1,191.00	22,986,300	
ツバキ・ナカシマ	40,700	980.00	39,886,000	貸付有価証券 100株
ホシザキ	106,300	4,580.00	486,854,000	
大豊工業	14,300	616.00	8,808,800	
日本精工	303,400	693.00	210,256,200	貸付有価証券 6,300株
N T N	325,600	269.00	87,586,400	貸付有価証券 4,000株
ジェイテクト	147,000	921.00	135,387,000	
不二越	12,200	3,540.00	43,188,000	貸付有価証券 400株
日本トムソン	40,500	529.00	21,424,500	
T H K	95,300	2,535.00	241,585,500	
ユーシン精機	13,100	660.00	8,646,000	
前澤給装工業	11,600	907.00	10,521,200	
イーグル工業	18,300	1,051.00	19,233,300	
前澤工業	10,600	608.00	6,444,800	貸付有価証券 100株
日本ピラー工業	15,300	2,706.00	41,401,800	
キッツ	60,800	801.00	48,700,800	貸付有価証券 5,400株
マキタ	205,500	3,065.00	629,857,500	貸付有価証券 4,500株
三井E & S ホールディング グス	74,700	384.00	28,684,800	貸付有価証券 10,800株
日立造船	135,300	820.00	110,946,000	
三菱重工業	288,900	5,353.00	1,546,481,700	貸付有価証券 200株
I H I	104,100	3,895.00	405,469,500	貸付有価証券 6,100株
サノヤスホールディング ス	22,100	124.00	2,740,400	貸付有価証券 4,600株
スター精密	31,200	1,651.00	51,511,200	
日清紡ホールディングス	134,500	994.00	133,693,000	
イビデン	94,800	4,695.00	445,086,000	貸付有価証券 2,500株
コニカミノルタ	368,900	527.00	194,410,300	貸付有価証券 4,400株
ブラザー工業	220,700	2,010.00	443,607,000	

ミネベアミツミ	287,300	2,016.00	579,196,800	
日立製作所	829,300	6,842.00	5,674,070,600	貸付有価証券 14,300株
東芝	317,900	4,627.00	1,470,923,300	貸付有価証券 4,100株
三菱電機	1,707,200	1,338.00	2,284,233,600	貸付有価証券 11,100株
富士電機	100,400	5,120.00	514,048,000	
東洋電機製造	5,900	836.00	4,932,400	
安川電機	195,700	4,315.00	844,445,500	貸付有価証券 7,400株
シンフォニアテクノロジー	18,200	1,457.00	26,517,400	
明電舎	25,100	1,903.00	47,765,300	
オリジン	3,700	1,201.00	4,443,700	
山洋電気	7,100	5,700.00	40,470,000	
デンヨー	12,600	1,438.00	18,118,800	
PHCホールディングス	22,900	1,444.00	33,067,600	
ソシオネクスト	17,000	5,620.00	95,540,000	貸付有価証券 1,900株（1,300株）
東芝テック	24,700	3,625.00	89,537,500	
芝浦メカトロニクス	3,200	10,060.00	32,192,000	
マブチモーター	41,000	3,835.00	157,235,000	
日本電産	401,100	6,941.00	2,784,035,100	貸付有価証券 5,200株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	12,100	468.00	5,662,800	貸付有価証券 600株（600株）
トレックス・セミコンダクター	7,800	2,571.00	20,053,800	貸付有価証券 300株
東光高岳	10,000	1,821.00	18,210,000	
ダブル・スコープ	54,000	1,370.00	73,980,000	貸付有価証券 25,300株（23,200株）
ダイヘン	14,900	3,865.00	57,588,500	
ヤーマン	32,100	1,361.00	43,688,100	貸付有価証券 13,500株（2,000株）
JVCケンウッド	150,500	365.00	54,932,500	貸付有価証券 800株
ミマキエンジニアリング	15,700	576.00	9,043,200	
I - P E X	9,200	1,204.00	11,076,800	
日新電機	39,600	1,280.00	50,688,000	

大崎電気工業	39,200	525.00	20,580,000	
オムロン	151,400	6,468.00	979,255,200	
日東工業	22,300	2,368.00	52,806,400	
I D E C	24,400	2,929.00	71,467,600	
正興電機製作所	6,200	992.00	6,150,400	貸付有価証券 2,900株(2,100株)
不二電機工業	3,300	1,116.00	3,682,800	貸付有価証券 1,500株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	54,200	2,090.00	113,278,000	貸付有価証券 1,000株
サクサホールディングス	3,400	1,200.00	4,080,000	
メルコホールディングス	4,400	2,991.00	13,160,400	
テクノメディカ	4,000	1,686.00	6,744,000	貸付有価証券 300株(300株)
ダイヤモンドエレクト リックホールディング	5,100	1,352.00	6,895,200	貸付有価証券 100株
日本電気	233,600	4,655.00	1,087,408,000	貸付有価証券 300株
富士通	164,600	17,845.00	2,937,287,000	
沖電気工業	74,700	704.00	52,588,800	貸付有価証券 200株
岩崎通信機	7,200	777.00	5,594,400	
電気興業	7,800	1,995.00	15,561,000	
サンケン電気	15,300	6,420.00	98,226,000	貸付有価証券 200株
ナカヨ	2,600	1,069.00	2,779,400	
アイホン	10,000	1,823.00	18,230,000	
ルネサスエレクトロニク ス	1,077,800	1,196.50	1,289,587,700	貸付有価証券 2,300株
セイコーエプソン	220,000	1,976.00	434,720,000	貸付有価証券 2,300株
ワコム	130,800	574.00	75,079,200	貸付有価証券 10,400株(5,800株)
アルバック	39,200	5,660.00	221,872,000	貸付有価証券 3,500株
アクセル	6,200	1,520.00	9,424,000	貸付有価証券 300株(300株)
E I Z O	12,100	3,440.00	41,624,000	
日本信号	37,600	1,017.00	38,239,200	
京三製作所	34,600	405.00	14,013,000	

能美防災	22,300	1,561.00	34,810,300	
ホーチキ	12,300	1,382.00	16,998,600	
星和電機	6,600	436.00	2,877,600	
エレコム	39,500	1,370.00	54,115,000	貸付有価証券 100株
パナソニック ホール ディングス	1,951,100	1,131.00	2,206,694,100	
シャープ	198,900	961.00	191,142,900	貸付有価証券 92,000株(8,500株)
アンリツ	116,300	1,277.00	148,515,100	貸付有価証券 1,300株
富士通ゼネラル	46,800	3,100.00	145,080,000	貸付有価証券 2,000株
ソニーグループ	1,156,900	10,230.00	11,835,087,000	貸付有価証券 11,500株
T D K	261,500	4,370.00	1,142,755,000	
帝国通信工業	7,400	1,373.00	10,160,200	
タムラ製作所	70,900	711.00	50,409,900	貸付有価証券 1,700株
アルプスアルパイン	147,500	1,219.00	179,802,500	貸付有価証券 800株(600株)
池上通信機	5,200	523.00	2,719,600	
日本電波工業	19,800	1,545.00	30,591,000	貸付有価証券 1,200株(1,100株)
鈴木	9,700	835.00	8,099,500	
メイコー	18,000	2,466.00	44,388,000	貸付有価証券 7,400株
日本トリム	3,700	2,468.00	9,131,600	
ローランド ディー ジー	9,300	2,900.00	26,970,000	貸付有価証券 100株
フォスター電機	15,300	820.00	12,546,000	
S M K	4,000	2,255.00	9,020,000	
ヨコオ	13,100	2,119.00	27,758,900	
ティアック	25,500	117.00	2,983,500	貸付有価証券 1,400株(700株)
ホシデン	39,600	1,594.00	63,122,400	貸付有価証券 600株
ヒロセ電機	27,300	16,780.00	458,094,000	
日本航空電子工業	33,900	2,116.00	71,732,400	貸付有価証券 10,400株(9,500株)

TOA	19,000	765.00	14,535,000	貸付有価証券 100株
マクセル	35,900	1,345.00	48,285,500	貸付有価証券 1,300株
古野電気	21,500	972.00	20,898,000	
スミダコーポレーション	15,100	1,379.00	20,822,900	
アイコム	6,400	2,763.00	17,683,200	貸付有価証券 200株
リオン	6,800	1,793.00	12,192,400	
横河電機	180,700	2,194.00	396,455,800	貸付有価証券 100株
新電元工業	6,300	2,994.00	18,862,200	貸付有価証券 300株
アズビル	114,300	3,365.00	384,619,500	貸付有価証券 2,400株
東亜ディーケーケー	7,700	798.00	6,144,600	貸付有価証券 600株(300株)
日本光電工業	75,500	3,130.00	236,315,000	貸付有価証券 600株
チノー	6,800	1,737.00	11,811,600	
共和電業	15,400	361.00	5,559,400	貸付有価証券 400株
日本電子材料	10,800	1,344.00	14,515,200	
堀場製作所	36,400	5,820.00	211,848,000	
アドバンテスト	128,900	8,600.00	1,108,540,000	貸付有価証券 2,800株
小野測器	6,000	389.00	2,334,000	貸付有価証券 200株
エスペック	13,100	1,905.00	24,955,500	
キーエンス	163,600	51,420.00	8,412,312,000	
日置電機	8,600	6,310.00	54,266,000	
シスメックス	141,100	7,942.00	1,120,616,200	
日本マイクロニクス	26,900	1,328.00	35,723,200	
メガチップス	13,400	2,437.00	32,655,800	
OBARA GROUP	7,700	3,455.00	26,603,500	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
澤藤電機	1,900	1,090.00	2,071,000	
原田工業	7,200	813.00	5,853,600	貸付有価証券 3,800株(400株)
コーセル	21,800	1,026.00	22,366,800	

イリソ電子工業	15,000	4,230.00	63,450,000	貸付有価証券 900株
オブテックスグループ	30,000	1,830.00	54,900,000	
千代田インテグレ	6,600	2,280.00	15,048,000	
レーザーテック	80,700	22,660.00	1,828,662,000	
スタンレー電気	116,400	2,528.00	294,259,200	
岩崎電気	5,300	2,307.00	12,227,100	
ウシオ電機	85,400	1,632.00	139,372,800	貸付有価証券 1,500株
岡谷電機産業	12,600	244.00	3,074,400	貸付有価証券 1,300株（1,200株）
ヘリオス テクノ ホールディング	15,100	415.00	6,266,500	貸付有価証券 1,800株（1,000株）
エノモト	4,200	1,636.00	6,871,200	貸付有価証券 100株（100株）
日本セラミック	16,700	2,431.00	40,597,700	
遠藤照明	7,300	711.00	5,190,300	
古河電池	12,000	1,071.00	12,852,000	貸付有価証券 2,600株（1,300株）
双信電機	6,600	362.00	2,389,200	
山一電機	14,300	1,643.00	23,494,900	
図研	14,200	3,060.00	43,452,000	
日本電子	41,000	3,610.00	148,010,000	貸付有価証券 400株（300株）
カシオ計算機	121,800	1,300.00	158,340,000	貸付有価証券 2,000株
ファナック	160,500	20,185.00	3,239,692,500	貸付有価証券 2,100株
日本シイエムケイ	34,700	466.00	16,170,200	
エンプラス	4,800	3,905.00	18,744,000	
大真空	19,900	699.00	13,910,100	貸付有価証券 4,300株
ローム	75,600	9,820.00	742,392,000	貸付有価証券 300株
浜松ホトニクス	131,200	6,360.00	834,432,000	貸付有価証券 100株
三井ハイテック	16,900	6,080.00	102,752,000	貸付有価証券 7,900株（100株）
新光電気工業	57,900	3,350.00	193,965,000	貸付有価証券 12,000株（1,600株）

京セラ	254,000	6,567.00	1,668,018,000	
太陽誘電	79,600	3,905.00	310,838,000	貸付有価証券 1,500株
村田製作所	496,000	6,779.00	3,362,384,000	貸付有価証券 800株
双葉電子工業	31,100	526.00	16,358,600	
北陸電気工業	6,100	1,222.00	7,454,200	
ニチコン	33,400	1,215.00	40,581,000	貸付有価証券 6,000株
日本ケミコン	16,200	1,556.00	25,207,200	貸付有価証券 4,800株（700株）
K O A	24,800	1,873.00	46,450,400	
市光工業	23,600	362.00	8,543,200	
小糸製作所	196,700	1,973.00	388,089,100	
ミツバ	30,700	468.00	14,367,600	
S C R E E Nホールディングス	28,000	8,560.00	239,680,000	貸付有価証券 200株
キャノン電子	18,100	1,538.00	27,837,800	
キャノン	897,300	2,938.50	2,636,716,050	
リコー	410,100	1,006.00	412,560,600	貸付有価証券 1,900株
象印マホービン	48,800	1,640.00	80,032,000	貸付有価証券 8,600株（100株）
M U T O Hホールディングス	2,200	1,480.00	3,256,000	貸付有価証券 200株
東京エレクトロン	115,400	40,070.00	4,624,078,000	
イノテック	10,900	1,276.00	13,908,400	
トヨタ紡織	68,900	1,760.00	121,264,000	
芦森工業	3,000	1,134.00	3,402,000	
ユニプレス	29,400	759.00	22,314,600	
豊田自動織機	119,600	7,300.00	873,080,000	
モリタホールディングス	28,700	1,152.00	33,062,400	
三櫻工業	25,000	600.00	15,000,000	
デンソー	337,300	6,709.00	2,262,945,700	
東海理化電機製作所	46,100	1,414.00	65,185,400	
川崎重工業	123,200	3,140.00	386,848,000	貸付有価証券 900株
名村造船所	41,900	411.00	17,220,900	貸付有価証券 11,200株

日本車輛製造	6,300	1,918.00	12,083,400	
三菱ロジスネクスト	26,100	741.00	19,340,100	貸付有価証券 100株
近畿車輛	2,300	1,051.00	2,417,300	
日産自動車	2,323,200	420.80	977,602,560	貸付有価証券 77,300株
いすゞ自動車	475,500	1,577.00	749,863,500	
トヨタ自動車	8,980,300	1,823.00	16,371,086,900	貸付有価証券 96,900株
日野自動車	210,800	516.00	108,772,800	貸付有価証券 12,100株
三菱自動車工業	638,000	506.00	322,828,000	貸付有価証券 18,900株(18,900株)
エフテック	11,300	501.00	5,661,300	
レシップホールディングス	6,400	457.00	2,924,800	貸付有価証券 100株(100株)
G M B	3,200	673.00	2,153,600	
ファルテック	2,600	600.00	1,560,000	
武蔵精密工業	40,000	1,592.00	63,680,000	貸付有価証券 2,200株(100株)
日産車体	28,800	836.00	24,076,800	貸付有価証券 1,500株
新明和工業	51,400	1,069.00	54,946,600	
極東開発工業	28,800	1,422.00	40,953,600	貸付有価証券 600株
トピー工業	13,300	1,605.00	21,346,500	
ティラド	4,100	2,509.00	10,286,900	
タチエス	25,900	1,102.00	28,541,800	
N O K	63,500	1,190.00	75,565,000	貸付有価証券 8,600株
フタバ産業	43,800	339.00	14,848,200	
K Y B	15,700	3,315.00	52,045,500	
大同メタル工業	32,000	480.00	15,360,000	
プレス工業	73,100	415.00	30,336,500	貸付有価証券 4,100株
ミクニ	18,700	315.00	5,890,500	貸付有価証券 8,500株(8,500株)
太平洋工業	37,500	1,005.00	37,687,500	貸付有価証券 300株
河西工業	21,700	134.00	2,907,800	

アイシン	126,200	3,530.00	445,486,000	
マツダ	541,000	1,005.00	543,705,000	
今仙電機製作所	10,300	620.00	6,386,000	
本田技研工業	1,329,400	3,079.00	4,093,222,600	貸付有価証券 19,300株
スズキ	300,400	4,356.00	1,308,542,400	貸付有価証券 800株
S U B A R U	517,500	2,038.00	1,054,665,000	
安永	7,100	668.00	4,742,800	貸付有価証券 300株（300株）
ヤマハ発動機	257,000	3,110.00	799,270,000	貸付有価証券 1,500株
T B K	16,200	230.00	3,726,000	貸付有価証券 1,100株（400株）
エクセディ	26,700	1,606.00	42,880,200	貸付有価証券 100株
豊田合成	47,700	2,036.00	97,117,200	貸付有価証券 400株
愛三工業	27,000	683.00	18,441,000	
盟和産業	2,300	919.00	2,113,700	
日本プラスト	12,800	408.00	5,222,400	
ヨロズ	15,300	674.00	10,312,200	
エフ・シー・シー	29,000	1,335.00	38,715,000	貸付有価証券 200株
シマノ	66,900	21,220.00	1,419,618,000	
テイ・エス テック	74,900	1,534.00	114,896,600	貸付有価証券 400株
ジャムコ	8,900	1,293.00	11,507,700	貸付有価証券 2,800株（800株）
テルモ	511,000	3,746.00	1,914,206,000	貸付有価証券 13,900株
クリエートメディック	5,300	886.00	4,695,800	貸付有価証券 200株
日機装	40,900	963.00	39,386,700	
日本エム・ディ・エム	9,700	888.00	8,613,600	
島津製作所	199,200	3,750.00	747,000,000	
J M S	15,100	490.00	7,399,000	
クボテック	3,800	207.00	786,600	貸付有価証券 100株（100株）
長野計器	11,900	1,136.00	13,518,400	

ブイ・テクノロジー	8,000	2,468.00	19,744,000	
東京計器	12,500	1,309.00	16,362,500	貸付有価証券 2,800株（900株）
愛知時計電機	6,400	1,333.00	8,531,200	
インターアクション	9,900	1,470.00	14,553,000	貸付有価証券 200株
オーバル	14,400	461.00	6,638,400	貸付有価証券 6,700株
東京精密	35,900	4,380.00	157,242,000	貸付有価証券 100株
マニー	71,900	2,035.00	146,316,500	貸付有価証券 400株
ニコン	254,300	1,189.00	302,362,700	貸付有価証券 8,400株
トプコン	86,100	1,462.00	125,878,200	
オリンパス	1,022,400	2,405.00	2,458,872,000	貸付有価証券 23,100株
理研計器	10,100	4,325.00	43,682,500	
タムロン	12,200	3,060.00	37,332,000	
H O Y A	353,300	12,685.00	4,481,610,500	貸付有価証券 4,000株
シード	8,300	481.00	3,992,300	
ノーリツ鋼機	15,500	2,700.00	41,850,000	
A & D ホロンホールディングス	23,800	1,002.00	23,847,600	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
朝日インテック	216,000	2,141.00	462,456,000	
シチズン時計	179,800	589.00	105,902,200	貸付有価証券 7,400株
リズム	5,100	1,676.00	8,547,600	貸付有価証券 400株
大研医器	12,300	444.00	5,461,200	貸付有価証券 300株（300株）
メニコン	56,100	2,690.00	150,909,000	貸付有価証券 600株
シンシア	1,500	520.00	780,000	貸付有価証券 700株
松風	7,400	2,245.00	16,613,000	貸付有価証券 600株（600株）
セイコーグループ	25,300	2,935.00	74,255,500	貸付有価証券 300株
ニプロ	136,300	1,032.00	140,661,600	貸付有価証券

				2,700株
KYORITSU	24,300	120.00	2,916,000	貸付有価証券 9,000株
中本ボックス	4,900	1,566.00	7,673,400	貸付有価証券 200株(200株)
スノーピーク	28,000	2,495.00	69,860,000	貸付有価証券 13,100株(2,200株)
パラマウントベッドホールディングス	37,800	2,543.00	96,125,400	
トランザクション	12,600	1,154.00	14,540,400	貸付有価証券 700株(100株)
粧美堂	4,400	356.00	1,566,400	貸付有価証券 2,100株
ニホンフラッシュ	15,300	864.00	13,219,200	
前田工織	17,800	3,045.00	54,201,000	貸付有価証券 1,000株
永大産業	17,400	216.00	3,758,400	貸付有価証券 200株
アートネイチャー	16,800	743.00	12,482,400	
バンダイナムコホールディングス	149,300	8,334.00	1,244,266,200	
アイフィスジャパン	4,500	616.00	2,772,000	貸付有価証券 2,100株
SHOEI	17,200	5,060.00	87,032,000	
フランスベッドホールディングス	20,300	934.00	18,960,200	
パイロットコーポレーション	25,600	4,845.00	124,032,000	
萩原工業	10,900	1,172.00	12,774,800	貸付有価証券 2,300株
フジシールインターナショナル	33,100	1,659.00	54,912,900	貸付有価証券 100株
タカラトミー	75,500	1,252.00	94,526,000	貸付有価証券 400株
広済堂ホールディングス	11,000	2,036.00	22,396,000	
エステールホールディングス	3,800	627.00	2,382,600	貸付有価証券 1,800株
タカノ	6,100	665.00	4,056,500	貸付有価証券 2,600株
プロネクサス	13,600	938.00	12,756,800	
ホクシン	12,500	147.00	1,837,500	貸付有価証券

				1,100株(200株)
ウッドワン	5,400	874.00	4,719,600	貸付有価証券 100株
大建工業	9,900	2,080.00	20,592,000	
凸版印刷	213,900	1,998.00	427,372,200	
大日本印刷	194,000	2,670.00	517,980,000	
共同印刷	4,600	2,675.00	12,305,000	貸付有価証券 100株(100株)
N I S S H A	31,100	1,808.00	56,228,800	
光村印刷	1,400	1,166.00	1,632,400	貸付有価証券 600株
T A K A R A & C O M P A N Y	11,300	2,087.00	23,583,100	貸付有価証券 1,400株
アシックス	151,000	2,964.00	447,564,000	
ツツミ	3,700	1,888.00	6,985,600	
ローランド	12,000	3,570.00	42,840,000	貸付有価証券 100株
小松ウオール工業	6,000	1,800.00	10,800,000	
ヤマハ	103,100	4,890.00	504,159,000	
河合楽器製作所	4,400	2,510.00	11,044,000	
クリナップ	18,300	636.00	11,638,800	
ピジョン	104,200	2,197.00	228,927,400	
兼松サステック	1,100	1,568.00	1,724,800	
キングジム	14,400	887.00	12,772,800	貸付有価証券 400株(200株)
リンテック	32,800	2,171.00	71,208,800	貸付有価証券 100株
イトーキ	33,500	601.00	20,133,500	貸付有価証券 300株
任天堂	1,032,500	5,617.00	5,799,552,500	貸付有価証券 43,300株
三菱鉛筆	23,200	1,416.00	32,851,200	
タカラスタンダード	31,700	1,376.00	43,619,200	貸付有価証券 100株
コクヨ	78,700	1,876.00	147,641,200	
ナカバヤシ	17,600	480.00	8,448,000	
グローブライド	13,200	2,574.00	33,976,800	
オカムラ	49,200	1,355.00	66,666,000	
美津濃	16,300	2,774.00	45,216,200	

東京電力ホールディングス	1,474,300	492.00	725,355,600	貸付有価証券 109,900株
中部電力	602,700	1,333.00	803,399,100	貸付有価証券 8,600株
関西電力	631,500	1,246.00	786,849,000	貸付有価証券 600株
中国電力	260,500	646.00	168,283,000	貸付有価証券 12,700株
北陸電力	154,400	530.00	81,832,000	貸付有価証券 7,300株
東北電力	399,800	673.00	269,065,400	貸付有価証券 14,800株
四国電力	139,600	739.00	103,164,400	
九州電力	377,000	722.00	272,194,000	貸付有価証券 6,800株
北海道電力	158,000	448.00	70,784,000	貸付有価証券 600株
沖縄電力	38,300	990.00	37,917,000	貸付有価証券 5,700株
電源開発	123,100	2,106.00	259,248,600	
エフオン	11,900	476.00	5,664,400	
イーレックス	29,000	2,202.00	63,858,000	貸付有価証券 100株
レノバ	43,500	2,340.00	101,790,000	貸付有価証券 14,100株（7,500株）
東京瓦斯	345,800	2,568.00	888,014,400	
大阪瓦斯	331,300	2,097.00	694,736,100	
東邦瓦斯	64,400	2,490.00	160,356,000	
北海道瓦斯	9,800	1,604.00	15,719,200	
広島ガス	34,500	340.00	11,730,000	
西部ガスホールディングス	15,400	1,677.00	25,825,800	
静岡ガス	37,300	1,087.00	40,545,100	貸付有価証券 2,200株
メタウォーター	20,400	1,639.00	33,435,600	貸付有価証券 500株
S B Sホールディングス	14,600	2,842.00	41,493,200	
東武鉄道	179,600	3,120.00	560,352,000	貸付有価証券 100株
相鉄ホールディングス	54,000	2,204.00	119,016,000	貸付有価証券 500株

東急	458,600	1,676.00	768,613,600	貸付有価証券 20,100株
京浜急行電鉄	185,500	1,360.00	252,280,000	
小田急電鉄	247,900	1,707.00	423,165,300	貸付有価証券 700株
京王電鉄	86,500	4,895.00	423,417,500	貸付有価証券 4,100株
京成電鉄	105,400	3,735.00	393,669,000	
富士急行	20,100	4,735.00	95,173,500	貸付有価証券 2,400株（500株）
東日本旅客鉄道	277,400	7,495.00	2,079,113,000	貸付有価証券 300株
西日本旅客鉄道	208,900	5,621.00	1,174,226,900	貸付有価証券 7,400株
東海旅客鉄道	126,000	16,030.00	2,019,780,000	貸付有価証券 1,700株
西武ホールディングス	197,800	1,445.00	285,821,000	貸付有価証券 3,000株
鴻池運輸	27,900	1,534.00	42,798,600	
西日本鉄道	43,700	2,498.00	109,162,600	
ハマキョウレックス	12,800	3,150.00	40,320,000	
サカイ引越センター	7,800	4,405.00	34,359,000	
近鉄グループホールディングス	163,200	4,410.00	719,712,000	貸付有価証券 300株
阪急阪神ホールディングス	217,700	3,930.00	855,561,000	貸付有価証券 200株
南海電気鉄道	78,000	2,841.00	221,598,000	貸付有価証券 600株
京阪ホールディングス	67,500	3,380.00	228,150,000	貸付有価証券 300株
神戸電鉄	4,400	3,150.00	13,860,000	貸付有価証券 1,500株
名古屋鉄道	180,400	2,189.00	394,895,600	貸付有価証券 900株
山陽電気鉄道	12,300	2,119.00	26,063,700	
アルプス物流	13,000	1,120.00	14,560,000	貸付有価証券 300株（300株）
ヤマトホールディングス	209,100	2,174.00	454,583,400	
山九	41,500	4,825.00	200,237,500	
丸運	8,000	216.00	1,728,000	貸付有価証券 500株

丸全昭和運輸	10,100	3,020.00	30,502,000	
センコーグループホールディングス	86,500	965.00	83,472,500	
トナミホールディングス	3,600	3,585.00	12,906,000	
ニッコンホールディングス	52,300	2,340.00	122,382,000	
日本石油輸送	1,600	2,171.00	3,473,600	
福山通運	13,600	3,020.00	41,072,000	
セイノーホールディングス	101,600	1,178.00	119,684,800	
エスライン	4,600	795.00	3,657,000	
神奈川中央交通	4,600	3,230.00	14,858,000	貸付有価証券 1,500株
日立物流	36,000	8,910.00	320,760,000	
A Z - COM丸和ホールディングス	39,400	1,534.00	60,439,600	貸付有価証券 5,500株
C & F ロジホールディングス	15,700	1,217.00	19,106,900	
九州旅客鉄道	115,400	2,922.00	337,198,800	
S Gホールディングス	313,300	1,875.00	587,437,500	
NIPPON EXPRESSホールディングス	61,000	7,880.00	480,680,000	
日本郵船	436,800	3,170.00	1,384,656,000	
商船三井	287,800	3,355.00	965,569,000	貸付有価証券 73,900株（4,000株）
川崎汽船	139,100	2,863.00	398,243,300	貸付有価証券 14,800株
NSユナイテッド海運	8,800	3,860.00	33,968,000	貸付有価証券 600株
明治海運	15,900	684.00	10,875,600	貸付有価証券 7,400株
飯野海運	59,900	938.00	56,186,200	貸付有価証券 3,200株
共栄タンカー	2,900	945.00	2,740,500	貸付有価証券 300株（300株）
乾汽船	20,700	1,955.00	40,468,500	貸付有価証券 3,500株（500株）
日本航空	401,000	2,677.00	1,073,477,000	
ANAホールディングス	444,300	2,821.50	1,253,592,450	貸付有価証券 60,000株
パスコ	3,200	1,320.00	4,224,000	

トランコム	4,700	7,350.00	34,545,000	
日新	12,400	2,026.00	25,122,400	
三菱倉庫	35,100	3,075.00	107,932,500	
三井倉庫ホールディングス	15,200	3,620.00	55,024,000	貸付有価証券 100株
住友倉庫	44,800	1,970.00	88,256,000	貸付有価証券 6,300株
澁澤倉庫	6,500	2,072.00	13,468,000	
東陽倉庫	21,600	251.00	5,421,600	貸付有価証券 400株
日本トランスシティ	32,900	494.00	16,252,600	貸付有価証券 100株
ケイヒン	2,900	1,434.00	4,158,600	
中央倉庫	7,900	938.00	7,410,200	貸付有価証券 100株（100株）
川西倉庫	2,700	985.00	2,659,500	貸付有価証券 1,300株
安田倉庫	11,100	919.00	10,200,900	
ファイズホールディングス	3,000	848.00	2,544,000	
東洋埠頭	4,700	1,262.00	5,931,400	
上組	81,200	2,678.00	217,453,600	
サンリツ	3,600	714.00	2,570,400	
キムラユニティー	7,800	764.00	5,959,200	貸付有価証券 300株（300株）
キューソー流通システム	9,800	945.00	9,261,000	貸付有価証券 3,200株
東海運	9,600	278.00	2,668,800	
エーアイティー	10,200	1,397.00	14,249,400	貸付有価証券 300株（300株）
内外トランスライン	5,900	2,176.00	12,838,400	貸付有価証券 2,700株
日本コンセプト	5,100	1,435.00	7,318,500	
NEC ネットエスアイ	54,800	1,645.00	90,146,000	
クロスキャット	9,400	1,342.00	12,614,800	貸付有価証券 800株（800株）
システナ	275,800	403.00	111,147,400	
デジタルアーツ	10,400	5,620.00	58,448,000	貸付有価証券 400株
日鉄ソリューションズ	28,000	3,175.00	88,900,000	

キューブシステム	9,800	1,016.00	9,956,800	貸付有価証券 3,400株
コア	7,300	1,449.00	10,577,700	
手間いらず	2,800	4,820.00	13,496,000	
ラクーンホールディングス	16,300	1,057.00	17,229,100	貸付有価証券 100株
ソリトンシステムズ	8,500	1,009.00	8,576,500	貸付有価証券 200株(200株)
ソフトクリエイティブホールディングス	6,700	3,010.00	20,167,000	
T I S	184,300	3,485.00	642,285,500	
J N Sホールディングス	7,400	305.00	2,257,000	貸付有価証券 300株
グリー	87,900	700.00	61,530,000	貸付有価証券 33,900株(3,300株)
G M Oペパボ	2,300	1,874.00	4,310,200	
コーエーテクモホールディングス	102,800	2,293.00	235,720,400	貸付有価証券 5,000株
三菱総合研究所	8,000	4,795.00	38,360,000	
ボルテージ	4,700	314.00	1,475,800	貸付有価証券 2,100株(100株)
電算	1,900	1,587.00	3,015,300	
A G S	6,900	676.00	4,664,400	貸付有価証券 100株
ファインデックス	13,000	482.00	6,266,000	
ブレインパッド	16,400	745.00	12,218,000	貸付有価証券 500株
K L a b	32,300	423.00	13,662,900	貸付有価証券 11,000株
ポールトゥウィンホールディングス	28,000	780.00	21,840,000	
ネクソン	423,800	2,907.00	1,231,986,600	
アイスタイル	52,400	536.00	28,086,400	貸付有価証券 24,500株(1,800株)
エムアップホールディングス	20,100	1,273.00	25,587,300	貸付有価証券 600株
エイチーム	12,100	735.00	8,893,500	
エニグモ	20,900	661.00	13,814,900	貸付有価証券 9,800株(9,500株)
テクノスジャパン	13,500	458.00	6,183,000	
e n i s h	12,300	339.00	4,169,700	貸付有価証券

				5,900株(1,100株)
コロプラ	63,600	634.00	40,322,400	貸付有価証券 1,100株
オルトプラス	12,500	191.00	2,387,500	貸付有価証券 1,400株(1,100株)
ブロードリーフ	95,800	416.00	39,852,800	貸付有価証券 7,000株
クロス・マーケティング グループ	6,600	715.00	4,719,000	貸付有価証券 3,100株(2,100株)
デジタルハーツホール ディングス	10,200	1,740.00	17,748,000	
システム情報	14,500	846.00	12,267,000	
メディアドゥ	6,600	1,741.00	11,490,600	
じげん	47,800	371.00	17,733,800	貸付有価証券 100株
ブイキューブ	19,700	702.00	13,829,400	貸付有価証券 9,200株(6,000株)
エンカレッジ・テクノ ロジ	3,800	495.00	1,881,000	
サイバーリンクス	5,200	921.00	4,789,200	
ディー・エル・イー	11,700	289.00	3,381,300	貸付有価証券 4,600株(100株)
フィックスターズ	18,500	1,228.00	22,718,000	
CARTA HOLDI NGS	7,900	1,543.00	12,189,700	貸付有価証券 3,600株(2,400株)
オブティム	13,500	1,016.00	13,716,000	貸付有価証券 900株
セレス	6,600	870.00	5,742,000	貸付有価証券 600株
S H I F T	12,000	23,540.00	282,480,000	貸付有価証券 4,000株(500株)
ティーガイア	17,100	1,625.00	27,787,500	貸付有価証券 400株
セック	2,300	2,750.00	6,325,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
テクマトリックス	29,900	1,743.00	52,115,700	貸付有価証券 200株
プロシップ	7,200	1,487.00	10,706,400	
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	50,200	2,144.00	107,628,800	
GMOペイメントゲート	37,500	10,780.00	404,250,000	貸付有価証券

ウェイ				600株
ザッパラス	6,000	367.00	2,202,000	貸付有価証券 900株(400株)
システムリサーチ	5,100	2,075.00	10,582,500	
インターネットイニシア ティブ	91,500	2,479.00	226,828,500	
さくらインターネット	18,400	499.00	9,181,600	
ヴィンクス	4,900	1,555.00	7,619,500	
GMOグローバルサイ ン・ホールディングス	5,000	3,800.00	19,000,000	貸付有価証券 800株(100株)
SRAホールディングス	8,400	2,985.00	25,074,000	
システムインテグレータ	4,900	433.00	2,121,700	
朝日ネット	17,600	560.00	9,856,000	
eBASE	23,100	540.00	12,474,000	
アバントグループ	20,700	1,341.00	27,758,700	
アドソル日進	6,900	1,309.00	9,032,100	貸付有価証券 100株(100株)
ODKソリューションズ	3,600	600.00	2,160,000	
フリービット	10,000	992.00	9,920,000	
コムチュア	21,700	2,405.00	52,188,500	
サイバーコム	2,600	1,422.00	3,697,200	
アステリア	12,800	712.00	9,113,600	貸付有価証券 6,000株(4,600株)
アイル	9,200	1,767.00	16,256,400	
マークライズ	8,900	2,514.00	22,374,600	
メディカル・データ・ビ ジョン	24,500	893.00	21,878,500	貸付有価証券 700株
gumi	26,800	888.00	23,798,400	貸付有価証券 12,500株(7,500株)
ショーケース	3,800	302.00	1,147,600	
モバイルファクトリー	3,400	838.00	2,849,200	貸付有価証券 400株(100株)
テラスカイ	7,000	2,421.00	16,947,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
デジタル・インフォメー ション・テクノロジ	8,500	1,760.00	14,960,000	
PCIホールディングス	6,800	950.00	6,460,000	
アイピーシー	2,500	398.00	995,000	貸付有価証券 100株
ネオジャパン	5,500	943.00	5,186,500	貸付有価証券

				2,500株
P R T I M E S	4,100	2,276.00	9,331,600	
ラクス	77,600	1,479.00	114,770,400	貸付有価証券 1,300株
ランドコンピュータ	4,000	888.00	3,552,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
ダブルスタンダード	6,600	2,108.00	13,912,800	貸付有価証券 3,100株(1,600株)
オープンドア	11,500	1,705.00	19,607,500	貸付有価証券 4,400株
マイネット	5,300	365.00	1,934,500	
アカツキ	7,800	2,126.00	16,582,800	
ベネフィットジャパン	1,000	1,215.00	1,215,000	
U b i c o mホールディングス	5,100	2,063.00	10,521,300	貸付有価証券 100株
カナミックネットワーク	23,500	569.00	13,371,500	
ノムラシステムコーポレーション	15,300	119.00	1,820,700	貸付有価証券 1,900株(100株)
チェンジ	40,200	2,171.00	87,274,200	貸付有価証券 7,100株
シンクロ・フード	10,400	420.00	4,368,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
オークネット	8,600	1,828.00	15,720,800	貸付有価証券 3,900株
キャピタル・アセット・プランニング	3,100	570.00	1,767,000	貸付有価証券 400株
セグエグループ	4,500	828.00	3,726,000	
エイトレッド	2,500	1,365.00	3,412,500	貸付有価証券 1,300株
マクロミル	37,100	1,071.00	39,734,100	
ビーグリー	2,700	1,149.00	3,102,300	貸付有価証券 900株
オロ	4,900	1,922.00	9,417,800	貸付有価証券 200株
ユーザーローカル	5,900	1,270.00	7,493,000	
テモナ	3,100	262.00	812,200	貸付有価証券 1,400株(800株)
ニーズウェル	5,000	810.00	4,050,000	
マネーフォワード	39,500	4,055.00	160,172,500	貸付有価証券 8,600株
サインポスト	6,300	603.00	3,798,900	貸付有価証券

				400株(400株)
電算システムホールディングス	7,900	2,117.00	16,724,300	
ソルクシーズ	13,300	361.00	4,801,300	
フェイス	4,600	499.00	2,295,400	
プロトコーポレーション	20,500	1,240.00	25,420,000	
ハイマックス	5,100	1,422.00	7,252,200	
野村総合研究所	336,500	3,145.00	1,058,292,500	貸付有価証券 7,500株
サイバネットシステム	13,700	948.00	12,987,600	貸付有価証券 1,000株
C Eホールディングス	8,400	519.00	4,359,600	貸付有価証券 600株(500株)
日本システム技術	6,800	1,597.00	10,859,600	貸付有価証券 100株(100株)
インテージホールディングス	22,300	1,354.00	30,194,200	貸付有価証券 10,400株(1,300株)
東邦システムサイエンス	4,600	998.00	4,590,800	貸付有価証券 2,100株(100株)
ソースネクスト	83,400	283.00	23,602,200	貸付有価証券 15,100株(10,400株)
インフォコム	21,100	2,107.00	44,457,700	
シンプレクス・ホールディングス	27,400	2,054.00	56,279,600	貸付有価証券 100株
HEROZ	5,500	871.00	4,790,500	貸付有価証券 2,500株(800株)
ラクスル	23,100	3,085.00	71,263,500	貸付有価証券 10,800株
メルカリ	73,800	2,630.00	194,094,000	貸付有価証券 18,000株
I P S	5,300	2,705.00	14,336,500	貸付有価証券 100株(100株)
F I G	19,000	404.00	7,676,000	貸付有価証券 8,900株
システムサポート	7,000	1,386.00	9,702,000	
イーソル	10,500	773.00	8,116,500	貸付有価証券 1,300株
アルテリア・ネットワークス	15,300	1,237.00	18,926,100	貸付有価証券 100株
東海ソフト	2,700	925.00	2,497,500	
ウイングアーク1st	16,900	2,002.00	33,833,800	

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,400	1,481.00	6,516,400	
サーバーワークス	3,300	2,361.00	7,791,300	
東名	1,200	1,657.00	1,988,400	
ヴィッツ	1,600	946.00	1,513,600	
トピラスシステムズ	4,100	805.00	3,300,500	貸付有価証券 400株
Sansan	61,200	1,279.00	78,274,800	貸付有価証券 7,700株
Link-U	3,100	905.00	2,805,500	貸付有価証券 500株（500株）
ギフトィ	17,600	1,809.00	31,838,400	貸付有価証券 8,200株（6,500株）
メドレー	11,300	4,015.00	45,369,500	貸付有価証券 5,300株
ベース	5,600	3,380.00	18,928,000	
JMDC	26,900	3,905.00	105,044,500	貸付有価証券 1,000株
フォーカスシステムズ	12,000	998.00	11,976,000	
クレスコ	12,700	1,718.00	21,818,600	
フジ・メディア・ホールディングス	157,600	1,068.00	168,316,800	
オービック	54,800	19,550.00	1,071,340,000	
ジャストシステム	23,600	2,763.00	65,206,800	
TDCソフト	13,800	1,514.00	20,893,200	
Zホールディングス	2,334,200	332.40	775,888,080	貸付有価証券 17,400株
トレンドマイクロ	94,700	6,280.00	594,716,000	
IDホールディングス	11,000	907.00	9,977,000	
日本オラクル	31,400	8,250.00	259,050,000	貸付有価証券 600株
アルファシステムズ	5,200	4,130.00	21,476,000	
フューチャー	40,800	1,626.00	66,340,800	
CAC Holdings	10,100	1,462.00	14,766,200	
SBテクノロジー	7,000	1,866.00	13,062,000	貸付有価証券 100株（100株）
トーセ	4,300	731.00	3,143,300	貸付有価証券 100株
オービックビジネスコン	32,300	4,190.00	135,337,000	貸付有価証券

サルタント				2,200株(2,200株)
伊藤忠テクノソリューションズ	88,100	3,100.00	273,110,000	貸付有価証券 1,700株
アイティフォー	21,600	814.00	17,582,400	
東計電算	2,300	5,370.00	12,351,000	
エックスネット	2,300	1,000.00	2,300,000	
大塚商会	93,000	4,195.00	390,135,000	
サイボウズ	22,600	2,322.00	52,477,200	貸付有価証券 2,700株(1,700株)
電通国際情報サービス	19,900	3,970.00	79,003,000	
A C C E S S	19,400	820.00	15,908,000	
デジタルガレージ	29,100	4,545.00	132,259,500	貸付有価証券 500株
E Mシステムズ	27,300	791.00	21,594,300	
ウェザーニューズ	5,800	6,860.00	39,788,000	
C I J	15,000	877.00	13,155,000	貸付有価証券 300株
ビジネスエンジニアリング	3,500	2,321.00	8,123,500	貸付有価証券 1,600株(300株)
日本エンタープライズ	17,000	128.00	2,176,000	貸付有価証券 100株
WOWOW	9,300	1,210.00	11,253,000	貸付有価証券 3,200株
スカラ	16,200	727.00	11,777,400	
インテリジェント ウェイブ	8,700	700.00	6,090,000	貸付有価証券 100株
WOW WORLD GROUP	2,900	1,081.00	3,134,900	貸付有価証券 400株
I M A G I C A G R O U P	13,700	652.00	8,932,400	
ネットワンシステムズ	61,100	3,375.00	206,212,500	
システムソフト	57,100	90.00	5,139,000	貸付有価証券 1,500株
アルゴグラフィックス	15,000	3,765.00	56,475,000	
マーベラス	26,600	669.00	17,795,400	
エイベックス	27,900	1,623.00	45,281,700	
B I P R O G Y	60,400	3,335.00	201,434,000	貸付有価証券 2,600株
兼松エレクトロニクス	10,500	4,400.00	46,200,000	
都築電気	8,600	1,268.00	10,904,800	

TBSホールディングス	84,000	1,514.00	127,176,000	
日本テレビホールディングス	145,200	1,035.00	150,282,000	
朝日放送グループホールディングス	15,400	626.00	9,640,400	貸付有価証券 1,200株
テレビ朝日ホールディングス	39,800	1,326.00	52,774,800	
スカパーJ S A Tホールディングス	145,500	484.00	70,422,000	
テレビ東京ホールディングス	11,800	1,796.00	21,192,800	
日本BS放送	5,900	875.00	5,162,500	貸付有価証券 1,200株
ビジョン	21,600	1,284.00	27,734,400	貸付有価証券 5,600株
スマートバリュー	4,000	417.00	1,668,000	
USEN-NEXT HOLDINGS	14,700	2,050.00	30,135,000	貸付有価証券 5,100株（400株）
ワイヤレスゲート	7,100	234.00	1,661,400	
コネクシオ	10,900	1,901.00	20,720,900	貸付有価証券 500株
日本通信	151,400	218.00	33,005,200	貸付有価証券 40,800株（27,800株）
クロップス	2,600	973.00	2,529,800	貸付有価証券 500株（500株）
日本電信電話	2,101,800	3,781.00	7,946,905,800	貸付有価証券 54,900株
KDDI	1,267,500	4,044.00	5,125,770,000	貸付有価証券 7,000株
ソフトバンク	2,635,000	1,499.00	3,949,865,000	貸付有価証券 47,500株
光通信	19,300	17,780.00	343,154,000	
エムティーアイ	15,000	507.00	7,605,000	貸付有価証券 4,700株
GMOインターネットグループ	60,900	2,417.00	147,195,300	貸付有価証券 500株
ファイバーゲート	8,800	843.00	7,418,400	
アイドマーケティングコミュニケーション	3,700	271.00	1,002,700	
KADOKAWA	86,700	2,397.00	207,819,900	貸付有価証券 1,600株
学研ホールディングス	27,300	909.00	24,815,700	貸付有価証券

				100株
ゼンリン	28,000	809.00	22,652,000	貸付有価証券 200株
昭文社ホールディングス	7,000	282.00	1,974,000	貸付有価証券 3,100株(500株)
インプレスホールディングス	14,400	208.00	2,995,200	貸付有価証券 100株
アイネット	9,900	1,280.00	12,672,000	
松竹	9,400	11,740.00	110,356,000	貸付有価証券 100株
東宝	102,700	5,060.00	519,662,000	
東映	4,500	17,590.00	79,155,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	514,700	1,942.00	999,547,400	貸付有価証券 12,400株(1,800株)
ピー・シー・エー	9,900	1,275.00	12,622,500	
ビジネスブレイン太田昭和	7,000	1,780.00	12,460,000	
D T S	34,900	3,115.00	108,713,500	貸付有価証券 200株
スクウェア・エニックス・ホールディングス	82,400	6,050.00	498,520,000	
シーイーシー	23,000	1,519.00	34,937,000	
カブコン	163,000	4,225.00	688,675,000	
アイ・エス・ピー	8,400	1,140.00	9,576,000	
ジャステック	10,100	1,158.00	11,695,800	
S C S K	133,900	2,022.00	270,745,800	
N S W	6,400	1,989.00	12,729,600	
アイネス	11,500	1,376.00	15,824,000	貸付有価証券 100株
T K C	29,400	3,515.00	103,341,000	貸付有価証券 100株
富士ソフト	18,500	7,590.00	140,415,000	
N S D	58,500	2,357.00	137,884,500	
コナミグループ	70,200	6,010.00	421,902,000	
福井コンピュータホールディングス	11,400	2,610.00	29,754,000	
J B C Cホールディングス	12,000	1,842.00	22,104,000	
ミロク情報サービス	14,900	1,407.00	20,964,300	貸付有価証券 200株

ソフトバンクグループ	948,400	5,778.00	5,479,855,200	貸付有価証券 6,600株
高千穂交易	6,200	2,149.00	13,323,800	貸付有価証券 2,900株
オルパヘルスケアホールディングス	2,800	1,537.00	4,303,600	
伊藤忠食品	3,900	4,920.00	19,188,000	
エレマテック	15,500	1,504.00	23,312,000	
あらた	13,200	3,965.00	52,338,000	
トーメンデバイス	2,500	5,360.00	13,400,000	貸付有価証券 100株
東京エレクトロン デバイス	6,400	6,520.00	41,728,000	
円谷フィールズホールディングス	14,900	2,613.00	38,933,700	貸付有価証券 4,800株（1,500株）
双日	183,700	2,533.00	465,312,100	
アルフレッサ ホールディングス	173,700	1,677.00	291,294,900	
横浜冷凍	47,100	1,058.00	49,831,800	
神栄	2,300	776.00	1,784,800	貸付有価証券 1,200株
ラサ商事	7,900	1,098.00	8,674,200	
アルコニックス	22,800	1,312.00	29,913,600	
神戸物産	133,900	3,810.00	510,159,000	貸付有価証券 21,300株
ハイパー	3,200	521.00	1,667,200	貸付有価証券 1,500株（100株）
あい ホールディングス	27,700	2,108.00	58,391,600	貸付有価証券 700株
ディービーエックス	4,700	1,021.00	4,798,700	貸付有価証券 200株
ダイワボウホールディングス	70,700	1,921.00	135,814,700	
マクニカホールディングス	42,400	3,180.00	134,832,000	
ラクト・ジャパン	6,700	2,134.00	14,297,800	
グリムス	7,200	2,010.00	14,472,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,300	852.00	21,555,600	
八洲電機	14,000	1,088.00	15,232,000	貸付有価証券 5,100株

メディアスホールディングス	11,100	683.00	7,581,300	貸付有価証券 200株
レスターホールディングス	16,600	2,055.00	34,113,000	
ジュテックホールディングス	4,000	1,122.00	4,488,000	貸付有価証券 1,600株
大光	7,400	668.00	4,943,200	貸付有価証券 3,500株(400株)
OCHIホールディングス	3,900	1,206.00	4,703,400	貸付有価証券 100株(100株)
TOKAIホールディングス	85,400	855.00	73,017,000	貸付有価証券 200株
黒谷	4,700	558.00	2,622,600	貸付有価証券 1,900株(800株)
Cominix	3,400	725.00	2,465,000	
三洋貿易	17,700	1,080.00	19,116,000	
ビューティガレージ	3,100	3,270.00	10,137,000	
ウイン・パートナーズ	12,600	989.00	12,461,400	
ミタチ産業	4,400	1,117.00	4,914,800	
シップヘルスケアホールディングス	62,200	2,715.00	168,873,000	貸付有価証券 6,700株
明治電機工業	6,400	1,037.00	6,636,800	
デリカフーズホールディングス	6,800	465.00	3,162,000	貸付有価証券 3,100株(300株)
スターティアホールディングス	3,400	956.00	3,250,400	
コメダホールディングス	42,400	2,475.00	104,940,000	
ピーバンドットコム	2,400	500.00	1,200,000	
アセンテック	5,800	415.00	2,407,000	貸付有価証券 100株
富士興産	3,900	1,159.00	4,520,100	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
協栄産業	1,600	1,645.00	2,632,000	
フルサト・マルカホールディングス	17,200	3,405.00	58,566,000	貸付有価証券 300株(100株)
ヤマエグループホールディングス	9,800	1,426.00	13,974,800	
小野建	15,900	1,444.00	22,959,600	
南陽	3,300	1,899.00	6,266,700	貸付有価証券 100株
佐鳥電機	10,900	1,270.00	13,843,000	貸付有価証券

				100株
エコトレーディング	3,300	626.00	2,065,800	
伯東	9,900	4,100.00	40,590,000	貸付有価証券 100株
コンドーテック	13,300	980.00	13,034,000	
中山福	9,200	320.00	2,944,000	貸付有価証券 2,700株（1,100株）
ナガイレーベン	21,900	2,067.00	45,267,300	
三菱食品	16,000	3,135.00	50,160,000	
松田産業	13,200	2,256.00	29,779,200	
第一興商	33,500	3,965.00	132,827,500	
メディバルホールディング グス	179,500	1,741.00	312,509,500	貸付有価証券 300株
S P K	7,700	1,376.00	10,595,200	
萩原電気ホールディング グス	6,600	2,409.00	15,899,400	
アズワン	25,300	5,550.00	140,415,000	
スズデン	6,000	2,264.00	13,584,000	
尾家産業	4,100	896.00	3,673,600	貸付有価証券 700株（400株）
シモジマ	11,900	905.00	10,769,500	貸付有価証券 100株
ドウシシャ	18,300	1,588.00	29,060,400	貸付有価証券 300株
小津産業	3,800	1,483.00	5,635,400	貸付有価証券 1,600株（1,200株）
高速	9,000	1,697.00	15,273,000	
たけびし	6,600	1,538.00	10,150,800	貸付有価証券 100株（100株）
リックス	3,600	2,197.00	7,909,200	貸付有価証券 200株（200株）
丸文	15,400	933.00	14,368,200	
ハビネット	14,700	1,917.00	28,179,900	
橋本総業ホールディング グス	6,800	1,006.00	6,840,800	
日本ライフライン	50,700	906.00	45,934,200	
タカショー	15,100	686.00	10,358,600	貸付有価証券 5,800株（1,100株）
I D O M	52,300	660.00	34,518,000	貸付有価証券 200株

進和	11,500	1,967.00	22,620,500	
エスケイジャパン	4,200	551.00	2,314,200	
ダイترون	6,800	2,340.00	15,912,000	
シークス	24,700	1,291.00	31,887,700	貸付有価証券 6,600株
田中商事	4,900	547.00	2,680,300	
オーハシテクニカ	8,700	1,378.00	11,988,600	
白銅	6,200	2,392.00	14,830,400	
ダイコー通産	2,100	1,044.00	2,192,400	
伊藤忠商事	1,066,200	4,187.00	4,464,179,400	貸付有価証券 14,300株
丸紅	1,366,100	1,538.50	2,101,744,850	
高島	2,700	2,860.00	7,722,000	
長瀬産業	81,300	2,020.00	164,226,000	
蝶理	9,300	2,197.00	20,432,100	
豊田通商	151,600	4,905.00	743,598,000	
三共生興	24,800	462.00	11,457,600	
兼松	67,200	1,505.00	101,136,000	
ツカモトコーポレーショ ン	2,500	1,308.00	3,270,000	貸付有価証券 100株（100株）
三井物産	1,266,100	3,920.00	4,963,112,000	貸付有価証券 33,500株
日本紙パルプ商事	9,200	4,950.00	45,540,000	
カメイ	18,400	1,197.00	22,024,800	
東都水産	900	5,250.00	4,725,000	貸付有価証券 400株
OUGホールディングス	2,500	2,371.00	5,927,500	
スターゼン	13,100	2,059.00	26,972,900	
山善	46,600	1,000.00	46,600,000	
椿本興業	2,800	3,830.00	10,724,000	
住友商事	1,071,600	2,225.50	2,384,845,800	
内田洋行	7,600	4,465.00	33,934,000	
三菱商事	1,081,900	4,314.00	4,667,316,600	貸付有価証券 13,900株
第一実業	6,100	4,310.00	26,291,000	
キャノンマーケティング ジャパン	40,100	3,040.00	121,904,000	
西華産業	6,800	1,552.00	10,553,600	

佐藤商事	12,000	1,208.00	14,496,000	
菱洋エレクトロ	14,800	2,295.00	33,966,000	貸付有価証券 5,100株
東京産業	15,800	750.00	11,850,000	
ユアサ商事	15,600	3,610.00	56,316,000	貸付有価証券 700株
神鋼商事	4,300	4,760.00	20,468,000	
トルク	9,200	200.00	1,840,000	貸付有価証券 400株
阪和興業	31,100	3,630.00	112,893,000	
正栄食品工業	11,500	3,820.00	43,930,000	貸付有価証券 5,400株（100株）
カナデン	14,000	1,078.00	15,092,000	
菱電商事	14,000	1,663.00	23,282,000	
岩谷産業	39,400	5,740.00	226,156,000	
ナイス	4,700	1,368.00	6,429,600	
ニチモウ	1,900	2,724.00	5,175,600	
極東貿易	10,300	1,347.00	13,874,100	貸付有価証券 400株（200株）
アステナホールディングス	29,900	425.00	12,707,500	貸付有価証券 100株
三愛オブリ	47,800	1,252.00	59,845,600	貸付有価証券 100株
稲畑産業	34,900	2,357.00	82,259,300	貸付有価証券 500株
G S Iクレオス	10,000	1,419.00	14,190,000	貸付有価証券 300株（300株）
明和産業	23,000	643.00	14,789,000	貸付有価証券 9,800株（300株）
クワザワホールディングス	5,500	402.00	2,211,000	貸付有価証券 1,100株（300株）
ワキタ	31,800	1,196.00	38,032,800	
東邦ホールディングス	43,100	2,171.00	93,570,100	
サンゲツ	43,400	2,120.00	92,008,000	
ミツウロコグループホールディングス	22,300	1,140.00	25,422,000	
シナネンホールディングス	5,600	3,730.00	20,888,000	
伊藤忠エネクス	42,900	1,033.00	44,315,700	
サンリオ	49,000	4,600.00	225,400,000	貸付有価証券

				900株
サンワテクノス	8,800	1,546.00	13,604,800	
リョーサン	18,300	2,804.00	51,313,200	貸付有価証券 200株
新光商事	23,200	1,180.00	27,376,000	
トーホー	7,400	1,735.00	12,839,000	貸付有価証券 3,400株（500株）
三信電気	7,000	2,343.00	16,401,000	貸付有価証券 100株
東陽テクニカ	19,100	1,352.00	25,823,200	
モスフードサービス	25,400	3,105.00	78,867,000	
加賀電子	14,000	4,025.00	56,350,000	
ソーダニッカ	12,600	700.00	8,820,000	貸付有価証券 500株
立花エレテック	12,600	1,758.00	22,150,800	貸付有価証券 100株
フォーバル	6,800	970.00	6,596,000	
PALTAC	27,200	4,460.00	121,312,000	
三谷産業	30,200	306.00	9,241,200	
太平洋興発	6,000	763.00	4,578,000	
西本Wismettac ホールディングス	4,400	3,470.00	15,268,000	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	1,533.00	2,299,500	
コア商事ホールディン グス	12,100	590.00	7,139,000	貸付有価証券 400株（400株）
KPPグループホール ディングス	40,300	754.00	30,386,200	貸付有価証券 3,200株
ヤマタネ	7,600	1,654.00	12,570,400	
丸紅建材リース	1,500	1,713.00	2,569,500	
日鉄物産	11,900	9,240.00	109,956,000	貸付有価証券 700株
泉州電業	8,700	3,260.00	28,362,000	貸付有価証券 2,400株
トラスコ中山	36,300	2,078.00	75,431,400	
オートバックスセブン	60,200	1,435.00	86,387,000	
モリト	12,400	740.00	9,176,000	貸付有価証券 100株
加藤産業	21,000	3,460.00	72,660,000	
北恵	3,900	611.00	2,382,900	貸付有価証券

				1,800株
イエローハット	30,500	1,771.00	54,015,500	
J Kホールディングス	13,600	1,003.00	13,640,800	
日伝	10,200	1,709.00	17,431,800	
北沢産業	9,200	190.00	1,748,000	
杉本商事	7,700	1,924.00	14,814,800	
因幡電機産業	44,900	2,719.00	122,083,100	
東テク	5,800	3,200.00	18,560,000	
ミスミグループ本社	261,000	2,906.00	758,466,000	貸付有価証券 2,800株
アルテック	9,600	304.00	2,918,400	
タキヒヨー	4,200	805.00	3,381,000	貸付有価証券 1,900株（200株）
蔵王産業	2,800	1,690.00	4,732,000	
スズケン	53,800	3,490.00	187,762,000	
ジェコス	11,100	820.00	9,102,000	
グローセル	18,900	419.00	7,919,100	貸付有価証券 1,600株
ローソン	42,900	5,060.00	217,074,000	
サンエー	13,200	4,295.00	56,694,000	
カワチ薬品	13,500	2,204.00	29,754,000	
エービーシー・マート	25,200	7,310.00	184,212,000	貸付有価証券 400株
ハードオフコーポレーション	6,900	1,335.00	9,211,500	
アスクル	41,700	1,698.00	70,806,600	貸付有価証券 9,000株
ゲオホールディングス	18,200	2,170.00	39,494,000	貸付有価証券 5,200株（500株）
アダストリア	20,900	1,982.00	41,423,800	貸付有価証券 100株
ジーフット	8,800	290.00	2,552,000	貸付有価証券 4,700株（300株）
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,200	400.00	880,000	
くら寿司	20,300	3,040.00	61,712,000	貸付有価証券 1,700株（1,400株）
キャンドウ	6,200	2,236.00	13,863,200	貸付有価証券 2,900株（1,400株）
I Kホールディングス	5,500	400.00	2,200,000	貸付有価証券

				300株（300株）
パルグループホールディングス	17,000	2,400.00	40,800,000	
エディオン	68,500	1,283.00	87,885,500	貸付有価証券 29,500株（20,000株）
サーラコーポレーション	36,400	724.00	26,353,600	貸付有価証券 400株（300株）
ワッツ	8,400	712.00	5,980,800	貸付有価証券 3,900株
ハローズ	7,900	2,921.00	23,075,900	
フジオフードグループ本社	14,400	1,391.00	20,030,400	貸付有価証券 6,700株
あみやき亭	4,200	2,883.00	12,108,600	
ひらまつ	37,000	180.00	6,660,000	貸付有価証券 100株
大黒天物産	6,200	5,220.00	32,364,000	貸付有価証券 2,900株（900株）
ハニーズホールディングス	15,400	1,315.00	20,251,000	
ファーマライズホールディングス	3,700	652.00	2,412,400	貸付有価証券 1,700株
アルペン	14,300	1,990.00	28,457,000	貸付有価証券 6,700株（100株）
ハブ	5,600	594.00	3,326,400	貸付有価証券 2,600株
クオールホールディングス	23,800	1,148.00	27,322,400	貸付有価証券 1,000株
ジンズホールディングス	10,300	4,540.00	46,762,000	
ビックカメラ	115,100	1,248.00	143,644,800	貸付有価証券 6,100株（500株）
DCMホールディングス	105,600	1,193.00	125,980,800	貸付有価証券 200株
MonotaRO	245,300	1,852.00	454,295,600	
東京一番フーズ	4,000	482.00	1,928,000	
DDホールディングス	11,200	646.00	7,235,200	貸付有価証券 1,800株（100株）
きちりホールディングス	4,600	595.00	2,737,000	貸付有価証券 2,200株
アークランドサービスホールディングス	14,200	2,160.00	30,672,000	貸付有価証券 6,600株
J.フロント リテイリ	215,100	1,172.00	252,097,200	貸付有価証券

ング				1,500株(1,500株)
ドトール・日レスホールディングス	30,700	1,713.00	52,589,100	
マツキヨココカラ&カンパニー	104,900	6,360.00	667,164,000	
ブロンコピリー	9,200	2,461.00	22,641,200	貸付有価証券 4,300株
Z O Z O	114,400	3,240.00	370,656,000	
トレジャー・ファクトリー	5,200	2,527.00	13,140,400	
物語コーポレーション	9,600	6,310.00	60,576,000	貸付有価証券 4,500株
三越伊勢丹ホールディングス	291,200	1,384.00	403,020,800	貸付有価証券 8,600株
H a m e e	7,000	693.00	4,851,000	貸付有価証券 3,100株
マーケットエンタープライズ	1,800	916.00	1,648,800	貸付有価証券 500株(400株)
ウエルシアホールディングス	89,800	3,195.00	286,911,000	
クリエイトSDホールディングス	28,600	3,345.00	95,667,000	
丸善CHIホールディングス	20,400	326.00	6,650,400	貸付有価証券 9,500株
ミサワ	3,100	617.00	1,912,700	貸付有価証券 1,500株
ティーライフ	2,300	1,268.00	2,916,400	貸付有価証券 1,000株
エー・ピーホールディングス	3,600	449.00	1,616,400	
チムニー	5,300	1,107.00	5,867,100	貸付有価証券 2,100株
シュッピン	12,900	1,235.00	15,931,500	貸付有価証券 2,800株(2,200株)
オイシックス・ラ・大地	23,300	2,095.00	48,813,500	貸付有価証券 10,800株(3,500株)
ネクステージ	39,500	2,459.00	97,130,500	貸付有価証券 1,200株
ジョイフル本田	55,700	1,938.00	107,946,600	貸付有価証券 15,000株(100株)
鳥貴族ホールディングス	6,400	2,025.00	12,960,000	貸付有価証券 3,000株(900株)

ホットランド	13,200	1,443.00	19,047,600	貸付有価証券 6,200株(900株)
すかいらくホールディングス	236,500	1,566.00	370,359,000	貸付有価証券 111,100株
SFPホールディングス	9,500	1,769.00	16,805,500	貸付有価証券 4,400株(600株)
綿半ホールディングス	13,400	1,323.00	17,728,200	
ヨシックスホールディングス	3,400	2,101.00	7,143,400	貸付有価証券 1,500株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	56,400	1,136.00	64,070,400	貸付有価証券 8,900株(900株)
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,800	1,543.00	12,035,400	貸付有価証券 3,600株(1,300株)
B E E N O S	9,800	2,033.00	19,923,400	貸付有価証券 200株
あさひ	14,400	1,316.00	18,950,400	貸付有価証券 6,700株
日本調剤	11,800	1,185.00	13,983,000	貸付有価証券 4,600株(2,900株)
コスモス薬品	19,600	13,990.00	274,204,000	貸付有価証券 2,600株
トーエル	7,600	726.00	5,517,600	貸付有価証券 3,500株(200株)
セブン&アイ・ホールディングス	596,400	5,629.00	3,357,135,600	貸付有価証券 11,700株
クリエイト・レストランツ・ホールディング	130,200	906.00	117,961,200	貸付有価証券 9,000株
ツルハホールディングス	42,400	9,930.00	421,032,000	貸付有価証券 9,700株
サンマルクホールディングス	13,900	1,680.00	23,352,000	
フェリシモ	3,900	1,003.00	3,911,700	貸付有価証券 500株(400株)
トリドールホールディングス	43,000	2,705.00	116,315,000	貸付有価証券 20,300株
T O K Y O B A S E	17,800	238.00	4,236,400	貸付有価証券 8,300株(1,000株)
ウイルプラスホールディングス	3,300	1,070.00	3,531,000	貸付有価証券 200株(200株)
J Mホールディングス	14,700	1,696.00	24,931,200	
サツドラホールディングス	7,800	785.00	6,123,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)

アレンザホールディングス	12,900	987.00	12,732,300	
串カツ田中ホールディングス	4,600	1,672.00	7,691,200	貸付有価証券 800株
パロックジャパンリミテッド	11,200	816.00	9,139,200	
クスリのアオキホールディングス	17,400	8,470.00	147,378,000	貸付有価証券 600株
力の源ホールディングス	9,700	855.00	8,293,500	
FOOD & LIFE COMPANIE	99,400	2,600.00	258,440,000	貸付有価証券 11,300株
メディカルシステムネットワーク	15,000	404.00	6,060,000	
一家ホールディングス	3,700	614.00	2,271,800	
ジャパクラフトホールディングス	5,400	649.00	3,504,600	貸付有価証券 2,500株
はるやまホールディングス	7,300	433.00	3,160,900	貸付有価証券 3,700株（600株）
ノジマ	56,500	1,417.00	80,060,500	
カップ・クリエイト	27,200	1,385.00	37,672,000	貸付有価証券 1,100株（200株）
ライトオン	13,000	598.00	7,774,000	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
良品計画	223,200	1,491.00	332,791,200	
パリミキホールディングス	21,600	254.00	5,486,400	貸付有価証券 1,000株
アドヴァングループ	16,500	840.00	13,860,000	貸付有価証券 100株
アルピス	5,700	2,383.00	13,583,100	
コナカ	18,900	333.00	6,293,700	貸付有価証券 700株
ハウス オブ ローゼ	2,100	1,638.00	3,439,800	貸付有価証券 700株
G - 7ホールディングス	21,600	1,568.00	33,868,800	
イオン北海道	25,600	1,126.00	28,825,600	
コジマ	33,400	593.00	19,806,200	貸付有価証券 13,700株
ヒマラヤ	5,400	917.00	4,951,800	貸付有価証券 700株（300株）
コーナン商事	23,300	3,360.00	78,288,000	
エコス	6,400	1,861.00	11,910,400	貸付有価証券

				100株(100株)
ワタミ	20,900	979.00	20,461,100	
マルシェ	5,600	385.00	2,156,000	貸付有価証券 1,800株(100株)
パン・パシフィック・インターナショナルホ	388,000	2,261.00	877,268,000	
西松屋チェーン	38,300	1,518.00	58,139,400	貸付有価証券 18,000株
ゼンショーホールディングス	94,700	3,355.00	317,718,500	貸付有価証券 6,300株(2,700株)
幸楽苑ホールディングス	11,300	1,005.00	11,356,500	貸付有価証券 200株(100株)
ハークスレイ	6,100	783.00	4,776,300	貸付有価証券 300株(300株)
サイゼリヤ	28,800	2,977.00	85,737,600	貸付有価証券 200株
VTホールディングス	65,700	491.00	32,258,700	
魚力	5,400	2,102.00	11,350,800	
ポブラ	4,500	139.00	625,500	貸付有価証券 1,800株
フジ・コーポレーション	9,800	1,344.00	13,171,200	
ユナイテッドアローズ	18,500	1,794.00	33,189,000	
ハイデイ日高	25,700	1,907.00	49,009,900	貸付有価証券 11,900株
YU-WA Creat ion Holdi	10,300	200.00	2,060,000	貸付有価証券 500株(100株)
コロワイド	79,700	1,751.00	139,554,700	貸付有価証券 37,400株(9,100株)
ピーシーデポコーポレー ション	19,300	272.00	5,249,600	
壱番屋	13,700	4,620.00	63,294,000	貸付有価証券 5,600株
トップカルチャー	5,600	192.00	1,075,200	貸付有価証券 600株
P L A N T	4,000	635.00	2,540,000	貸付有価証券 200株(200株)
スギホールディングス	34,900	6,390.00	223,011,000	貸付有価証券 1,100株
薬王堂ホールディングス	9,700	2,814.00	27,295,800	貸付有価証券 600株(600株)
スクロール	25,700	710.00	18,247,000	貸付有価証券

				300株
ヨンドシーホールディングス	14,900	1,728.00	25,747,200	
木曽路	26,200	2,097.00	54,941,400	貸付有価証券 9,000株
S R Sホールディングス	28,500	859.00	24,481,500	貸付有価証券 2,500株(900株)
千趣会	31,800	400.00	12,720,000	貸付有価証券 14,900株
タカキュー	12,100	73.00	883,300	貸付有価証券 5,600株
リテールパートナーズ	25,700	1,290.00	33,153,000	貸付有価証券 1,900株
ケーヨー	27,900	897.00	25,026,300	貸付有価証券 300株
上新電機	15,400	1,920.00	29,568,000	
日本瓦斯	92,700	2,063.00	191,240,100	
ロイヤルホールディングス	33,500	2,337.00	78,289,500	貸付有価証券 15,700株
東天紅	1,300	770.00	1,001,000	
いなげや	16,800	1,219.00	20,479,200	貸付有価証券 900株(700株)
チヨダ	16,500	755.00	12,457,500	貸付有価証券 6,700株(100株)
ライフコーポレーション	15,100	2,629.00	39,697,900	
リンガーハット	22,300	2,205.00	49,171,500	貸付有価証券 10,100株
MrMaxHD	24,200	649.00	15,705,800	
テンアライド	18,300	246.00	4,501,800	貸付有価証券 8,600株(1,600株)
AOKIホールディングス	32,200	668.00	21,509,600	貸付有価証券 600株
オークワ	27,700	923.00	25,567,100	
コメリ	26,600	2,694.00	71,660,400	貸付有価証券 200株
青山商事	37,000	888.00	32,856,000	貸付有価証券 400株
しまむら	20,300	12,950.00	262,885,000	
はせがわ	8,200	328.00	2,689,600	
高島屋	130,500	1,708.00	222,894,000	貸付有価証券 1,800株

松屋	29,300	1,023.00	29,973,900	
エイチ・ツー・オー リ テイリング	84,200	1,217.00	102,471,400	貸付有価証券 2,800株
近鉄百貨店	5,600	2,559.00	14,330,400	
丸井グループ	127,600	2,168.00	276,636,800	
アクシアル リテイリン グ	11,800	3,350.00	39,530,000	
井筒屋	8,200	400.00	3,280,000	貸付有価証券 2,800株(2,700株)
イオン	586,600	2,808.50	1,647,466,100	貸付有価証券 300株
イズミ	26,300	2,902.00	76,322,600	
平和堂	28,900	2,113.00	61,065,700	貸付有価証券 100株
フジ	26,600	1,825.00	48,545,000	貸付有価証券 1,200株(400株)
ヤオコー	19,600	6,920.00	135,632,000	貸付有価証券 3,500株
ゼビオホールディングス	23,400	905.00	21,177,000	
ケーズホールディングス	137,600	1,124.00	154,662,400	貸付有価証券 500株
O l y m p i c グループ	6,400	500.00	3,200,000	
日産東京販売ホールディ ングス	22,000	286.00	6,292,000	
シルバーライフ	4,000	1,992.00	7,968,000	貸付有価証券 1,800株
Genky D r u g S t o r e s	8,500	3,480.00	29,580,000	貸付有価証券 1,000株(900株)
ナルミヤ・インターナ ショナル	2,800	859.00	2,405,200	貸付有価証券 300株
ブックオフグループホー ルディングス	10,200	1,356.00	13,831,200	貸付有価証券 800株(800株)
ギフトホールディングス	3,700	4,130.00	15,281,000	貸付有価証券 400株
アインホールディングス	23,800	6,050.00	143,990,000	貸付有価証券 500株(500株)
元気寿司	5,400	3,040.00	16,416,000	
ヤマダホールディングス	709,500	470.00	333,465,000	貸付有価証券 15,600株
アーケランズ	25,300	1,530.00	38,709,000	
ニトリホールディングス	70,000	16,645.00	1,165,150,000	

グルメ杵屋	14,000	988.00	13,832,000	貸付有価証券 4,800株
愛眼	12,800	166.00	2,124,800	貸付有価証券 100株
ケーユーホールディングス	10,100	1,314.00	13,271,400	
吉野家ホールディングス	67,700	2,304.00	155,980,800	貸付有価証券 4,700株
松屋フーズホールディングス	8,200	3,980.00	32,636,000	貸付有価証券 100株（100株）
サガミホールディングス	27,800	1,196.00	33,248,800	貸付有価証券 10,400株
関西フードマーケット	15,600	1,244.00	19,406,400	貸付有価証券 200株
王将フードサービス	11,400	6,020.00	68,628,000	
プレナス	19,000	2,635.00	50,065,000	貸付有価証券 300株
ミニストップ	12,600	1,423.00	17,929,800	貸付有価証券 2,900株
アークス	31,700	2,167.00	68,693,900	
パローホールディングス	33,000	1,799.00	59,367,000	貸付有価証券 100株
ベルク	8,600	5,700.00	49,020,000	
大庄	9,300	1,029.00	9,569,700	貸付有価証券 4,300株
ファーストリテイリング	25,900	80,670.00	2,089,353,000	貸付有価証券 100株
サンドラッグ	65,700	3,930.00	258,201,000	
サックスパーホールディングス	16,400	757.00	12,414,800	貸付有価証券 700株（700株）
ヤマザワ	3,200	1,270.00	4,064,000	貸付有価証券 1,500株（700株）
やまや	3,600	2,482.00	8,935,200	貸付有価証券 900株
ベルーナ	41,600	668.00	27,788,800	貸付有価証券 2,500株
いよぎんホールディングス	191,700	702.00	134,573,400	貸付有価証券 2,200株
しずおかフィナンシャルグループ	364,000	1,031.00	375,284,000	貸付有価証券 12,500株
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	135,600	954.00	129,362,400	

島根銀行	5,600	473.00	2,648,800	貸付有価証券 100株
じもとホールディングス	10,700	414.00	4,429,800	
めぶきフィナンシャルグループ	799,300	329.00	262,969,700	貸付有価証券 23,900株
東京きらぼしフィナンシャルグループ	20,600	2,529.00	52,097,400	
九州フィナンシャルグループ	283,400	440.00	124,696,000	
ゆうちょ銀行	458,600	1,119.00	513,173,400	貸付有価証券 189,300株
富山第一銀行	40,100	590.00	23,659,000	貸付有価証券 16,200株（800株）
コンコルディア・フィナンシャルグループ	887,700	551.00	489,122,700	貸付有価証券 6,600株
西日本フィナンシャルホールディングス	102,000	948.00	96,696,000	
三十三フィナンシャルグループ	14,400	1,541.00	22,190,400	
第四北越フィナンシャルグループ	25,300	2,792.00	70,637,600	貸付有価証券 200株
ひろぎんホールディングス	210,100	652.00	136,985,200	
おきなわフィナンシャルグループ	15,300	2,270.00	34,731,000	
十六フィナンシャルグループ	20,900	2,804.00	58,603,600	
北國フィナンシャルホールディングス	13,600	4,645.00	63,172,000	
プロクレアホールディングス	19,700	2,159.00	42,532,300	
あいちフィナンシャルグループ	22,500	2,294.00	51,615,000	貸付有価証券 600株
新生銀行	47,500	2,183.00	103,692,500	貸付有価証券 8,100株
あおぞら銀行	101,300	2,637.00	267,128,100	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,560,100	881.10	9,304,504,110	貸付有価証券 113,600株
りそなホールディングス	2,055,800	719.00	1,478,120,200	貸付有価証券 91,100株
三井住友トラスト・ホールディングス	298,400	4,600.00	1,372,640,000	

三井住友フィナンシャルグループ	1,177,000	5,232.00	6,158,064,000	貸付有価証券 76,500株
千葉銀行	448,900	961.00	431,392,900	貸付有価証券 8,100株
群馬銀行	312,600	496.00	155,049,600	
武蔵野銀行	20,700	2,049.00	42,414,300	
千葉興業銀行	37,700	429.00	16,173,300	貸付有価証券 4,000株
筑波銀行	70,700	226.00	15,978,200	
七十七銀行	51,600	2,120.00	109,392,000	貸付有価証券 400株
秋田銀行	10,800	1,882.00	20,325,600	
山形銀行	17,900	1,212.00	21,694,800	
岩手銀行	11,000	1,972.00	21,692,000	
東邦銀行	127,400	217.00	27,645,800	貸付有価証券 1,000株
東北銀行	7,900	1,017.00	8,034,300	貸付有価証券 600株
ふくおかフィナンシャルグループ	128,600	3,035.00	390,301,000	貸付有価証券 2,000株
スルガ銀行	142,000	426.00	60,492,000	貸付有価証券 200株
八十二銀行	330,400	540.00	178,416,000	
山梨中央銀行	16,500	1,099.00	18,133,500	
大垣共立銀行	30,700	1,829.00	56,150,300	
福井銀行	14,400	1,475.00	21,240,000	
清水銀行	6,400	1,540.00	9,856,000	
富山銀行	2,500	1,756.00	4,390,000	貸付有価証券 500株
滋賀銀行	26,800	2,659.00	71,261,200	
南都銀行	24,200	2,463.00	59,604,600	
百五銀行	151,500	362.00	54,843,000	貸付有価証券 100株
京都銀行	51,000	5,800.00	295,800,000	貸付有価証券 600株
紀陽銀行	57,600	1,535.00	88,416,000	貸付有価証券 200株
ほくほくフィナンシャルグループ	102,400	951.00	97,382,400	貸付有価証券 300株
山陰合同銀行	100,800	765.00	77,112,000	貸付有価証券

				800株
鳥取銀行	5,200	1,131.00	5,881,200	
百十四銀行	14,700	1,846.00	27,136,200	
四国銀行	25,600	939.00	24,038,400	
阿波銀行	23,800	2,069.00	49,242,200	貸付有価証券 2,300株
大分銀行	9,700	2,010.00	19,497,000	
宮崎銀行	10,500	2,399.00	25,189,500	
佐賀銀行	9,400	1,721.00	16,177,400	
琉球銀行	36,900	849.00	31,328,100	
セブン銀行	577,000	263.00	151,751,000	貸付有価証券 14,300株
みずほフィナンシャルグループ	2,329,500	1,846.50	4,301,421,750	
高知銀行	5,500	693.00	3,811,500	
山口フィナンシャルグループ	177,800	839.00	149,174,200	貸付有価証券 200株
長野銀行	5,000	1,273.00	6,365,000	
名古屋銀行	10,600	3,270.00	34,662,000	
北洋銀行	244,100	247.00	60,292,700	貸付有価証券 700株
大光銀行	4,800	1,211.00	5,812,800	
愛媛銀行	21,700	873.00	18,944,100	
トマト銀行	5,300	1,020.00	5,406,000	
京葉銀行	74,800	578.00	43,234,400	貸付有価証券 1,200株
栃木銀行	73,700	307.00	22,625,900	
北日本銀行	5,600	2,004.00	11,222,400	
東和銀行	29,600	558.00	16,516,800	
福島銀行	17,000	236.00	4,012,000	
大東銀行	6,300	668.00	4,208,400	
トモニホールディングス	130,200	360.00	46,872,000	貸付有価証券 500株
フィデアホールディングス	16,600	1,403.00	23,289,800	
池田泉州ホールディングス	206,200	247.00	50,931,400	貸付有価証券 1,600株
F P G	65,400	1,097.00	71,743,800	
ジャパンインベストメン	13,200	1,168.00	15,417,600	貸付有価証券

トアドバイザー				6,100株(700株)
マーキュリアホールディングス	9,500	574.00	5,453,000	
SBIホールディングス	233,100	2,605.00	607,225,500	貸付有価証券 10,200株
日本アジア投資	12,800	216.00	2,764,800	貸付有価証券 4,000株(600株)
ジャフコグループ	53,800	2,259.00	121,534,200	貸付有価証券 25,200株(10,100株)
大和証券グループ本社	1,151,800	588.00	677,258,400	貸付有価証券 4,900株
野村ホールディングス	2,966,400	486.00	1,441,670,400	
岡三証券グループ	141,400	375.00	53,025,000	貸付有価証券 13,400株
丸三証券	53,600	391.00	20,957,600	貸付有価証券 6,100株
東洋証券	53,400	292.00	15,592,800	貸付有価証券 1,200株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	175,300	349.00	61,179,700	貸付有価証券 10,500株
光世証券	3,700	353.00	1,306,100	貸付有価証券 200株
水戸証券	43,200	207.00	8,942,400	
いちよし証券	29,700	617.00	18,324,900	
松井証券	95,100	780.00	74,178,000	貸付有価証券 300株
マネックスグループ	179,900	398.00	71,600,200	貸付有価証券 67,200株(900株)
極東証券	20,000	575.00	11,500,000	貸付有価証券 300株
岩井コスモホールディングス	18,400	1,284.00	23,625,600	
アイザワ証券グループ	23,300	687.00	16,007,100	貸付有価証券 200株
マネーパートナーズグループ	16,700	273.00	4,559,100	
スパークス・グループ	17,900	1,647.00	29,481,300	貸付有価証券 100株
小林洋行	6,900	222.00	1,531,800	貸付有価証券 1,100株
かんぽ生命保険	195,600	2,326.00	454,965,600	
SOMPOホールディング	276,400	5,836.00	1,613,070,400	

グス				
アニコム ホールディングス	54,700	579.00	31,671,300	
MS & A Dインシュアランスグループホール	363,100	4,253.00	1,544,264,300	
第一生命ホールディングス	820,000	2,950.50	2,419,410,000	貸付有価証券 23,800株
東京海上ホールディングス	1,621,900	2,831.00	4,591,598,900	
T & Dホールディングス	432,300	1,870.00	808,401,000	貸付有価証券 15,700株
アドバンスクリエイト	9,300	1,041.00	9,681,300	貸付有価証券 3,200株
全国保証	42,100	5,120.00	215,552,000	貸付有価証券 3,500株
あんしん保証	7,900	257.00	2,030,300	
ジェイリース	5,400	2,807.00	15,157,800	貸付有価証券 300株（300株）
イントラスト	6,200	800.00	4,960,000	
日本モーゲージサービス	8,900	878.00	7,814,200	貸付有価証券 2,700株
C a s a	6,200	869.00	5,387,800	貸付有価証券 2,100株
アルヒ	19,900	1,006.00	20,019,400	貸付有価証券 9,700株（6,800株）
プレミアグループ	27,000	1,649.00	44,523,000	貸付有価証券 1,300株（1,200株）
ネットプロテクションズ ホールディングス	53,200	463.00	24,631,600	貸付有価証券 25,000株（13,900株）
クレディセゾン	102,100	1,698.00	173,365,800	貸付有価証券 200株
芙蓉総合リース	14,800	8,660.00	128,168,000	
みずほリース	24,000	3,305.00	79,320,000	
東京センチュリー	30,100	4,435.00	133,493,500	
日本証券金融	64,600	1,120.00	72,352,000	
アイフル	266,700	394.00	105,079,800	
リコーリース	15,300	3,715.00	56,839,500	
イオンフィナンシャル サービス	92,500	1,398.00	129,315,000	貸付有価証券 700株
アコム	287,400	312.00	89,668,800	貸付有価証券 3,600株

ジャックス	17,200	4,070.00	70,004,000	
オリエントコーポレーション	42,000	1,134.00	47,628,000	貸付有価証券 100株
オリックス	1,077,400	2,154.50	2,321,258,300	
三菱H C キャピタル	628,000	651.00	408,828,000	貸付有価証券 900株
九州リースサービス	7,500	669.00	5,017,500	貸付有価証券 3,500株
日本取引所グループ	452,600	1,880.50	851,114,300	
イー・ギャランティ	26,000	2,321.00	60,346,000	
アサックス	7,300	590.00	4,307,000	貸付有価証券 4,500株
N E C キャピタルソリューション	7,900	2,078.00	16,416,200	
大東建託	59,000	13,790.00	813,610,000	貸付有価証券 300株
いちご	185,500	284.00	52,682,000	貸付有価証券 44,400株
日本駐車場開発	191,800	284.00	54,471,200	貸付有価証券 1,000株
スター・マイカ・ホールディングス	14,600	670.00	9,782,000	
S R E ホールディングス	7,900	3,420.00	27,018,000	貸付有価証券 2,200株（400株）
A D ワークスグループ	40,500	147.00	5,953,500	貸付有価証券 19,000株（700株）
ヒューリック	375,700	1,058.00	397,490,600	
三栄建築設計	7,800	1,487.00	11,598,600	貸付有価証券 400株（400株）
野村不動産ホールディングス	100,600	2,853.00	287,011,800	
三重交通グループホールディングス	34,500	488.00	16,836,000	貸付有価証券 14,100株
サムティ	25,600	2,135.00	54,656,000	貸付有価証券 9,600株
ディア・ライフ	24,700	605.00	14,943,500	
コーセーアールイー	5,100	776.00	3,957,600	貸付有価証券 2,300株
地主	12,300	1,907.00	23,456,100	貸付有価証券 5,700株
プレサンスコーポレー	21,200	1,497.00	31,736,400	

ション				
ハウスコム	2,600	1,065.00	2,769,000	
J P M C	8,100	1,016.00	8,229,600	
サンセイランディック	4,700	835.00	3,924,500	貸付有価証券 700株（700株）
エストラスト	2,000	580.00	1,160,000	
フージャースホールディングス	24,800	735.00	18,228,000	
オープンハウスグループ	59,000	4,860.00	286,740,000	
東急不動産ホールディングス	484,300	631.00	305,593,300	
飯田グループホールディングス	141,100	2,020.00	285,022,000	貸付有価証券 1,200株
イーランド	2,500	1,486.00	3,715,000	
ムゲンエステート	10,700	514.00	5,499,800	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
ビーロット	11,000	553.00	6,083,000	貸付有価証券 5,100株
ファーストブラザーズ	3,200	854.00	2,732,800	貸付有価証券 1,600株
A n d D oホールディングス	9,600	773.00	7,420,800	
シーアールイー	7,300	1,189.00	8,679,700	貸付有価証券 1,500株（700株）
プロパティエージェント	2,000	1,108.00	2,216,000	
ケイアイスター不動産	7,800	4,585.00	35,763,000	貸付有価証券 1,900株
アグレ都市デザイン	2,900	1,522.00	4,413,800	
グッドコムアセット	14,900	804.00	11,979,600	貸付有価証券 600株（400株）
ジェイ・エス・ビー	4,000	3,910.00	15,640,000	
ロードスターキャピタル	6,900	1,592.00	10,984,800	貸付有価証券 3,200株
テンポイノベーション	4,900	1,001.00	4,904,900	貸付有価証券 100株
グローバル・リンク・マネジメント	3,100	1,230.00	3,813,000	貸付有価証券 1,400株
フェイスネットワーク	2,200	1,345.00	2,959,000	貸付有価証券 100株（100株）
パーク24	125,500	2,198.00	275,849,000	
パラカ	5,700	1,880.00	10,716,000	

三井不動産	700,000	2,384.00	1,668,800,000	
三菱地所	1,021,200	1,722.00	1,758,506,400	貸付有価証券 1,700株
平和不動産	26,100	3,800.00	99,180,000	
東京建物	153,500	1,636.00	251,126,000	貸付有価証券 100株
京阪神ビルディング	20,300	1,251.00	25,395,300	
住友不動産	291,200	3,121.00	908,835,200	貸付有価証券 700株
テーオーシー	29,100	672.00	19,555,200	
東京楽天地	2,800	4,055.00	11,354,000	貸付有価証券 1,300株
レオパレス21	181,300	277.00	50,220,100	貸付有価証券 73,400株
スターツコーポレーション	23,100	2,600.00	60,060,000	
フジ住宅	22,500	654.00	14,715,000	
空港施設	19,400	511.00	9,913,400	
明和地所	8,200	690.00	5,658,000	貸付有価証券 700株
ゴールドクレスト	15,300	1,670.00	25,551,000	貸付有価証券 600株
エスリード	7,600	1,846.00	14,029,600	貸付有価証券 100株（100株）
日神グループホールディングス	25,800	433.00	11,171,400	
日本エスコン	36,200	818.00	29,611,600	貸付有価証券 100株
MIRARTHホールディングス	81,400	365.00	29,711,000	
AVANTIA	8,200	788.00	6,461,600	貸付有価証券 2,500株
イオンモール	83,500	1,702.00	142,117,000	貸付有価証券 100株
毎日コムネット	5,900	679.00	4,006,100	貸付有価証券 400株（400株）
ファースト住建	6,500	992.00	6,448,000	貸付有価証券 1,700株
カチタス	43,300	3,010.00	130,333,000	貸付有価証券 1,700株
トーセイ	26,800	1,355.00	36,314,000	

穴吹興産	3,800	1,943.00	7,383,400	貸付有価証券 200株
サンフロンティア不動産	26,800	1,093.00	29,292,400	
FJネクストホールディングス	17,000	953.00	16,201,000	
インテリックス	3,900	508.00	1,981,200	
ランドビジネス	5,900	220.00	1,298,000	
サンネクスタグループ	5,300	963.00	5,103,900	貸付有価証券 2,400株
グランディハウス	13,600	548.00	7,452,800	
日本空港ビルデング	57,000	6,450.00	367,650,000	貸付有価証券 2,000株
明豊ファシリティワークス	8,400	699.00	5,871,600	
日本工営	12,000	3,290.00	39,480,000	
LIFULL	57,500	212.00	12,190,000	貸付有価証券 12,400株(9,200株)
MIXI	38,300	2,432.00	93,145,600	貸付有価証券 100株
ジェイエシーリクルートメント	15,200	2,470.00	37,544,000	
日本M&Aセンターホールディングス	288,400	1,568.00	452,211,200	貸付有価証券 200株
メンバーズ	4,900	1,935.00	9,481,500	貸付有価証券 400株(300株)
中広	2,300	373.00	857,900	
UTグループ	24,700	2,179.00	53,821,300	
アイティメディア	6,400	1,640.00	10,496,000	
E・Jホールディングス	10,800	1,288.00	13,910,400	貸付有価証券 3,500株
夢真ピーネックスグループ	61,400	1,709.00	104,932,600	
コシダカホールディングス	50,300	1,010.00	50,803,000	貸付有価証券 19,500株(10,100株)
アルトナー	4,100	997.00	4,087,700	
パソナグループ	20,400	1,819.00	37,107,600	貸付有価証券 1,000株
CDS	4,200	1,804.00	7,576,800	貸付有価証券 100株
リンクアンドモチベーション	48,400	631.00	30,540,400	貸付有価証券 15,300株

エス・エム・エス	64,000	3,305.00	211,520,000	
サニーサイドアップグループ	5,900	539.00	3,180,100	貸付有価証券 300株（300株）
パーソルホールディングス	188,200	2,785.00	524,137,000	
リニカル	9,500	668.00	6,346,000	
クックパッド	46,000	182.00	8,372,000	貸付有価証券 2,600株
エスクリ	6,800	301.00	2,046,800	貸付有価証券 3,100株
アイ・ケイ・ケイホールディングス	8,200	651.00	5,338,200	
学情	7,600	1,378.00	10,472,800	貸付有価証券 2,700株
スタジオアリス	8,400	2,041.00	17,144,400	貸付有価証券 4,100株
シミックホールディングス	9,300	1,719.00	15,986,700	貸付有価証券 800株
エプロ	3,600	732.00	2,635,200	貸付有価証券 1,600株（300株）
N J S	3,700	2,049.00	7,581,300	
総合警備保障	62,400	3,560.00	222,144,000	
カカクコム	125,500	2,123.00	266,436,500	貸付有価証券 400株
セントケア・ホールディング	10,700	825.00	8,827,500	
サイネックス	2,800	537.00	1,503,600	
ルネサンス	11,800	830.00	9,794,000	貸付有価証券 1,100株（600株）
ディップ	29,400	3,700.00	108,780,000	貸付有価証券 100株
デジタルホールディングス	13,100	1,224.00	16,034,400	
新日本科学	17,800	2,222.00	39,551,600	貸付有価証券 8,300株（4,200株）
キャリアデザインセンター	3,500	1,451.00	5,078,500	
ベネフィット・ワン	77,900	1,916.00	149,256,400	貸付有価証券 300株
エムスリー	332,200	3,543.00	1,176,984,600	
ツカダ・グローバルホー	10,800	341.00	3,682,800	貸付有価証券

ルディング				1,400株
プラス	2,200	1,008.00	2,217,600	
アウトソーシング	100,100	955.00	95,595,500	貸付有価証券 8,200株
ウェルネット	14,900	596.00	8,880,400	貸付有価証券 4,200株(3,600株)
ワールドホールディングス	7,500	2,767.00	20,752,500	
ディー・エヌ・エー	71,700	1,764.00	126,478,800	貸付有価証券 900株
博報堂D Yホールディングス	214,400	1,317.00	282,364,800	
ぐるなび	30,900	370.00	11,433,000	貸付有価証券 700株
タカミヤ	22,800	374.00	8,527,200	貸付有価証券 100株
ジャパンベストレスキューシステム	10,400	817.00	8,496,800	
ファンコミュニケーションズ	32,900	424.00	13,949,600	
ライク	6,300	1,955.00	12,316,500	貸付有価証券 2,700株
ビジネス・ブレークスルー	6,300	377.00	2,375,100	貸付有価証券 1,400株
エスプール	48,300	845.00	40,813,500	貸付有価証券 3,700株
W D Bホールディングス	8,600	2,102.00	18,077,200	
ティア	9,900	417.00	4,128,300	貸付有価証券 200株
C D G	1,800	1,027.00	1,848,600	
アドウェイズ	23,100	487.00	11,249,700	貸付有価証券 5,400株(4,900株)
バリューコマース	12,600	1,796.00	22,629,600	貸付有価証券 100株
インフォマート	174,500	365.00	63,692,500	貸付有価証券 1,300株
J Pホールディングス	48,400	282.00	13,648,800	貸付有価証券 300株
C Lホールディングス	4,600	760.00	3,496,000	貸付有価証券 2,100株
プレステージ・インターナショナル	70,700	711.00	50,267,700	貸付有価証券 400株

アミューズ	9,100	1,734.00	15,779,400	
ドリームインキュベータ	5,100	2,212.00	11,281,200	
クイック	12,800	2,047.00	26,201,600	
T A C	8,100	200.00	1,620,000	貸付有価証券 2,900株
電通グループ	176,400	4,170.00	735,588,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,800	1,375.00	7,975,000	貸付有価証券 400株(200株)
ぴあ	5,600	3,100.00	17,360,000	
イオンファンタジー	7,300	2,645.00	19,308,500	貸付有価証券 2,800株(400株)
シーティーエス	18,600	815.00	15,159,000	
ネクシィーズグループ	5,200	642.00	3,338,400	貸付有価証券 200株(200株)
H . U . グループホールディングス	49,200	2,786.00	137,071,200	貸付有価証券 500株
アルプス技研	14,600	2,086.00	30,455,600	
日本空調サービス	18,100	681.00	12,326,100	
オリエンタルランド	177,900	18,600.00	3,308,940,000	
ダスキン	37,400	2,986.00	111,676,400	
明光ネットワークジャパン	22,100	620.00	13,702,000	
ファルコホールディングス	7,600	1,742.00	13,239,200	
秀英予備校	3,700	432.00	1,598,400	貸付有価証券 1,500株
ラウンドワン	140,600	480.00	67,488,000	
リゾートトラスト	66,400	2,328.00	154,579,200	
ピー・エム・エル	20,800	3,275.00	68,120,000	
りらいあコミュニケーションズ	27,800	1,019.00	28,328,200	
リソー教育	76,400	360.00	27,504,000	貸付有価証券 200株
早稲田アカデミー	9,300	1,113.00	10,350,900	貸付有価証券 2,300株
ユー・エス・エス	172,900	2,132.00	368,622,800	
東京個別指導学院	19,900	524.00	10,427,600	貸付有価証券 2,200株(2,100株)
サイバーエージェント	402,200	1,136.00	456,899,200	貸付有価証券 7,000株

楽天グループ	777,600	590.00	458,784,000	貸付有価証券 208,000株
クリーク・アンド・リバー社	9,900	1,940.00	19,206,000	貸付有価証券 1,300株（900株）
モーニングスター	27,400	447.00	12,247,800	
テー・オー・ダブリュー	35,900	294.00	10,554,600	
山田コンサルティンググループ	8,500	1,148.00	9,758,000	
セントラルスポーツ	6,300	2,367.00	14,912,100	貸付有価証券 2,500株
フルキャストホールディングス	16,000	2,788.00	44,608,000	貸付有価証券 200株
エン・ジャパン	30,400	2,292.00	69,676,800	
リソルホールディングス	1,500	4,510.00	6,765,000	貸付有価証券 800株（200株）
テクノプロ・ホールディングス	112,700	3,475.00	391,632,500	
アトラグループ	3,800	200.00	760,000	貸付有価証券 1,700株（700株）
インターワークス	4,300	342.00	1,470,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	8,700	1,700.00	14,790,000	貸付有価証券 3,000株（2,000株）
Keepers 技研	12,100	3,725.00	45,072,500	貸付有価証券 100株
ファーストロジック	2,600	898.00	2,334,800	
三機サービス	2,900	897.00	2,601,300	
Gunosy	10,400	592.00	6,156,800	貸付有価証券 4,800株
デザインワン・ジャパン	5,000	200.00	1,000,000	貸付有価証券 2,100株（800株）
イー・ガーディアン	6,400	2,576.00	16,486,400	
リブセンス	7,800	272.00	2,121,600	貸付有価証券 600株
ジャパンマテリアル	51,400	2,123.00	109,122,200	貸付有価証券 600株
ベクトル	26,400	1,296.00	34,214,400	
ウチヤマホールディングス	7,100	260.00	1,846,000	貸付有価証券 400株（200株）
チャーム・ケア・コーポレーション	14,000	1,218.00	17,052,000	貸付有価証券 100株
キャリアリンク	6,200	2,813.00	17,440,600	貸付有価証券

				400株(400株)
I B J	10,300	886.00	9,125,800	貸付有価証券 1,000株(900株)
アサンテ	8,300	1,605.00	13,321,500	
バリューHR	14,700	1,571.00	23,093,700	貸付有価証券 6,900株
M & Aキャピタルパートナーズ	15,500	4,345.00	67,347,500	貸付有価証券 200株
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,000	1,051.00	6,306,000	貸付有価証券 900株(900株)
E R Iホールディングス	4,700	1,044.00	4,906,800	貸付有価証券 1,800株
アピスト	2,600	2,861.00	7,438,600	貸付有価証券 100株(100株)
シグマクシス・ホールディングス	25,500	1,270.00	32,385,000	貸付有価証券 500株(500株)
ウィルグループ	14,000	1,185.00	16,590,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	17,700	142.00	2,513,400	貸付有価証券 1,200株(400株)
メドピア	13,200	1,403.00	18,519,600	貸付有価証券 6,200株(3,500株)
レアジョブ	3,200	880.00	2,816,000	
リクルートホールディングス	1,244,700	4,192.00	5,217,782,400	貸付有価証券 21,400株
エラン	22,200	945.00	20,979,000	
土木管理総合試験所	7,000	310.00	2,170,000	
日本郵政	2,203,400	1,102.50	2,429,248,500	貸付有価証券 5,500株
ベルシステム24ホールディングス	22,500	1,350.00	30,375,000	貸付有価証券 200株(200株)
鎌倉新書	19,100	919.00	17,552,900	貸付有価証券 2,000株(1,600株)
S M N	4,000	455.00	1,820,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
一蔵	2,100	448.00	940,800	
グローバルキッズCOMPANY	2,600	552.00	1,435,200	
エアトリ	10,800	2,414.00	26,071,200	貸付有価証券 5,000株(4,500株)
アトラエ	13,200	1,205.00	15,906,000	貸付有価証券 200株

ストライク	8,300	4,130.00	34,279,000	
ソラスト	46,300	675.00	31,252,500	
セラク	6,000	1,108.00	6,648,000	貸付有価証券 100株(100株)
インソース	20,900	3,090.00	64,581,000	
ベイカレント・コンサル ティング	133,100	4,225.00	562,347,500	貸付有価証券 6,000株
Orchestra H oldings	3,600	1,730.00	6,228,000	貸付有価証券 200株(200株)
アイモバイル	8,700	1,119.00	9,735,300	
キャリアインデックス	5,800	305.00	1,769,000	
MS - J a p a n	5,500	971.00	5,340,500	
船場	2,800	769.00	2,153,200	貸付有価証券 200株
ジャパンエレベーター サービスホールディン	59,900	1,604.00	96,079,600	貸付有価証券 400株
フルテック	2,400	1,214.00	2,913,600	貸付有価証券 1,100株
グリーンズ	6,400	1,008.00	6,451,200	貸付有価証券 3,000株
ツナググループ・ホール ディングス	4,700	500.00	2,350,000	貸付有価証券 1,300株(1,200株)
GameWith	5,000	311.00	1,555,000	貸付有価証券 2,300株(400株)
MS & C o n s u l t i n g	2,000	592.00	1,184,000	
ウェルビー	12,300	708.00	8,708,400	貸付有価証券 4,700株(1,800株)
エル・ティー・エス	2,100	2,850.00	5,985,000	
ミダックホールディング ス	10,200	2,502.00	25,520,400	貸付有価証券 3,900株
日総工産	12,600	537.00	6,766,200	貸付有価証券 3,500株
キュービーネットホール ディングス	8,700	1,298.00	11,292,600	
R P Aホールディングス	22,700	255.00	5,788,500	
スプリックス	5,800	880.00	5,104,000	貸付有価証券 800株(700株)
マネジメントソリュー ションズ	9,200	3,480.00	32,016,000	貸付有価証券 4,300株(3,700株)
プロレド・パートナーズ	4,100	460.00	1,886,000	貸付有価証券

				300株(100株)
and factory	4,900	355.00	1,739,500	
テノ・ホールディングス	2,100	509.00	1,068,900	貸付有価証券 100株
フロンティア・マネジメント	5,600	1,161.00	6,501,600	貸付有価証券 400株
ピアラ	2,700	553.00	1,493,100	貸付有価証券 400株(400株)
コプロ・ホールディングス	2,800	968.00	2,710,400	
ギークス	2,300	815.00	1,874,500	貸付有価証券 600株
カーブスホールディングス	51,700	887.00	45,857,900	
フォーラムエンジニアリング	9,800	827.00	8,104,600	貸付有価証券 100株
Fast Fitness Japan	5,700	1,070.00	6,099,000	
ダイレクトマーケティングミックス	19,300	1,501.00	28,969,300	
ポピンズ	2,500	1,509.00	3,772,500	
LITALICO	13,100	2,170.00	28,427,000	貸付有価証券 2,700株
アドバンテッジリスクマネジメント	7,600	367.00	2,789,200	貸付有価証券 600株
リログループ	93,600	2,071.00	193,845,600	貸付有価証券 2,200株
東祥	11,700	1,082.00	12,659,400	貸付有価証券 2,100株(400株)
ビーウィズ	5,000	1,099.00	5,495,000	貸付有価証券 2,300株
TREホールディングス	35,400	1,414.00	50,055,600	貸付有価証券 100株
人・夢・技術グループ	7,500	1,725.00	12,937,500	
エイチ・アイ・エス	44,000	2,108.00	92,752,000	貸付有価証券 19,200株(500株)
ラックランド	5,200	2,990.00	15,548,000	貸付有価証券 2,400株(1,800株)
共立メンテナンス	28,800	5,640.00	162,432,000	貸付有価証券 10,600株(9,000株)
イチネンホールディングス	17,800	1,239.00	22,054,200	

建設技術研究所	8,700	3,245.00	28,231,500	
スペース	12,200	895.00	10,919,000	
燦ホールディングス	7,400	1,731.00	12,809,400	貸付有価証券 100株(100株)
スバル興業	1,000	9,120.00	9,120,000	貸付有価証券 400株
東京テアトル	6,200	1,110.00	6,882,000	貸付有価証券 300株(100株)
タナベコンサルティング グループ	6,500	629.00	4,088,500	
ナガワ	4,500	7,220.00	32,490,000	貸付有価証券 2,100株(200株)
東京都競馬	14,100	3,735.00	52,663,500	貸付有価証券 6,600株
常磐興産	5,800	1,163.00	6,745,400	貸付有価証券 2,800株
カナモト	30,800	2,263.00	69,700,400	貸付有価証券 100株
西尾レントオール	15,600	3,055.00	47,658,000	
トランス・コスモス	20,900	3,215.00	67,193,500	貸付有価証券 100株(100株)
乃村工藝社	73,300	934.00	68,462,200	貸付有価証券 100株
藤田観光	7,500	2,729.00	20,467,500	貸付有価証券 3,500株(200株)
KNT-CTホールディ ングス	10,000	1,625.00	16,250,000	貸付有価証券 700株(700株)
日本管財	17,600	2,497.00	43,947,200	
トーカイ	14,900	1,898.00	28,280,200	
白洋舎	1,600	1,760.00	2,816,000	貸付有価証券 800株
セコム	171,200	7,669.00	1,312,932,800	
セントラル警備保障	9,100	2,312.00	21,039,200	貸付有価証券 500株(300株)
丹青社	32,600	692.00	22,559,200	貸付有価証券 100株
メイテック	67,000	2,400.00	160,800,000	
応用地質	16,300	2,191.00	35,713,300	貸付有価証券 3,500株
船井総研ホールディ ングス	35,300	2,674.00	94,392,200	貸付有価証券 300株

進学会ホールディングス	5,500	299.00	1,644,500	貸付有価証券 2,200株（400株）
オオバ	10,600	642.00	6,805,200	貸付有価証券 5,100株（200株）
いであ	3,700	1,729.00	6,397,300	貸付有価証券 100株（100株）
学究社	6,700	1,765.00	11,825,500	貸付有価証券 400株（400株）
ベネッセホールディングス	62,800	1,981.00	124,406,800	貸付有価証券 4,800株
イオンディライト	18,600	3,025.00	56,265,000	
ナック	7,400	926.00	6,852,400	
ダイセキ	34,300	4,540.00	155,722,000	
ステップ	6,900	1,770.00	12,213,000	貸付有価証券 100株（100株）
小計	銘柄数：2,145 組入時価比率：98.0%		449,299,523,080 100.0%	
合計			449,299,523,080	

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

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

(2)株式以外の有価証券(2022年12月26日現在)

該当事項はありません。

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年12月26日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	9,532,834,800	-	9,196,000,000	337,074,380
合計	9,532,834,800	-	9,196,000,000	337,074,380

(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 - KOKUSA Iマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(2022年12月26日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	6,238,636,805
コール・ローン	2,311,911,791
株式	1,294,125,884,476
投資証券	30,727,100,288
派生商品評価勘定	26,078,733
未収入金	12,972,706
未収配当金	1,278,958,777
差入委託証拠金	4,870,051,614
流動資産合計	1,339,591,595,190
資産合計	
1,339,591,595,190	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	275,105,923
未払金	275,293,439
未払解約金	2,168,709,366
未払利息	3,555
その他未払費用	3,978,300
流動負債合計	2,723,090,583
負債合計	
2,723,090,583	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	305,867,270,059
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,031,001,234,548
元本等合計	1,336,868,504,607
純資産合計	
1,336,868,504,607	
負債純資産合計	
1,339,591,595,190	

### 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 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</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>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年12月26日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	4.3707円
(10,000口当たり純資産額)	(43,707円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年12月28日 至 2022年12月26日	
1. 金融商品に対する取組方針	<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>
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p>

## 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

## 市場リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2022年12月26日現在

## 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2.時価の算定方法

## 株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年12月26日現在

	2021年12月28日
期首	
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	266,083,698,954円
同期中における追加設定元本額	62,253,961,184円
同期中における一部解約元本額	22,470,390,079円
期末元本額	305,867,270,059円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	29,224,306円
バランスセレクト50	88,792,498円
バランスセレクト70	111,948,437円
野村外国株式インデックスファンド	496,746,768円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,923,002,503円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	3,815,791,711円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	4,147,085,021円
野村資産設計ファンド2015	8,942,445円
野村資産設計ファンド2020	9,589,278円

野村資産設計ファンド2025	16,001,592円
野村資産設計ファンド2030	24,998,715円
野村資産設計ファンド2035	23,760,134円
野村資産設計ファンド2040	42,135,041円
野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	45,555,718,456円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	1,034,312,930円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	11,983,152,236円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	12,704,310,549円
野村資産設計ファンド2045	9,212,522円
野村インデックスファンド・外国株式	8,503,368,914円
マイ・ロード	1,163,276,805円
ネクストコア	10,882,839円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	184,966,349円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	2,495,194,117円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	266,250,555円
野村資産設計ファンド2050	10,633,966円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	2,801,809円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,760,938円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,379,318円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,229,941円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	247,017,657円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	1,098,990,372円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,027,735円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,502,993円
インデックス・ブレンド(タイプ)	25,318,186円
インデックス・ブレンド(タイプ)	7,728,147円
インデックス・ブレンド(タイプ)	33,874,299円
野村6資産均等バランス	1,597,848,878円
野村つみたて外国株投信	13,530,802,368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)	5,229,909,909円
世界6資産分散ファンド	39,271,202円
野村資産設計ファンド2060	8,227,975円
野村スリーゼロ先進国株式投信	1,414,975,432円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信	6,776,711,105円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	6,181,645,608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)	111,333,091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)	60,132,940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)	471,019,888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)	444,461,100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)	719,526円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	4,126,740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)	1,044,751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)	560,179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)	9,727,949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)	331,042,323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)	3,968,785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)	25,707,827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)	78,303,209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)	2,035,165,297円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	16,830,367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)	737,171,919円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	11,625,689,991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)	1,049,790円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	1,297,949円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	8,586,398円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	8,165,100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)	92,678,839,673円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,032,156,689円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	7,751,379,119円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	7,662,716,160円
マイバランスDC30	831,645,276円
マイバランスDC50	1,914,124,964円
マイバランスDC70	1,785,084,331円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	40,594,317,417円
野村DC運用戦略ファンド	395,131,706円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	27,954,643円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	462,965,279円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	420,768,523円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	411,791,236円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	19,590,907円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	9,252,680円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	50,371,590円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	9,984,967円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	9,446,471円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	7,055,426円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	256,417,604円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	189,459,945円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	116,534,059円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	152,850,063円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	5,267,883円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	53,372,501円
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	106,992,391円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	53,063,378円
野村DCバランスファンド(年金運用戦略タイプ)	19,307,500円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1)株式(2022年12月26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	213,000	29.10	6,198,300.00	
		HALLIBURTON CO	195,000	39.09	7,622,550.00	
		SCHLUMBERGER LTD	304,100	52.99	16,114,259.00	
		APA CORPORATION	72,000	47.25	3,402,000.00	
		CHENIERE ENERGY INC	48,100	155.92	7,499,752.00	
		CHESAPEAKE ENERGY CORP	21,600	97.37	2,103,192.00	
		CHEVRON CORP	397,700	177.40	70,551,980.00	
		CONOCOPHILLIPS	272,300	117.05	31,872,715.00	
		COTERRA ENERGY INC	169,000	25.20	4,258,800.00	
		DEVON ENERGY CORP	131,800	62.51	8,238,818.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	36,700	137.03	5,029,001.00	
		EOG RESOURCES INC	126,000	130.61	16,456,860.00	
		EQT CORP	70,000	36.21	2,534,700.00	
		EXXON MOBIL CORP	891,400	108.68	96,877,352.00	
		HESS CORP	59,500	141.68	8,429,960.00	
		HF SINCLAIR CORP	34,200	50.88	1,740,096.00	
		KINDER MORGAN INC	433,000	18.14	7,854,620.00	
		MARATHON OIL CORP	148,000	27.44	4,061,120.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	106,600	115.12	12,271,792.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	200,500	63.95	12,821,975.00	
		ONEOK INC	94,400	65.56	6,188,864.00	
		OVINTIV INC	53,500	51.96	2,779,860.00	
		PHILLIPS 66	102,900	103.94	10,695,426.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	48,500	229.11	11,111,835.00	
		TARGA RESOURCES CORP	45,100	73.36	3,308,536.00	
		TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,350	2,508.94	3,387,069.00	
		VALERO ENERGY CORP	84,300	124.37	10,484,391.00	
		WILLIAMS COS	258,000	33.32	8,596,560.00	
		AIR PRODUCTS	47,300	312.04	14,759,492.00	
		ALBEMARLE CORP	25,200	226.96	5,719,392.00	
CELANESE CORP-SERIES A	22,800	102.56	2,338,368.00			
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	43,500	90.74	3,947,190.00			
CORTEVA INC	153,800	59.38	9,132,644.00			

DOW INC	153,000	50.86	7,781,580.00
DUPONT DE NEMOURS INC	107,400	68.73	7,381,602.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	27,200	82.18	2,235,296.00
ECOLAB INC	54,500	144.54	7,877,430.00
FMC CORP	26,700	126.34	3,373,278.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	55,300	103.90	5,745,670.00
LINDE PLC	106,600	329.33	35,106,578.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	56,000	83.13	4,655,280.00
MOSAIC CO/THE	76,000	45.14	3,430,640.00
PPG INDUSTRIES	50,900	126.72	6,450,048.00
RPM INTERNATIONAL INC	27,800	99.81	2,774,718.00
SHERWIN-WILLIAMS	52,300	242.67	12,691,641.00
WESTLAKE CORPORATION	7,500	105.10	788,250.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	13,500	338.59	4,570,965.00
VULCAN MATERIALS CO	28,700	175.20	5,028,240.00
AMCOR PLC	317,000	12.06	3,823,020.00
AVERY DENNISON CORP	16,900	181.11	3,060,759.00
BALL CORP	68,700	51.63	3,546,981.00
CROWN HOLDINGS INC	24,700	82.58	2,039,726.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	73,000	34.73	2,535,290.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	20,300	128.70	2,612,610.00
SEALED AIR CORP	29,400	49.96	1,468,824.00
WESTROCK CO	52,000	35.46	1,843,920.00
ALCOA CORP	41,000	44.20	1,812,200.00
CLEVELAND-CLIFFS INC	115,000	16.90	1,943,500.00
FREEMONT-MCMORAN INC	305,000	38.10	11,620,500.00
NEWMONT CORP	171,000	47.85	8,182,350.00
NUCOR CORP	56,100	136.08	7,634,088.00
STEEL DYNAMICS	39,800	102.59	4,083,082.00
BOEING CO	120,700	189.06	22,819,542.00
GENERAL DYNAMICS	49,500	247.90	12,271,050.00
HEICO CORP	9,300	154.19	1,433,967.00
HEICO CORP-CLASS A	15,500	120.26	1,864,030.00
HOWMET AEROSPACE INC	78,000	39.06	3,046,680.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	8,400	230.07	1,932,588.00

L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	40,500	206.24	8,352,720.00
LOCKHEED MARTIN	51,000	483.29	24,647,790.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	31,590	534.77	16,893,384.30
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	315,800	99.30	31,358,940.00
TEXTRON INC	46,400	70.41	3,267,024.00
TRANSDIGM GROUP INC	11,070	620.32	6,866,942.40
ALLEGION PLC	17,900	105.03	1,880,037.00
CARLISLE COS INC	11,400	237.89	2,711,946.00
CARRIER GLOBAL CORP	182,000	41.79	7,605,780.00
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	27,500	56.83	1,562,825.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	147,400	64.10	9,448,340.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	7,100	243.07	1,725,797.00
MASCO CORP	49,600	47.13	2,337,648.00
OWENS CORNING INC	21,100	88.23	1,861,653.00
SMITH (A.O.) CORP	27,900	56.90	1,587,510.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	49,600	169.95	8,429,520.00
QUANTA SERVICES INC	30,900	144.20	4,455,780.00
AMETEK INC	48,700	139.38	6,787,806.00
EATON CORP PLC	85,700	156.80	13,437,760.00
EMERSON ELEC	127,300	95.54	12,162,242.00
GENERAC HOLDINGS INC	13,100	92.19	1,207,689.00
HUBBELL INC	11,300	235.72	2,663,636.00
PLUG POWER INC	105,000	12.34	1,295,700.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	24,800	256.74	6,367,152.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	32,000	39.77	1,272,640.00
3M CORP	118,200	120.14	14,200,548.00
GENERAL ELECTRIC CO	235,500	81.79	19,261,545.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	144,100	213.87	30,818,667.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	34,000	50.71	1,724,140.00
CATERPILLAR INC DEL	112,900	239.87	27,081,323.00
CUMMINS INC	30,500	241.26	7,358,430.00
DEERE & COMPANY	62,100	436.93	27,133,353.00
DOVER CORP	31,300	134.72	4,216,736.00
FORTIVE CORP	71,400	64.15	4,580,310.00
	16,200	229.33	3,715,146.00

IDEX CORP				
ILLINOIS TOOL WORKS INC	65,800	221.97	14,605,626.00	
INGERSOLL-RAND INC	85,000	52.28	4,443,800.00	
NORDSON CORP	11,200	236.32	2,646,784.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	89,200	78.36	6,989,712.00	
PACCAR	75,200	100.55	7,561,360.00	
PARKER HANNIFIN CORP	27,500	290.96	8,001,400.00	
PENTAIR PLC	33,700	44.40	1,496,280.00	
SNAP-ON INC	11,500	227.74	2,619,010.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	32,700	73.94	2,417,838.00	
WABTEC CORP	36,300	100.49	3,647,787.00	
XYLEM INC	37,900	109.73	4,158,767.00	
AERCAP HOLDINGS NV	29,000	56.68	1,643,720.00	
FASTENAL CO	121,500	47.76	5,802,840.00	
FERGUSON PLC	44,000	124.86	5,493,840.00	
GRAINGER(W.W.) INC	9,730	565.10	5,498,423.00	
UNITED RENTALS INC	14,900	355.22	5,292,778.00	
CINTAS CORP	19,400	457.24	8,870,456.00	
COPART INC	92,100	60.51	5,572,971.00	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	47,900	130.77	6,263,883.00	
ROLLINS INC	47,000	37.12	1,744,640.00	
WASTE CONNECTIONS INC	55,200	133.37	7,362,024.00	
WASTE MANAGEMENT INC	88,900	159.21	14,153,769.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	25,900	93.08	2,410,772.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	34,800	107.31	3,734,388.00	
FEDEX CORPORATION	52,900	175.93	9,306,697.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	156,500	177.01	27,702,065.00	
DELTA AIR LINES INC	36,000	33.16	1,193,760.00	
SOUTHWEST AIRLINES	34,000	36.09	1,227,060.00	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	17,000	17.51	297,670.00	
CSX CORP	457,000	31.25	14,281,250.00	
GRAB HOLDINGS LTD-CL A	290,000	3.27	948,300.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	17,900	177.36	3,174,744.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	33,800	52.37	1,770,106.00	

NORFOLK SOUTHERN CORP	50,000	247.50	12,375,000.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	20,500	286.10	5,865,050.00	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	19,170	54.85	1,051,474.50	
UBER TECHNOLOGIES INC	321,000	24.64	7,909,440.00	
UNION PAC CORP	133,600	209.91	28,043,976.00	
APTIV PLC	58,800	91.26	5,366,088.00	
BORGWARNER INC	50,000	40.00	2,000,000.00	
LEAR CORP	12,300	121.92	1,499,616.00	
FORD MOTOR COMPANY	845,000	11.36	9,599,200.00	
GENERAL MOTORS CO	299,000	33.83	10,115,170.00	
LUCID GROUP INC	80,000	6.70	536,000.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	66,000	19.14	1,263,240.00	
TESLA INC	569,700	123.15	70,158,555.00	
DR HORTON INC	71,000	89.18	6,331,780.00	
GARMIN LTD	33,100	91.26	3,020,706.00	
LENNAR CORP-A	54,800	90.62	4,965,976.00	
MOHAWK INDUSTRIES	10,900	97.96	1,067,764.00	
NEWELL BRANDS INC	85,000	12.99	1,104,150.00	
NVR INC	650	4,645.00	3,019,250.00	
PULTEGROUP INC	51,000	45.79	2,335,290.00	
WHIRLPOOL CORP	11,300	141.62	1,600,306.00	
HASBRO INC	28,100	58.21	1,635,701.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	24,900	311.54	7,757,346.00	
NIKE INC-B	270,300	116.25	31,422,375.00	
V F CORP	72,000	26.07	1,877,040.00	
AIRBNB INC-CLASS A	82,000	85.25	6,990,500.00	
ARAMARK	50,000	41.50	2,075,000.00	
BOOKING HOLDINGS INC	8,470	1,971.52	16,698,774.40	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	44,000	43.09	1,895,960.00	
CARNIVAL CORP	206,000	7.81	1,608,860.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	5,920	1,412.36	8,361,171.20	
DARDEN RESTAURANTS INC	26,600	138.84	3,693,144.00	
DOMINOS PIZZA INC	7,400	353.02	2,612,348.00	
EXPEDIA GROUP INC	32,100	86.43	2,774,403.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	58,600	126.43	7,408,798.00	

LAS VEGAS SANDS CORP	74,000	46.52	3,442,480.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	59,500	148.58	8,840,510.00
MCDONALD'S CORP	157,400	267.57	42,115,518.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	70,000	33.82	2,367,400.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	49,000	49.79	2,439,710.00
STARBUCKS CORP	245,400	98.27	24,115,458.00
VAIL RESORTS INC	8,900	241.06	2,145,434.00
WYNN RESORTS LTD	22,800	80.72	1,840,416.00
YUM BRANDS INC	60,100	128.90	7,746,890.00
GENUINE PARTS CO	30,500	176.57	5,385,385.00
LKQ CORP	56,300	53.64	3,019,932.00
POOL CORP	8,300	305.60	2,536,480.00
AMAZON.COM INC	1,961,200	85.25	167,192,300.00
CHEWY INC - CLASS A	20,000	39.32	786,400.00
DOORDASH INC-A	49,000	50.69	2,483,810.00
EBAY INC	117,000	40.17	4,699,890.00
ETSY INC	26,400	126.94	3,351,216.00
MERCADOLIBRE INC	9,710	878.32	8,528,487.20
DOLLAR GENERAL CORP	48,000	247.55	11,882,400.00
DOLLAR TREE INC	47,300	141.91	6,712,343.00
TARGET CORP	99,000	143.15	14,171,850.00
ADVANCE AUTO PARTS	13,100	143.28	1,876,968.00
AUTOZONE	4,150	2,430.65	10,087,197.50
BATH & BODY WORKS INC	50,400	41.94	2,113,776.00
BEST BUY COMPANY INC	42,400	81.35	3,449,240.00
BURLINGTON STORES INC	14,300	200.34	2,864,862.00
CARMAX INC	33,300	60.16	2,003,328.00
HOME DEPOT	219,000	318.73	69,801,870.00
LOWES COS INC	132,800	201.88	26,809,664.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	13,540	833.55	11,286,267.00
ROSS STORES INC	74,100	115.48	8,557,068.00
TJX COS INC	247,500	79.50	19,676,250.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	23,500	217.06	5,100,910.00
ULTA BEAUTY INC	11,100	456.40	5,066,040.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	94,700	462.65	43,812,955.00

KROGER CO	146,000	45.89	6,699,940.00	
SYSCO CORP	108,000	78.09	8,433,720.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	159,000	38.63	6,142,170.00	
WALMART INC	322,500	143.77	46,365,825.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	67,500	66.35	4,478,625.00	
COCA COLA CO	878,800	63.82	56,085,016.00	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	43,000	54.97	2,363,710.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	33,900	232.41	7,878,699.00	
KEURIG DR PEPPER INC	169,000	36.37	6,146,530.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	41,900	51.93	2,175,867.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	84,300	101.26	8,536,218.00	
PEPSICO INC	295,200	182.26	53,803,152.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	120,800	94.62	11,430,096.00	
BUNGE LIMITED	31,800	98.96	3,146,928.00	
CAMPBELL SOUP CO	43,900	57.28	2,514,592.00	
CONAGRA BRANDS INC	104,000	38.84	4,039,360.00	
DARLING INGREDIENTS INC	33,700	61.68	2,078,616.00	
GENERAL MILLS	127,400	85.41	10,881,234.00	
HERSHEY CO/THE	31,000	235.88	7,312,280.00	
HORMEL FOODS CORP	62,800	45.63	2,865,564.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	22,700	159.44	3,619,288.00	
KELLOGG CO	55,200	72.18	3,984,336.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	159,000	40.52	6,442,680.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	30,300	89.63	2,715,789.00	
MCCORMICK & CO INC.	52,600	84.22	4,429,972.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	292,100	67.10	19,599,910.00	
TYSON FOODS INC-CL A	62,400	61.35	3,828,240.00	
ALTRIA GROUP INC	387,000	46.24	17,894,880.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	331,600	101.69	33,720,404.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	52,000	82.06	4,267,120.00	
CLOROX CO	26,700	144.11	3,847,737.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	168,300	79.45	13,371,435.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	72,300	137.15	9,915,945.00	
PROCTER & GAMBLE CO	510,200	152.62	77,866,724.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	49,100	241.02	11,834,082.00	

ABBOTT LABORATORIES	374,600	108.18	40,524,228.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	16,100	203.67	3,279,087.00
BAXTER INTERNATIONAL INC.	106,200	50.17	5,328,054.00
BECTON,DICKINSON	61,300	254.47	15,599,011.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	306,000	46.06	14,094,360.00
DENTSPLY SIRONA INC	49,000	31.83	1,559,670.00
DEXCOM INC	83,200	111.44	9,271,808.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	131,500	74.19	9,755,985.00
HOLOGIC INC	54,500	75.51	4,115,295.00
IDEXX LABORATORIES INC	17,700	410.58	7,267,266.00
INSULET CORP	15,000	292.09	4,381,350.00
INTUITIVE SURGICAL INC	76,100	262.66	19,988,426.00
MASIMO CORP	10,600	148.09	1,569,754.00
MEDTRONIC PLC	284,400	77.50	22,041,000.00
NOVOCURE LTD	21,200	73.00	1,547,600.00
RESMED INC	31,400	208.32	6,541,248.00
STERIS PLC	21,100	182.06	3,841,466.00
STRYKER CORP	73,200	242.84	17,775,888.00
TELEFLEX INC	10,300	248.81	2,562,743.00
THE COOPER COMPANIES, INC.	10,500	332.73	3,493,665.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	45,200	126.69	5,726,388.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	33,300	170.01	5,661,333.00
CARDINAL HEALTH INC	58,300	80.05	4,666,915.00
CENTENE CORP	122,300	81.63	9,983,349.00
CIGNA CORP	65,300	334.31	21,830,443.00
CVS HEALTH CORP	280,800	93.56	26,271,648.00
DAVITA INC	12,500	73.76	922,000.00
ELEVANCE HEALTH INC	51,330	514.29	26,398,505.70
HCA HEALTHCARE INC	49,100	240.74	11,820,334.00
HENRY SCHEIN INC	30,100	80.64	2,427,264.00
HUMANA INC	27,010	513.96	13,882,059.60
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	19,100	231.65	4,424,515.00
MCKESSON CORP	30,700	383.67	11,778,669.00
MOLINA HEALTHCARE INC	12,400	335.08	4,154,992.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	25,200	156.31	3,939,012.00

UNITEDHEALTH GROUP INC	200,070	531.31	106,299,191.70	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	14,300	140.76	2,012,868.00	
ABBVIE INC	378,200	163.10	61,684,420.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	25,500	237.90	6,066,450.00	
AMGEN INC	114,400	263.92	30,192,448.00	
BIOGEN INC	31,300	279.16	8,737,708.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	40,200	104.34	4,194,468.00	
EXACT SCIENCES CORP	36,600	50.45	1,846,470.00	
GILEAD SCIENCES INC	267,000	84.75	22,628,250.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	46,700	113.00	5,277,100.00	
INCYTE CORP	41,100	81.36	3,343,896.00	
MODERNA INC	71,000	199.08	14,134,680.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	20,800	120.31	2,502,448.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	23,040	726.74	16,744,089.60	
SEAGEN INC	30,000	127.02	3,810,600.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	54,700	289.69	15,846,043.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	456,700	72.89	33,288,863.00	
CATALENT INC	36,500	43.35	1,582,275.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	95,000	11.71	1,112,450.00	
ELI LILLY & CO.	172,800	367.90	63,573,120.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	13,400	157.19	2,106,346.00	
JOHNSON & JOHNSON	562,400	177.48	99,814,752.00	
MERCK & CO INC	541,900	111.86	60,616,934.00	
PFIZER INC	1,200,500	51.83	62,221,915.00	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	73,000	39.44	2,879,120.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	236,000	9.24	2,180,640.00	
VIATRIS INC	267,000	11.01	2,939,670.00	
ZOETIS INC	100,700	145.76	14,678,032.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,547,000	32.47	50,231,090.00	
CITIGROUP	413,000	44.26	18,279,380.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	104,000	38.90	4,045,600.00	
FIFTH THIRD BANCORP	144,000	32.41	4,667,040.00	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	2,510	751.12	1,885,311.20	
FIRST HORIZON CORP	113,000	24.48	2,766,240.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	39,500	119.40	4,716,300.00	

HUNTINGTON BANCSHARES INC	302,000	14.05	4,243,100.00	
JPMORGAN CHASE & CO	627,300	131.28	82,351,944.00	
KEYCORP	200,000	17.18	3,436,000.00	
M & T BANK CORP	37,400	144.56	5,406,544.00	
PNC FINANCIAL	88,200	155.02	13,672,764.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	200,000	21.22	4,244,000.00	
SIGNATURE BANK	12,700	115.00	1,460,500.00	
SVB FINANCIAL GROUP	12,500	216.85	2,710,625.00	
TRUIST FINANCIAL CORP	286,000	42.59	12,180,740.00	
US BANCORP	304,000	43.20	13,132,800.00	
WEBSTER FINANCIAL CORP	37,000	46.73	1,729,010.00	
WELLS FARGO CO	811,000	40.98	33,234,780.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	86,000	64.25	5,525,500.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	278,300	306.49	85,296,167.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	79,000	28.61	2,260,190.00	
AFLAC INC	128,600	71.75	9,227,050.00	
ALLSTATE CORP	57,900	136.37	7,895,823.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	15,500	137.82	2,136,210.00	
AMERICAN INTL GROUP	162,700	63.16	10,276,132.00	
AON PLC	45,000	300.59	13,526,550.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	79,000	63.38	5,007,020.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	44,600	188.41	8,403,086.00	
ASSURANT INC	11,300	125.03	1,412,839.00	
BROWN & BROWN INC	52,800	56.94	3,006,432.00	
CHUBB LTD	89,000	219.65	19,548,850.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	32,200	104.46	3,363,612.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	5,400	276.25	1,491,750.00	
EVEREST RE GROUP LTD	8,500	334.92	2,846,820.00	
FNF GROUP	54,000	37.78	2,040,120.00	
GLOBE LIFE INC	19,700	120.14	2,366,758.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	68,400	76.13	5,207,292.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	33,200	30.13	1,000,316.00	
LOEWS CORP	45,300	57.85	2,620,605.00	
MARKEL CORP	2,840	1,307.64	3,713,697.60	
MARSH & MCLENNAN COS	106,400	165.59	17,618,776.00	

METLIFE INC	145,000	72.27	10,479,150.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	53,600	85.56	4,586,016.00
PROGRESSIVE CO	125,700	129.44	16,270,608.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	80,400	99.56	8,004,624.00
TRAVELERS COS INC/THE	50,500	189.48	9,568,740.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	23,400	244.39	5,718,726.00
WR BERKLEY CORP	45,300	73.45	3,327,285.00
ACCENTURE PLC-CL A	135,300	266.09	36,001,977.00
AFFIRM HOLDINGS INC	42,000	9.19	385,980.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	33,600	83.16	2,794,176.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	88,900	240.94	21,419,566.00
BLOCK INC	113,700	60.89	6,923,193.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	24,400	134.48	3,281,312.00
CLOUDFLARE INC - CLASS A	53,000	43.78	2,320,340.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	109,800	56.02	6,150,996.00
EPAM SYSTEMS INC	12,200	323.66	3,948,652.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	129,300	66.92	8,652,756.00
FISERV INC	129,800	100.46	13,039,708.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	15,700	181.22	2,845,154.00
GARTNER INC	16,800	335.95	5,643,960.00
GLOBAL PAYMENTS INC	59,300	96.72	5,735,496.00
GODADDY INC - CLASS A	34,500	74.77	2,579,565.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	193,200	141.65	27,366,780.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	16,000	177.34	2,837,440.00
MASTERCARD INC	184,500	343.60	63,394,200.00
MONGODB INC	14,100	197.47	2,784,327.00
OKTA INC	33,500	67.04	2,245,840.00
PAYCHEX INC	69,400	116.01	8,051,094.00
PAYPAL HOLDINGS INC	234,300	69.03	16,173,729.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	47,200	138.49	6,536,728.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	49,300	51.31	2,529,583.00
TOAST INC-CLASS A	52,000	17.62	916,240.00
TWILIO INC - A	37,200	44.75	1,664,700.00
VERISIGN INC	20,700	203.72	4,217,004.00
VISA INC-CLASS A SHARES	349,700	205.83	71,978,751.00

WESTERN UNION CO	88,000	13.83	1,217,040.00
WIX.COM LTD	12,200	76.27	930,494.00
ADOBE INC	100,150	338.45	33,895,767.50
ANSYS INC	18,800	237.55	4,465,940.00
ASPEN TECHNOLOGY INC	6,100	202.21	1,233,481.00
AUTODESK INC.	46,900	188.16	8,824,704.00
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	40,000	36.79	1,471,600.00
BILL.COM HOLDINGS INC	19,600	103.74	2,033,304.00
BLACK KNIGHT INC	33,000	59.35	1,958,550.00
CADENCE DESIGN SYS INC	58,400	161.45	9,428,680.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	29,900	62.03	1,854,697.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	21,800	126.97	2,767,946.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	43,100	101.99	4,395,769.00
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	8,300	124.35	1,032,105.00
DATADOG INC - CLASS A	53,700	72.42	3,888,954.00
DOCUSIGN INC	42,200	53.90	2,274,580.00
DROPBOX INC-CLASS A	57,000	22.48	1,281,360.00
DYNATRACE INC	44,000	37.28	1,640,320.00
FAIR ISAAC CORP	5,540	616.76	3,416,850.40
FORTINET INC	142,200	48.73	6,929,406.00
GEN DIGITAL INC	128,000	21.30	2,726,400.00
HUBSPOT INC	9,500	281.23	2,671,685.00
INTUIT INC	57,300	384.49	22,031,277.00
MICROSOFT CORP	1,515,400	238.73	361,771,442.00
ORACLE CORPORATION	342,000	80.85	27,650,700.00
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	354,000	6.29	2,226,660.00
PALO ALTO NETWORKS INC	63,900	141.27	9,027,153.00
PAYCOM SOFTWARE INC	10,900	305.17	3,326,353.00
PAYLOCITY HOLDING CORP	8,700	191.93	1,669,791.00
PTC INC	23,800	121.25	2,885,750.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	22,700	430.11	9,763,497.00
SALESFORCE INC	213,940	129.44	27,692,393.60
SERVICENOW INC	43,100	381.86	16,458,166.00
SPLUNK INC	34,800	84.60	2,944,080.00

SYNOPSYS INC	33,000	320.21	10,566,930.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	8,600	320.12	2,753,032.00
UNITY SOFTWARE INC	52,000	27.63	1,436,760.00
VMWARE INC - CLASS A	45,000	121.42	5,463,900.00
WORKDAY INC-CLASS A	43,200	164.64	7,112,448.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	47,200	65.89	3,110,008.00
ZSCALER INC	17,800	108.78	1,936,284.00
ARISTA NETWORKS INC	51,500	119.77	6,168,155.00
CISCO SYSTEMS	885,900	47.48	42,062,532.00
F5 INC	12,400	141.01	1,748,524.00
JUNIPER NETWORKS INC	66,000	31.67	2,090,220.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	35,700	256.63	9,161,691.00
APPLE INC	3,437,400	131.86	453,255,564.00
DELL TECHNOLOGIES-C	59,000	39.12	2,308,080.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	274,000	15.75	4,315,500.00
HP INC	222,000	26.76	5,940,720.00
NETAPP INC	46,100	59.04	2,721,744.00
SEAGATE TECHNOLOGY	41,700	50.51	2,106,267.00
WESTERN DIGITAL CORP	67,000	30.59	2,049,530.00
AMPHENOL CORP-CL A	126,600	75.81	9,597,546.00
ARROW ELECTRS INC	13,700	103.93	1,423,841.00
CDW CORPORATION	28,900	178.14	5,148,246.00
COGNEX CORP	38,000	47.44	1,802,720.00
CORNING INC	174,000	31.75	5,524,500.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	38,800	169.83	6,589,404.00
TE CONNECTIVITY LTD	69,100	113.95	7,873,945.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	10,200	393.75	4,016,250.00
TRIMBLE INC	53,400	48.54	2,592,036.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	10,900	248.22	2,705,598.00
ADVANCED MICRO DEVICES	345,248	64.52	22,275,400.96
ANALOG DEVICES INC	109,700	163.84	17,973,248.00
APPLIED MATERIALS	184,800	97.22	17,966,256.00
BROADCOM INC	86,370	552.43	47,713,379.10
ENPHASE ENERGY INC	28,700	293.95	8,436,365.00
ENTEGRIS INC	30,600	65.49	2,003,994.00

FIRST SOLAR INC	20,200	156.75	3,166,350.00
INTEL CORP	878,500	26.09	22,920,065.00
KLA CORP	30,300	377.39	11,434,917.00
LAM RESEARCH	29,100	412.12	11,992,692.00
MARVELL TECHNOLOGY INC	181,000	37.19	6,731,390.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	119,300	69.93	8,342,649.00
MICRON TECHNOLOGY	235,700	50.20	11,832,140.00
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	9,300	350.61	3,260,673.00
NVIDIA CORP	532,640	152.06	80,993,238.40
NXP SEMICONDUCTORS NV	55,700	157.67	8,782,219.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	91,700	62.39	5,721,163.00
QORVO INC	22,500	90.50	2,036,250.00
QUALCOMM INC	240,200	110.84	26,623,768.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	33,700	88.85	2,994,245.00
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	11,600	310.15	3,597,740.00
TERADYNE INC	34,300	86.56	2,969,008.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	195,400	164.38	32,119,852.00
WOLFSPEED INC	26,100	72.27	1,886,247.00
AT & T INC	1,524,000	18.31	27,904,440.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	31,000	19.04	590,240.00
LIBERTY GLOBAL PLC-C	64,000	19.35	1,238,400.00
LUMEN TECHNOLOGIES INC	182,000	5.24	953,680.00
VERIZON COMMUNICATIONS	898,000	38.41	34,492,180.00
T-MOBILE US INC	133,600	140.02	18,706,672.00
ALLIANT ENERGY CORP	55,100	55.30	3,047,030.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	109,900	95.69	10,516,331.00
CONSTELLATION ENERGY	70,800	88.04	6,233,232.00
DUKE ENERGY CORP	165,500	102.99	17,044,845.00
EDISON INTERNATIONAL	82,200	65.18	5,357,796.00
ENTERGY CORP	43,100	113.43	4,888,833.00
EVERGY INC	48,400	63.34	3,065,656.00
EVERSOURCE ENERGY	74,500	84.23	6,275,135.00
EXELON CORPORATION	214,000	43.04	9,210,560.00
FIRSTENERGY CORP	115,000	42.00	4,830,000.00
NEXTERA ENERGY INC	420,300	84.17	35,376,651.00

NRG ENERGY INC	49,000	31.91	1,563,590.00
PG&E CORP	324,000	16.06	5,203,440.00
PPL CORPORATION	156,000	29.54	4,608,240.00
SOUTHERN CO.	232,200	71.74	16,658,028.00
XCEL ENERGY INC	115,700	70.93	8,206,601.00
ATMOS ENERGY CORP	29,700	115.10	3,418,470.00
UGI CORP	45,000	37.33	1,679,850.00
AMEREN CORPORATION	54,700	89.53	4,897,291.00
CENTERPOINT ENERGY INC	135,000	30.69	4,143,150.00
CMS ENERGY CORP	63,400	63.62	4,033,508.00
CONSOLIDATED EDISON INC	76,100	95.85	7,294,185.00
DOMINION ENERGY INC	178,100	60.79	10,826,699.00
DTE ENERGY COMPANY	41,000	118.54	4,860,140.00
NISOURCE INC	86,000	27.71	2,383,060.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	105,300	61.08	6,431,724.00
SEMPRA ENERGY	67,200	157.75	10,600,800.00
WEC ENERGY GROUP INC	66,500	95.48	6,349,420.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	39,100	153.02	5,983,082.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	52,500	47.57	2,497,425.00
ALLY FINANCIAL INC	68,000	23.93	1,627,240.00
AMERICAN EXPRESS CO	136,900	147.02	20,127,038.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	82,300	90.69	7,463,787.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	58,000	97.60	5,660,800.00
SYNCHRONY FINANCIAL	103,800	32.75	3,399,450.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	23,200	308.27	7,151,864.00
ARES MANAGEMENT CORP - A	32,600	67.69	2,206,694.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	165,000	44.65	7,367,250.00
BLACKROCK INC	32,250	703.94	22,702,065.00
BLACKSTONE INC	151,200	74.91	11,326,392.00
CARLYLE GROUP INC/THE	45,000	29.86	1,343,700.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	22,700	126.18	2,864,286.00
CME GROUP INC	77,400	173.33	13,415,742.00
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	26,200	35.49	929,838.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	7,900	398.04	3,144,516.00
FRANKLIN RESOURCES INC	65,000	26.85	1,745,250.00

FUTU HOLDINGS LTD-ADR	13,000	62.06	806,780.00
GOLDMAN SACHS GROUP	73,000	345.51	25,222,230.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	119,300	102.81	12,265,233.00
INVESCO LTD	77,000	18.38	1,415,260.00
KKR & CO INC-A	121,000	46.87	5,671,270.00
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	17,400	215.75	3,754,050.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	7,900	280.85	2,218,715.00
MOODYS CORP	35,200	278.82	9,814,464.00
MORGAN STANLEY	275,400	86.11	23,714,694.00
MSCI INC	17,200	463.82	7,977,704.00
NASDAQ INC	74,700	61.28	4,577,616.00
NORTHERN TRUST CORP	42,500	88.03	3,741,275.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	40,800	107.35	4,379,880.00
S&P GLOBAL INC	72,895	332.94	24,269,661.30
SCHWAB(CHARLES)CORP	311,100	81.77	25,438,647.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	26,000	58.07	1,509,820.00
STATE STREET CORP	79,000	77.49	6,121,710.00
T ROWE PRICE GROUP INC	48,000	111.12	5,333,760.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	24,300	64.27	1,561,761.00
AES CORP	143,000	28.68	4,101,240.00
VISTRA CORP	76,000	23.87	1,814,120.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	29,600	160.82	4,760,272.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	63,900	149.23	9,535,797.00
AVANTOR INC	142,000	20.54	2,916,680.00
BIO TECHNE CORP	34,500	82.73	2,854,185.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	4,670	412.69	1,927,262.30
CHARLES RIVER LABORATORIES	10,500	218.50	2,294,250.00
DANAHER CORP	147,800	259.86	38,407,308.00
ILLUMINA INC	33,800	191.24	6,463,912.00
IQVIA HOLDINGS INC	39,800	203.84	8,112,832.00
METTLER-TOLEDO INTL	4,870	1,439.05	7,008,173.50
PERKINELMER INC	27,400	140.63	3,853,262.00
REPLIGEN CORP	11,100	167.54	1,859,694.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	83,800	540.68	45,308,984.00
WATERS CORP	13,000	346.66	4,506,580.00
	16,200	235.13	3,809,106.00

WEST PHARMACEUTICAL SERVICES				
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	28,900	104.46	3,018,894.00	
CLARIVATE PLC	65,000	8.16	530,400.00	
COSTAR GROUP INC	85,700	76.89	6,589,473.00	
EQUIFAX INC	26,600	195.73	5,206,418.00	
JACOBS SOLUTIONS INC	27,500	120.86	3,323,650.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	27,500	105.17	2,892,175.00	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	22,200	73.38	1,629,036.00	
TRUNSION	40,300	56.54	2,278,562.00	
VERISK ANALYTICS INC	33,600	175.61	5,900,496.00	
CBRE GROUP INC	67,600	76.67	5,182,892.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	220,000	4.57	1,005,400.00	
ZILLOW GROUP INC - C	33,200	33.13	1,099,916.00	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	24,100	333.92	8,047,472.00	
COMCAST CORP-CL A	942,100	35.14	33,105,394.00	
DISH NETWORK CORP-A	51,000	14.46	737,460.00	
FOX CORP-CLASS A	68,000	30.76	2,091,680.00	
FOX CORP-CLASS B	30,000	28.85	865,500.00	
INTERPUBLIC GROUP	85,000	33.42	2,840,700.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	27,100	74.88	2,029,248.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	34,000	39.14	1,330,760.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	17,000	39.24	667,080.00	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	86,000	18.31	1,574,660.00	
OMNICOM GROUP	43,100	80.50	3,469,550.00	
PARAMOUNT GLOBAL	129,000	16.66	2,149,140.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	171,000	5.84	998,640.00	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	93,300	44.88	4,187,304.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	168,400	75.95	12,789,980.00	
DISNEY (WALT) CO	389,900	88.01	34,315,099.00	
ELECTRONIC ARTS	60,100	121.51	7,302,751.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	40,400	59.89	2,419,556.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	35,800	70.69	2,530,702.00	
NETFLIX INC	95,100	294.96	28,051,171.50	
ROBLOX CORP -CLASS A	73,000	26.75	1,952,750.00	
ROKU INC	24,200	41.35	1,000,670.00	
	78,100	49.92	3,898,752.00	

	SEA LTD-ADR				
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	36,500	99.83	3,643,795.00	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	497,000	9.17	4,557,490.00	
	ALPHABET INC-CL A	1,282,500	89.23	114,437,475.00	
	ALPHABET INC-CL C	1,186,400	89.81	106,550,584.00	
	MATCH GROUP INC	58,300	40.58	2,365,814.00	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	487,800	118.04	57,579,912.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	121,000	24.53	2,968,130.00	
	SNAP INC-A	248,000	8.58	2,127,840.00	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	54,000	28.80	1,555,200.00	
	小計 銘柄数：600			7,087,951,726.46	
				(937,948,651,962)	
	組入時価比率：70.2%			72.6%	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	148,000	18.55	2,745,400.00	
	CAMECO CORP	94,000	30.48	2,865,120.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	239,500	75.87	18,170,865.00	
	CENOVUS ENERGY INC	294,000	26.24	7,714,560.00	
	ENBRIDGE INC	435,000	53.69	23,355,150.00	
	IMPERIAL OIL	50,000	65.57	3,278,500.00	
	KEYERA CORP	48,000	29.40	1,411,200.00	
	PARKLAND CORP	36,000	29.61	1,065,960.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	120,000	46.04	5,524,800.00	
	SUNCOR ENERGY INC	295,000	42.81	12,628,950.00	
	TC ENERGY CORP	218,000	55.35	12,066,300.00	
	TOURMALINE OIL CORP	68,200	71.40	4,869,480.00	
	NUTRIEN LTD	115,500	100.64	11,623,920.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	32,000	58.36	1,867,520.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	99,200	71.50	7,092,800.00	
	BARRICK GOLD	383,000	23.61	9,042,630.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	128,000	27.85	3,564,800.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	40,500	184.65	7,478,325.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	122,000	10.43	1,272,460.00	
	KINROSS GOLD CORP	300,000	5.68	1,704,000.00	
	LUNDIN MINING CORP	137,000	8.40	1,150,800.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	43,000	22.88	983,840.00	

TECK RESOURCES LTD-CLS B	104,000	52.00	5,408,000.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	96,000	54.61	5,242,560.00	
WEST FRASER TIMBER	14,200	96.34	1,368,028.00	
CAE INC	67,000	25.97	1,739,990.00	
WSP GLOBAL INC	26,000	155.92	4,053,920.00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	17,000	97.45	1,656,650.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	38,000	38.32	1,456,160.00	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	23,700	76.29	1,808,073.00	
AIR CANADA	32,000	19.17	613,440.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	125,400	163.69	20,526,726.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	200,000	102.59	20,518,000.00	
TFI INTERNATIONAL INC	17,000	137.96	2,345,320.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	58,700	75.37	4,424,219.00	
BRP INC/CA- SUB VOTING	7,400	102.50	758,500.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	37,000	36.78	1,360,860.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	62,500	88.34	5,521,250.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	11,500	142.19	1,635,185.00	
DOLLARAMA INC	59,000	80.00	4,720,000.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	174,000	59.73	10,393,020.00	
EMPIRE CO LTD A	32,000	36.21	1,158,720.00	
LOBLAW COMPANIES	35,600	123.66	4,402,296.00	
METRO INC	49,700	76.50	3,802,050.00	
WESTON(GEORGE)LTD	15,700	174.72	2,743,104.00	
SAPUTO INC	57,000	33.35	1,900,950.00	
BANK OF MONTREAL	143,400	122.69	17,593,746.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	256,000	66.38	16,993,280.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	195,000	54.72	10,670,400.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	71,200	92.17	6,562,504.00	
ROYAL BANK OF CANADA	297,700	128.28	38,188,956.00	
TORONTO DOMINION BANK	389,000	88.33	34,360,370.00	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	83,000	18.53	1,537,990.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,940	813.11	4,016,763.40	
GREAT-WEST LIFECO INC	57,000	31.10	1,772,700.00	
IA FINANCIAL CORP INC	24,100	78.80	1,899,080.00	

	INTACT FINANCIAL CORP	37,200	198.38	7,379,736.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	405,000	24.29	9,837,450.00	
	POWER CORPORATION OF CANADA	116,000	32.73	3,796,680.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	124,000	63.14	7,829,360.00	
	CGI INC	46,300	116.78	5,406,914.00	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	14,000	32.91	460,740.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	254,000	45.83	11,640,820.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	4,330	2,127.37	9,211,512.10	
	DESCARTES SYSTEMS GRP(THE)	17,800	93.17	1,658,426.00	
	OPEN TEXT CORP	56,000	39.39	2,205,840.00	
	BCE INC	14,400	60.02	864,288.00	
	TELUS CORP	98,600	26.74	2,636,564.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	75,000	61.33	4,599,750.00	
	EMERA INC	56,000	52.33	2,930,480.00	
	FORTIS INC	101,000	55.09	5,564,090.00	
	HYDRO ONE LTD	70,000	36.65	2,565,500.00	
	ALTAGAS LTD	60,000	23.54	1,412,400.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	139,000	9.17	1,274,630.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	27,000	37.07	1,000,890.00	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	74,500	38.13	2,840,685.00	
	BROOKFIELD CORP	298,000	43.12	12,849,760.00	
	IGM FINANCIAL INC	15,000	37.87	568,050.00	
	ONEX CORPORATION	16,900	63.87	1,079,403.00	
	TMX GROUP LTD	11,300	137.31	1,551,603.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	29,000	38.23	1,108,670.00	
	NORTHLAND POWER INC	53,000	37.67	1,996,510.00	
	THOMSON REUTERS CORP	36,500	154.02	5,621,730.00	
	FIRSTSERVICE CORP	8,500	166.30	1,413,550.00	
	QUEBECOR INC-CL B	34,000	28.72	976,480.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	104,000	35.75	3,718,000.00	
小計	銘柄数：86			500,630,701.50	
				(48,626,260,036)	
	組入時価比率：3.6%				3.8%
ユ-口	TENARIS SA	101,000	16.58	1,674,580.00	
	ENI SPA	532,000	13.47	7,169,232.00	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	109,000	12.52	1,365,225.00
NESTE OYJ	91,000	43.89	3,993,990.00
OMV AG	32,000	49.23	1,575,360.00
REPSOL SA	302,000	14.82	4,475,640.00
TOTALENERGIES SE	532,200	59.21	31,511,562.00
AIR LIQUIDE SA	112,500	133.70	15,041,250.00
AKZO NOBEL	39,400	63.40	2,497,960.00
ARKEMA	13,600	84.82	1,153,552.00
BASF SE	195,000	46.23	9,015,825.00
COVESTRO AG	43,000	36.33	1,562,190.00
EVONIK INDUSTRIES AG	48,000	17.95	861,840.00
KONINKLIJKE DSM NV	37,400	116.50	4,357,100.00
OCI	21,000	34.38	721,980.00
SOLVAY SA	16,400	95.68	1,569,152.00
SYMRISE AG	28,900	102.50	2,962,250.00
UMICORE	44,000	34.75	1,529,000.00
CRH PLC	161,000	37.31	6,006,910.00
HEIDELBERGCEMENT AG	30,600	53.76	1,645,056.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	51,000	34.80	1,774,800.00
ARCELORMITTAL	111,000	25.07	2,783,325.00
VOESTALPINE AG	24,000	24.90	597,600.00
STORA ENSO OYJ-R	119,000	13.42	1,597,575.00
UPM-KYMMENE OYJ	113,000	35.65	4,028,450.00
AIRBUS SE	127,100	111.74	14,202,154.00
DASSAULT AVIATION SA	5,000	160.70	803,500.00
MTU AERO ENGINES AG	11,000	203.70	2,240,700.00
RHEINMETALL AG	9,400	186.75	1,755,450.00
SAFRAN SA	72,500	117.56	8,523,100.00
THALES SA	23,500	118.60	2,787,100.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	107,000	46.14	4,936,980.00
KINGSPAN GROUP PLC	33,400	50.60	1,690,040.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	49,245	26.94	1,326,660.30
BOUYGUES	46,000	28.48	1,310,080.00
EIFFAGE SA	18,100	93.92	1,699,952.00
FERROVIAL SA	105,847	24.64	2,608,070.08

VINCI	114,900	94.19	10,822,431.00	
LEGRAND SA	56,800	75.58	4,292,944.00	
PRYSMIAN SPA	54,000	35.20	1,900,800.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	115,700	131.18	15,177,526.00	
SIEMENS ENERGY AG	89,000	17.35	1,544,595.00	
SIEMENS AG	163,600	128.54	21,029,144.00	
ALSTOM	71,000	23.00	1,633,000.00	
CNH INDUSTRIAL NV	221,000	15.13	3,343,730.00	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	97,000	29.51	2,862,955.00	
GEA GROUP AG	34,000	37.98	1,291,320.00	
KNORR-BREMSE AG	15,200	51.40	781,280.00	
KONE OYJ	71,000	48.21	3,422,910.00	
RATIONAL AG	1,050	550.50	578,025.00	
WARTSILA OYJ	101,000	7.90	797,900.00	
BRENNTAG SE	34,100	59.10	2,015,310.00	
IMCD NV	12,600	136.90	1,724,940.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	212,000	35.05	7,431,660.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	137,000	8.10	1,110,111.00	
ADP	6,100	125.55	765,855.00	
AENA SME SA	15,800	120.10	1,897,580.00	
GETLINK	93,000	15.24	1,417,320.00	
CONTINENTAL AG	23,200	56.16	1,302,912.00	
MICHELIN (CGDE)	147,000	26.60	3,910,935.00	
VALEO SA	45,000	16.72	752,625.00	
BAYER MOTOREN WERK	71,700	83.50	5,986,950.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	12,500	79.45	993,125.00	
DR ING HC F PORSCHE AG	23,700	92.12	2,183,244.00	
FERRARI NV	27,100	198.70	5,384,770.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	171,500	61.35	10,521,525.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	31,900	50.46	1,609,674.00	
RENAULT SA	40,000	31.39	1,255,800.00	
STELLANTIS NV	472,000	13.19	6,225,680.00	
VOLKSWAGEN AG	6,300	148.60	936,180.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	40,000	115.66	4,626,400.00	
SEB SA	5,400	78.25	422,550.00	

ADIDAS AG	37,000	125.86	4,656,820.00
HERMES INTERNATIONAL	6,830	1,443.00	9,855,690.00
KERING SA	15,900	471.95	7,504,005.00
LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	59,200	673.80	39,888,960.00
MONCLER SPA	45,500	48.10	2,188,550.00
PUMA SE	21,200	54.84	1,162,608.00
ACCOR SA	39,000	23.72	925,080.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	36,300	130.80	4,748,040.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	24,000	37.85	908,400.00
SODEXO	18,200	89.70	1,632,540.00
D' IETEREN GROUP	5,700	177.70	1,012,890.00
DELIVERY HERO SE	34,000	44.85	1,524,900.00
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	43,000	19.46	836,952.00
PROSUS NV	177,300	63.56	11,269,188.00
ZALANDO SE	45,000	32.66	1,469,700.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	236,000	24.94	5,885,840.00
CARREFOUR SUPERMARCHÉ	130,000	16.04	2,085,850.00
HELLOFRESH SE	31,800	20.97	666,846.00
JERONIMO MARTINS	64,000	20.62	1,319,680.00
KESKO OYJ-B SHS	58,000	20.71	1,201,180.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	221,000	27.78	6,140,485.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	184,100	56.78	10,453,198.00
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	107,000	9.58	1,025,702.00
HEINEKEN HOLDING NV	22,000	73.35	1,613,700.00
HEINEKEN NV	54,800	89.16	4,885,968.00
PERNOD RICARD SA	44,500	184.95	8,230,275.00
REMY COINTREAU	4,900	159.90	783,510.00
DANONE	136,500	49.96	6,820,222.50
JDE PEET'S BV	21,000	27.44	576,240.00
KERRY GROUP PLC-A	34,300	84.10	2,884,630.00
HENKEL AG & CO KGAA	22,900	61.00	1,396,900.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	38,300	65.96	2,526,268.00
BEIERSDORF AG	21,400	106.40	2,276,960.00
LOREAL-ORD	51,500	333.25	17,162,375.00
BIOMERIEUX	8,800	96.72	851,136.00

CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	8,600	116.30	1,000,180.00
DIASORIN ITALIA SPA	4,800	127.90	613,920.00
ESSILORLUXOTTICA	62,600	170.05	10,645,130.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	185,000	14.07	2,603,320.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	61,400	45.64	2,802,296.00
AMPLIFON SPA	24,000	26.90	645,600.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	45,000	29.88	1,344,600.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	92,000	26.16	2,406,720.00
ARGENX SE	12,000	355.50	4,266,000.00
GRIFOLS SA	63,000	10.90	687,015.00
BAYER AG-REG	211,700	48.62	10,292,854.00
IPSEN	7,300	98.00	715,400.00
MERCK KGAA	27,400	179.60	4,921,040.00
ORION OYJ	24,200	53.22	1,287,924.00
RECORDATI SPA	24,000	39.12	938,880.00
SANOFI	244,000	90.98	22,199,120.00
UCB SA	26,300	74.66	1,963,558.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	82,000	13.21	1,083,630.00
AIB GROUP PLC	230,000	3.67	845,020.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,311,000	5.66	7,428,126.00
BANCO SANTANDER SA	3,620,000	2.79	10,117,900.00
BANK OF IRELAND GROUP PLC	225,000	8.82	1,985,850.00
BNP PARIBAS	237,300	53.80	12,766,740.00
CAIXABANK	950,000	3.66	3,481,750.00
COMMERZBANK AG	236,000	8.95	2,112,672.00
CREDIT AGRICOLE SA	265,000	9.76	2,587,725.00
ERSTE GROUP BANK AG	76,000	29.81	2,265,560.00
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	129,000	15.27	1,969,830.00
ING GROEP NV	812,000	11.52	9,360,736.00
INTESA SANPAOLO	3,580,000	2.09	7,491,150.00
KBC GROEP NV	53,000	59.94	3,176,820.00
MEDIOBANCA S.P.A.	124,000	9.03	1,119,968.00
SOCIETE GENERALE	175,000	23.57	4,124,750.00
UNICREDIT SPA	409,000	13.28	5,433,156.00
EURAZEO SE	7,800	58.80	458,640.00

EXOR NV	24,300	68.72	1,669,896.00
GROUPE BRUXELLES LAM	21,400	75.10	1,607,140.00
SOFINA SA	2,900	204.40	592,760.00
WENDEL	6,000	87.95	527,700.00
AEGON NV	370,000	4.88	1,807,080.00
AGEAS	36,000	41.96	1,510,560.00
ALLIANZ SE-REG	87,700	202.20	17,732,940.00
ASSICURAZIONI GENERALI	242,000	16.80	4,065,600.00
AXA SA	400,000	26.43	10,572,000.00
HANNOVER RUECK SE	13,000	185.70	2,414,100.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	30,000	303.50	9,105,000.00
NN GROUP NV	59,000	41.11	2,425,490.00
POSTE ITALIANE SPA	120,000	9.22	1,106,400.00
SAMPO OYJ-A SHS	102,000	49.73	5,072,460.00
ADYEN NV	4,610	1,300.00	5,993,000.00
AMADEUS IT GROUP SA	96,200	49.22	4,734,964.00
BECHTLE AG	15,700	32.91	516,687.00
CAPGEMINI SA	34,600	155.60	5,383,760.00
EDENRED	53,500	50.86	2,721,010.00
NEXI SPA	130,000	7.42	965,120.00
WORLDLINE SA	49,000	36.94	1,810,060.00
DASSAULT SYSTEMES SE	141,000	33.30	4,696,005.00
NEMETSCHEK SE	11,000	47.36	520,960.00
SAP SE	223,400	97.38	21,754,692.00
NOKIA OYJ	1,140,000	4.36	4,974,390.00
ASM INTERNATIONAL NV	10,300	241.25	2,484,875.00
ASML HOLDING NV	86,940	516.90	44,939,286.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	282,000	28.69	8,090,580.00
STMICROELECTRONICS NV	146,000	33.60	4,906,330.00
CELLNEX TELECOM SA	118,000	31.04	3,662,720.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	697,000	18.86	13,150,996.00
ELISA OYJ	31,700	49.87	1,580,879.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	72,000	9.40	677,088.00
KONINKLIJKE KPN NV	730,000	2.95	2,154,960.00
ORANGE SA	435,000	9.35	4,071,165.00

TELECOM ITALIA SPA	1,930,000	0.21	421,705.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	210,000	2.29	482,580.00	
TELEFONICA SA	1,093,000	3.38	3,697,619.00	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	18.99	319,032.00	
ACCIONA S.A.	4,800	172.20	826,560.00	
ELECTRICITE DE FRANCE	128,000	12.00	1,536,000.00	
ELIA GROUP SA/NV	6,626	134.20	889,209.20	
ENDESA S.A.	65,000	17.70	1,150,500.00	
ENEL SPA	1,730,000	5.10	8,824,730.00	
ENERGIAS DE PORTUGAL	588,000	4.72	2,775,360.00	
FORTUM OYJ	100,000	15.88	1,588,000.00	
IBERDROLA SA	1,290,000	10.88	14,035,200.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	89,000	16.72	1,488,525.00	
TERNA SPA	301,000	7.14	2,151,548.00	
VERBUND AG	14,500	80.30	1,164,350.00	
ENAGAS SA	48,000	15.98	767,040.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	32,000	25.03	800,960.00	
SNAM SPA	420,000	4.64	1,951,740.00	
E.ON SE	488,000	9.11	4,448,608.00	
ENGIE	396,000	13.58	5,378,472.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	141,000	23.93	3,374,130.00	
AMUNDI SA	12,800	52.85	676,480.00	
DEUTSCHE BANK AG-REG	446,000	10.70	4,774,876.00	
DEUTSCHE BOERSE AG	40,400	163.45	6,603,380.00	
EURONEXT NV	18,000	70.12	1,262,160.00	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES S A	14,000	36.24	507,360.00	
EDP RENOVAVEIS SA	58,000	20.94	1,214,520.00	
RWE AG	138,000	41.51	5,728,380.00	
EUROFINS SCIENTIFIC SE	27,700	66.18	1,833,186.00	
QIAGEN N.V.	47,900	46.35	2,220,165.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	5,100	348.00	1,774,800.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	6,000	301.40	1,808,400.00	
BUREAU VERITAS SA	61,000	24.59	1,499,990.00	
RANDSTAD NV	25,500	57.64	1,469,820.00	

	TELEPERFORMANCE	12,500	220.70	2,758,750.00	
	WOLTERS KLUWER	56,500	99.56	5,625,140.00	
	AROUNDTOWN SA	206,000	2.14	441,458.00	
	LEG IMMOBILIEN SE	17,000	60.48	1,028,160.00	
	VONOVIA SE	149,000	21.83	3,252,670.00	
	PUBLICIS GROUPE	49,800	59.80	2,978,040.00	
	VIVENDI SE	145,000	8.94	1,296,300.00	
	BOLLORE SE	202,000	5.20	1,051,410.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	17,300	26.57	459,661.00	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	154,000	22.34	3,440,360.00	
	SCOUT24 SE	17,900	46.85	838,615.00	
	小計銘柄数：222			915,438,367.08	
				(128,417,694,133)	
	組入時価比率：9.6%			9.9%	
英ポンド	BP PLC	4,025,000	4.78	19,275,725.00	
	SHELL PLC-NEW	1,554,000	23.66	36,775,410.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	28,700	66.46	1,907,402.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	40,000	21.06	842,400.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	272,000	32.49	8,838,640.00	
	ANTOFAGASTA PLC	89,000	15.44	1,374,160.00	
	GLENCORE PLC	2,086,000	5.58	11,639,880.00	
	RIO TINTO PLC-REG	241,700	58.08	14,037,936.00	
	MONDI PLC	101,000	14.18	1,432,180.00	
	BAE SYSTEMS PLC	677,000	8.55	5,788,350.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,850,000	0.91	1,696,080.00	
	DCC PLC	21,200	40.67	862,204.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	870,000	1.31	1,140,135.00	
	SMITHS GROUP PLC	80,000	15.90	1,272,400.00	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	15,500	106.80	1,655,400.00	
	ASHTREAD GROUP PLC	94,600	47.21	4,466,066.00	
	BUNZLE	71,000	27.78	1,972,380.00	
	RENTOKIL INTIAL PLC	523,000	5.14	2,691,358.00	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	207,000	4.03	835,659.00	
	PERSIMMON PLC	64,000	12.37	792,000.00	
	TAYLOR WIMPEY PLC	710,000	1.03	732,365.00	
		24,300	38.36	932,148.00	

THE BERKELEY GRP HOLDINGS				
BURBERRY GROUP PLC	82,000	20.04	1,643,280.00	
COMPASS GROUP PLC	381,000	19.32	7,360,920.00	
ENTAIN PLC	121,000	13.10	1,585,705.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	38,600	47.25	1,823,850.00	
WHITBREAD PLC	41,000	26.24	1,075,840.00	
NEXT PLC	28,600	56.06	1,603,316.00	
JD SPORTS FASHION PLC	610,000	1.19	729,255.00	
KINGFISHER PLC	390,000	2.32	905,190.00	
OCADO GROUP PLC	122,000	6.26	764,452.00	
SAINSBURY	410,000	2.19	899,130.00	
TESCO PLC	1,610,000	2.26	3,649,870.00	
COCA-COLA HBC AG-DI	46,000	19.50	897,230.00	
DIAGEO PLC	485,000	36.47	17,690,375.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	79,000	15.87	1,253,730.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	456,000	33.16	15,123,240.00	
IMPERIAL BRANDS PLC	196,000	20.82	4,080,720.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	153,000	57.10	8,736,300.00	
HALEON PLC	1,080,000	3.24	3,500,280.00	
UNILEVER PLC	544,400	42.14	22,941,016.00	
SMITH & NEPHEW PLC	182,000	11.05	2,012,010.00	
NMC HEALTH PLC	13,300	0.00	6.65	
ASTRAZENECA PLC	331,380	112.38	37,240,484.40	
GSK PLC	875,000	14.52	12,712,000.00	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	37,000	15.45	571,835.00	
BARCLAYS PLC	3,450,000	1.57	5,442,030.00	
HSBC HOLDINGS PLC	4,271,000	5.10	21,794,913.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	14,620,000	0.46	6,729,586.00	
NATWEST GROUP PLC	1,120,000	2.64	2,962,400.00	
STANDARD CHARTERED PLC	534,000	6.25	3,337,500.00	
M&G PLC	500,000	1.87	935,750.00	
ADMIRAL GROUP PLC	35,000	21.06	737,100.00	
AVIVA PLC	610,000	4.44	2,708,400.00	
LEGAL & GENERAL	1,270,000	2.50	3,182,620.00	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	170,000	6.11	1,040,060.00	

	PRUDENTIAL PLC	585,000	11.16	6,531,525.00	
	AVEVA GROUP PLC	26,000	32.20	837,200.00	
	SAGE GROUP PLC (THE)	220,000	7.45	1,640,760.00	
	HALMA PLC	83,000	19.90	1,652,115.00	
	BT GROUP PLC	1,510,000	1.14	1,721,400.00	
	VODAFONE GROUP PLC	5,570,000	0.83	4,673,230.00	
	SSE PLC	232,000	17.07	3,960,240.00	
	NATIONAL GRID PLC	783,000	9.89	7,748,568.00	
	SEVERN TRENT PLC	53,000	26.52	1,405,560.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	151,000	9.86	1,490,068.00	
	3I GROUP PLC	213,000	13.15	2,802,015.00	
	ABRDN PLC	420,000	1.86	783,300.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	82,000	8.50	697,492.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	69,500	71.30	4,955,350.00	
	SCHRODERS PLC	141,176	4.38	618,492.05	
	ST JAMES S PLACE PLC	118,000	10.91	1,287,380.00	
	EXPERIAN PLC	198,000	28.07	5,557,860.00	
	INTERTEK GROUP PLC	35,000	39.98	1,399,300.00	
	RELX PLC	413,000	22.99	9,494,870.00	
	INFORMA PLC	300,000	6.15	1,845,600.00	
	PEARSON	143,000	9.37	1,340,768.00	
	WPP PLC	235,000	8.16	1,919,010.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	195,000	5.18	1,010,490.00	
小計	銘柄数：79			384,003,265.10	
				(61,240,840,718)	
	組入時価比率：4.6%			4.7%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	41,000	14.84	608,440.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,370	629.00	861,730.00	
	GIVAUDAN-REG	1,970	2,822.00	5,559,340.00	
	SIKA AG-REG	30,800	223.10	6,871,480.00	
	HOLCIM LTD	118,000	48.09	5,674,620.00	
	SIG GROUP AG	66,000	20.18	1,331,880.00	
	GEBERIT AG-REG	7,600	435.50	3,309,800.00	
	ABB LTD	339,000	28.17	9,549,630.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	4,900	167.00	818,300.00	
		8,500	174.35	1,481,975.00	

SCHINDLER HOLDING-PART CERT				
VAT GROUP AG	6,000	251.80	1,510,800.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	11,700	214.10	2,504,970.00	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	111,400	116.80	13,011,520.00	
THE SWATCH GROUP AG-B	6,200	259.70	1,610,140.00	
THE SWATCH GROUP AG-REG	10,500	47.56	499,380.00	
BARRY CALLEBAUT AG	710	1,825.00	1,295,750.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	227	9,520.00	2,161,040.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	22	95,000.00	2,090,000.00	
NESTLE SA-REG	588,200	107.82	63,419,724.00	
ALCON INC	107,300	63.26	6,787,798.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	11,600	216.60	2,512,560.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	24,000	103.95	2,494,800.00	
NOVARTIS AG-REG	462,700	84.72	39,199,944.00	
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	150,300	295.20	44,368,560.00	
ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	5,400	366.80	1,980,720.00	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	6,500	89.55	582,075.00	
BALOISE HOLDING AG	9,900	144.30	1,428,570.00	
SWISS LIFE HOLDING AG	6,800	479.90	3,263,320.00	
SWISS RE LTD	64,900	87.46	5,676,154.00	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	32,400	447.10	14,486,040.00	
TEMENOS AG-REG	13,700	50.00	685,000.00	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	37,600	57.16	2,149,216.00	
SWISSCOM AG-REG	5,690	508.20	2,891,658.00	
BKW AG	4,600	126.80	583,280.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	789,999	2.84	2,248,337.15	
JULIUS BAER GROUP LTD	46,300	53.70	2,486,310.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	4,820	821.40	3,959,148.00	
UBS GROUP AG	721,000	17.30	12,473,300.00	
BACHEM HOLDING AG-REG B	7,900	79.80	630,420.00	
LONZA AG-REG	16,000	453.90	7,262,400.00	
ADECCO GROUP AG-REG	33,000	30.79	1,016,070.00	
SGS SA-REG	1,350	2,145.00	2,895,750.00	
SWISS PRIME SITE-REG	15,300	80.25	1,227,825.00	
小計 銘柄数 : 43			287,459,774.15	

				(40,715,802,410)	
	組入時価比率：3.0%			3.1%	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	59,000	396.70	23,405,300.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	19,000	424.30	8,061,700.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	123,000	135.10	16,617,300.00	
	ASSA ABLOY AB-B	218,000	225.10	49,071,800.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	318,000	98.54	31,335,720.00	
	SKANSKA AB-B SHS	77,000	165.20	12,720,400.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	33,000	194.60	6,421,800.00	
	LIFCO AB-B SHS	52,000	174.25	9,061,000.00	
	ALFA LAVAL AB	63,000	301.80	19,013,400.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	577,000	124.02	71,559,540.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	334,000	111.22	37,147,480.00	
	EPIROC AB - A	141,000	191.75	27,036,750.00	
	EPIROC AB - B	79,000	169.65	13,402,350.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	94,000	73.70	6,927,800.00	
	INDUTRADE AB	55,000	210.60	11,583,000.00	
	SANDVIK AB	229,000	189.60	43,418,400.00	
	SKF AB-B SHARES	78,000	159.75	12,460,500.00	
	VOLVO AB-A SHS	40,000	199.50	7,980,000.00	
	VOLVO AB-B SHS	319,000	189.50	60,450,500.00	
	SECURITAS AB-B SHS	110,857	86.58	9,597,999.06	
	VOLVO CAR AB-B	120,000	46.83	5,620,200.00	
	ELECTROLUX AB-B	41,000	140.36	5,754,760.00	
	EVOLUTION AB	38,700	1,007.20	38,978,640.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	162,000	112.50	18,225,000.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	132,000	275.60	36,379,200.00	
	GETINGE AB-B SHS	45,000	211.80	9,531,000.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,000	219.30	7,894,800.00	
	NORDEA BANK ABP	725,000	112.46	81,533,500.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	349,000	120.55	42,071,950.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	320,000	105.45	33,744,000.00	
	SWEDBANK AB	197,000	178.50	35,164,500.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	24,092	258.40	6,225,372.80	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	32,000	257.50	8,240,000.00		

	INVESTOR AB-A SHS	105,000	194.50	20,422,500.00	
	INVESTOR AB-B SHS	391,000	189.44	74,071,040.00	
	KINNEVIK AB - B	56,000	144.25	8,078,000.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	15,500	448.30	6,948,650.00	
	ERICSSON LM-B	620,000	61.69	38,247,800.00	
	HEXAGON AB-B SHS	413,000	109.80	45,347,400.00	
	TELIA CO AB	580,000	26.80	15,544,000.00	
	TELE 2 AB-B SHS	116,000	85.28	9,892,480.00	
	EQT AB	68,000	218.40	14,851,200.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	141,000	49.27	6,947,070.00	
	SAGAX AB-B	40,000	238.60	9,544,000.00	
	EMBRACER GROUP AB	134,000	50.33	6,744,220.00	
小計	銘柄数：45			1,063,274,021.86	
				(13,365,354,454)	
	組入時価比率：1.0%			1.0%	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	64,986	309.60	20,119,665.60	
	EQUINOR ASA	206,000	364.00	74,984,000.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	37,000	430.70	15,935,900.00	
	NORSK HYDRO	291,000	73.14	21,283,740.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	21,000	412.80	8,668,800.00	
	MOWI ASA	84,000	165.25	13,881,000.00	
	ORKLA ASA	153,000	70.44	10,777,320.00	
	SALMAR ASA	16,000	378.80	6,060,800.00	
	DNB BANK ASA	194,000	193.40	37,519,600.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	40,000	191.90	7,676,000.00	
	TELENOR ASA	146,000	89.86	13,119,560.00	
	ADEVINTA ASA	63,000	65.35	4,117,050.00	
小計	銘柄数：12			234,143,435.60	
				(3,137,522,037)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	23,500	498.00	11,703,000.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	44,500	345.60	15,379,200.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	1,700	1,595.00	2,711,500.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	212,000	198.24	42,026,880.00	

	DSV A/S	40,600	1,088.00	44,172,800.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	620	15,640.00	9,696,800.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,090	15,895.00	17,325,550.00	
	PANDORA A/S	20,000	476.50	9,530,000.00	
	CARLSBERG B	20,600	922.20	18,997,320.00	
	COLOPLAST-B	25,900	814.00	21,082,600.00	
	DEMANT A/S	20,100	187.10	3,760,710.00	
	GENMAB A/S	13,900	3,008.00	41,811,200.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	354,100	934.50	330,906,450.00	
	DANSKE BANK AS	148,000	137.45	20,342,600.00	
	TRYG A/S	76,000	164.55	12,505,800.00	
	ORSTED A/S	41,000	624.00	25,584,000.00	
小計	銘柄数：16			627,536,410.00	
				(11,841,612,056)	
	組入時価比率：0.9%			0.9%	
豪ドル	AMPOL LTD	49,000	28.29	1,386,210.00	
	SANTOS LTD.	672,000	7.20	4,838,400.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	48,000	27.89	1,338,720.00	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	403,000	35.86	14,451,580.00	
	ORICA LTD	99,000	15.44	1,528,560.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	92,000	26.20	2,410,400.00	
	BHP GROUP LIMITED	1,084,000	46.16	50,037,440.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	104,000	16.85	1,752,400.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	359,000	20.57	7,384,630.00	
	IGO LTD	150,000	13.79	2,068,500.00	
	MINERAL RESOURCES LTD	37,500	79.88	2,995,500.00	
	NEWCREST MINING	191,000	20.78	3,968,980.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	257,000	11.06	2,842,420.00	
	PILBARA MINERALS LTD	540,000	3.80	2,052,000.00	
	RIO TINTO LTD	79,300	115.43	9,153,599.00	
	SOUTH32 LTD	1,010,000	4.07	4,110,700.00	
	REECE LTD	49,000	13.93	682,570.00	
	BRAMBLES LTD	295,000	12.19	3,596,050.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	170,000	6.11	1,038,700.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	380,000	3.78	1,436,400.00	

	TRANSURBAN GROUP	666,000	13.64	9,084,240.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	126,000	30.75	3,874,500.00	
	LOTTERY CORP LTD/THE	480,000	4.51	2,164,800.00	
	WESFARMERS LIMITED	243,000	46.06	11,192,580.00	
	COLES GROUP LTD	293,000	16.90	4,951,700.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	284,000	6.45	1,831,800.00	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	263,000	34.06	8,957,780.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	156,000	13.48	2,102,880.00	
	COCHLEAR LTD	14,100	202.00	2,848,200.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	41,000	64.45	2,642,450.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	99,000	30.18	2,987,820.00	
	CSL LIMITED	102,700	289.00	29,680,300.00	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	640,000	24.07	15,404,800.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	363,900	104.82	38,143,998.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	673,000	30.38	20,445,740.00	
	WESTPAC BANKING CORP	754,000	23.50	17,719,000.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	540,000	4.75	2,565,000.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	590,000	2.95	1,740,500.00	
	QBE INSURANCE	312,000	13.21	4,121,520.00	
	SUNCORP GROUP LTD	268,000	12.00	3,216,000.00	
	COMPUTERSHARE LTD	113,000	26.31	2,973,030.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	33,000	52.32	1,726,560.00	
	XERO LIMITED	28,300	70.05	1,982,415.00	
	TELSTRA GROUP LTD	850,000	4.04	3,434,000.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	370,000	7.73	2,860,100.00	
	APA GROUP	257,000	11.11	2,855,270.00	
	ASX LTD	41,500	67.61	2,805,815.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	79,200	167.92	13,299,264.00	
	IDP EDUCATION LTD	46,000	27.14	1,248,440.00	
	REA GROUP LTD	10,400	110.62	1,150,448.00	
	SEEK LTD	70,000	20.85	1,459,500.00	
小計	銘柄数：51			340,544,209.00	
				(30,144,973,380)	
	組入時価比率：2.3%			2.3%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	270,000	8.12	2,193,750.00	

	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	127,000	22.05	2,800,350.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	380,000	5.43	2,065,300.00	
	MERCURY NZ LTD	137,000	5.64	772,680.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	300,000	5.08	1,524,000.00	
小計	銘柄数：5			9,356,080.00	
				(775,057,667)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	430,000	14.34	6,166,200.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	584,040	46.20	26,982,648.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	290,000	88.25	25,592,500.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	280,000	18.14	5,079,200.00	
	MTR CORP	340,000	40.90	13,906,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	466,000	51.15	23,835,900.00	
	SANDS CHINA LTD	512,000	25.00	12,800,000.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	350,000	24.70	8,645,000.00	
	WH GROUP LIMITED	1,759,806	4.52	7,954,323.12	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	780,000	26.40	20,592,000.00	
	HANG SENG BANK	161,000	128.00	20,608,000.00	
	AIA GROUP LTD	2,553,000	86.70	221,345,100.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	849,600	9.57	8,130,672.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	134,000	40.30	5,400,200.00	
	CLP HLDGS	339,000	55.55	18,831,450.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	310,000	42.20	13,082,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	2,410,383	7.36	17,740,418.88	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	260,000	340.00	88,400,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	441,040	48.25	21,280,180.00	
	ESR GROUP LTD	440,000	16.34	7,189,600.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	460,000	14.80	6,808,000.00	
	HENDERSON LAND	310,443	26.45	8,211,217.35	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	309,916	21.90	6,787,160.40	
	SINO LAND CO.LTD	730,000	9.70	7,081,000.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	308,000	105.90	32,617,200.00	
	SWIRE PACIFIC-A	104,000	68.40	7,113,600.00	

	SWIRE PROPERTIES LTD	230,000	19.70	4,531,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	350,000	45.05	15,767,500.00	
小計	銘柄数：28			662,478,069.75	
				(11,229,003,282)	
	組入時価比率：0.8%			0.9%	
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	310,000	3.39	1,050,900.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	21,000	28.70	602,700.00	
	KEPPEL CORP.	313,000	7.36	2,303,680.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	280,000	5.50	1,540,000.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,410,000	0.94	1,325,400.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	440,000	4.16	1,830,400.00	
	DBS GROUP HLDGS	384,000	34.04	13,071,360.00	
	OCBC-ORD	714,000	12.37	8,832,180.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	256,000	30.90	7,910,400.00	
	VENTURE CORP LTD	58,000	16.97	984,260.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,790,000	2.57	4,600,300.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	173,000	8.98	1,553,540.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	530,000	3.66	1,939,800.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	100,000	8.28	828,000.00	
	UOL GROUP LIMITED	87,000	6.66	579,420.00	
小計	銘柄数：15			48,952,340.00	
				(4,772,363,626)	
	組入時価比率：0.4%			0.4%	
新シケル	ICL GROUP LTD	157,000	25.88	4,063,160.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	5,900	585.40	3,453,860.00	
	BANK HAPOALIM BM	273,000	30.17	8,236,410.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	337,000	28.15	9,486,550.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	251,000	17.60	4,417,600.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	33,000	108.50	3,580,500.00	
	NICE LTD	13,800	674.20	9,303,960.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	22,000	153.00	3,366,000.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	470,000	5.82	2,737,750.00	
	AZRIELI GROUP	8,600	226.60	1,948,760.00	
小計	銘柄数：10			50,594,550.00	

				(1,910,748,715)	
		組入時価比率：0.1%		0.1%	
合計				1,294,125,884,476	(1,294,125,884,476)

(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(2022年12月26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	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	32,500	4,785,300.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	67,000	2,041,490.00	
		AMERICAN TOWER CORP	99,600	21,160,020.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	103,000	2,316,470.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	29,500	4,809,385.00	
		BOSTON PROPERTIES	30,700	2,099,880.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	21,500	2,393,165.00	
		CROWN CASTLE INC	93,200	12,766,536.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	61,800	6,233,766.00	
		EQUINIX INC	19,600	12,890,528.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	37,500	2,437,500.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	75,500	4,487,720.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,300	3,026,595.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	28,400	4,172,244.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	56,000	2,937,760.00	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	86,000	1,617,660.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	114,000	2,869,380.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	158,000	2,581,720.00	
		INVITATION HOMES INC	129,000	3,857,100.00	
		IRON MOUNTAIN INC	62,000	3,139,060.00	
		KIMCO REALTY CORP	133,000	2,828,910.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	135,000	1,505,250.00			
MID-AMERICA APARTMENT COMM	25,000	3,908,750.00			
PROLOGIS INC	197,412	22,429,951.44			

	PUBLIC STORAGE	34,100	9,657,461.00	
	REALTY INCOME CORP	132,400	8,527,884.00	
	REGENCY CENTERS CORP	31,900	1,998,216.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	23,400	6,610,734.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	69,300	8,171,163.00	
	SUN COMMUNITIES INC	27,000	3,860,730.00	
	UDR INC	68,000	2,635,000.00	
	VENTAS INC	87,000	3,957,630.00	
	VICI PROPERTIES INC	208,000	6,795,360.00	
	WELLTOWER INC	100,400	6,533,028.00	
	WEYERHAEUSER CO	159,000	5,006,910.00	
	WP CAREY INC	41,600	3,317,600.00	
小計	銘柄数：36	2,791,612	200,367,856.44	
			(26,514,678,442)	
	組入時価比率：2.0%		86.2%	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	21,000	891,870.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	28,000	589,680.00	
小計	銘柄数：2	49,000	1,481,550.00	
			(143,902,951)	
	組入時価比率：0.0%		0.5%	
ユーロ	COVIVIO	11,300	624,325.00	
	GECINA SA	9,600	909,120.00	
	KLEPIERRE	49,000	1,073,100.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,900	1,169,307.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	37,000	984,940.00	
小計	銘柄数：5	130,800	4,760,792.50	
			(667,843,971)	
	組入時価比率：0.0%		2.2%	
英ポンド	BRITISH LAND	183,000	721,203.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	152,000	939,664.00	
	SEGRO PLC	265,000	2,014,000.00	
小計	銘柄数：3	600,000	3,674,867.00	
			(586,067,789)	
	組入時価比率：0.0%		1.9%	
豪ドル	DEXUS/AU	219,000	1,762,950.00	
	GOODMAN GROUP	366,000	6,379,380.00	

		GPT GROUP	380,000	1,649,200.00	
		LENDLEASE GROUP	135,000	1,017,900.00	
		MIRVAC GROUP	890,000	1,949,100.00	
		SCENTRE GROUP	1,100,000	3,179,000.00	
		STOCKLAND TRUST GROUP	540,000	2,025,000.00	
		VICINITY CENTRES	800,000	1,596,000.00	
	小計	銘柄数：8	4,430,000	19,558,530.00	
				(1,731,321,075)	
		組入時価比率：0.1%			5.6%
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	2,382,900.00	
		LINK REIT	463,000	26,043,750.00	
	小計	銘柄数：2	933,000	28,426,650.00	
				(481,831,717)	
		組入時価比率：0.0%			1.6%
	シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	710,040	1,910,007.60	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,160,021	2,343,242.42	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	710,029	1,107,645.24	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	490,000	808,500.00	
	小計	銘柄数：4	3,070,090	6,169,395.26	
				(601,454,343)	
		組入時価比率：0.0%			2.0%
	合計			30,727,100,288	
				(30,727,100,288)	

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

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

(注3)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年12月26日現在		
	契約額等(円)		時価(円)
	うち1年超		
			評価損益(円)
市場取引			
株価指数先物取引			

買建	11,463,821,426	-	11,207,930,106	255,891,320
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,260,270,800	-	1,263,712,250	3,441,450
米ドル	935,851,000	-	939,414,490	3,563,490
カナダドル	77,604,000	-	77,683,840	79,840
ユーロ	84,207,600	-	84,163,560	44,040
英ポンド	111,876,100	-	111,612,060	264,040
香港ドル	50,732,100	-	50,838,300	106,200
売建	1,233,389,315	-	1,229,966,635	3,422,680
米ドル	948,679,875	-	945,901,385	2,778,490
カナダドル	63,271,000	-	63,118,120	152,880
ユーロ	133,653,600	-	133,251,940	401,660
英ポンド	87,784,840	-	87,695,190	89,650
合計	-	-	-	249,027,190

## (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)

(2022年12月26日現在)

## 資産の部

(2022年12月26日現在)

流動資産	
預金	1,864,792,193
コール・ローン	523,809,507
株式	72,202,479,650
投資信託受益証券	3,275,450,236
投資証券	101,639,187
派生商品評価勘定	1,046,011
未収入金	100,812
未収配当金	98,016,377
差入委託証拠金	1,132,247,211
流動資産合計	79,199,581,184
資産合計	79,199,581,184
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	58,639,393
未払金	48,684,131
未払解約金	22,958,158
未払利息	805
その他未払費用	2,905,200
流動負債合計	133,187,687
負債合計	133,187,687
純資産の部	
元本等	
元本	53,050,013,489
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	26,016,380,008
元本等合計	79,066,393,497
純資産合計	79,066,393,497
負債純資産合計	79,199,581,184

## 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>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年12月26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	1.4904円
(10,000口当たり純資産額)	(14,904円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

<p>自 2021年12月28日</p> <p>至 2022年12月26日</p>
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、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>

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

2022年12月26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

2022年12月26日現在

期首	2021年12月28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	43,244,709,121円
同期中における追加設定元本額	14,746,096,597円
同期中における一部解約元本額	4,940,792,229円
期末元本額	53,050,013,489円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	19,448,089円
野村資産設計ファンド2020	20,854,817円
野村資産設計ファンド2025	34,147,777円
野村資産設計ファンド2030	53,638,622円
野村資産設計ファンド2035	50,418,143円
野村資産設計ファンド2040	90,389,139円
野村資産設計ファンド2045	19,574,447円
野村インデックスファンド・新興国株式	3,745,184,273円
ネクストコア	2,441,227円

野村インデックスファンド・海外5資産バランス	555,794,427円
野村資産設計ファンド2050	22,742,678円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	5,962,286円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	3,739,264円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	2,958,058円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	2,637,964円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,595,532円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,314,855円
インデックス・ブレンド(タイプ )	15,081,451円
インデックス・ブレンド(タイプ )	4,370,401円
インデックス・ブレンド(タイプ )	16,700,802円
野村つみたて外国株投信	5,350,537,688円
野村外国株(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	1,134,531,557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)	2,068,084,476円
世界6資産分散ファンド	117,965,347円
野村資産設計ファンド2060	17,687,548円
NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIエマージング・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	1,297,350,826円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	2,305,997,662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)	3,973,000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)	1,896,527,423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)	788,221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)	33,973,581,606円
野村DC運用戦略ファンド	76,113,848円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	5,458,820円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	21,427,509円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	20,274,310円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	15,092,693円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	11,326,322円
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	64,300,381円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1)株式(2022年12月26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	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO LTD	85,000	1.29	109,905.00	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	7,000	0.00	0.00	
		PJSC GAZPROM-ADR	456,300	0.00	0.00	
		PJSC LUKOIL	32,050	0.00	0.00	

ROSNEFT OJSC - GDR	83,900	0.00	0.00
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	103,000	0.00	0.00
TATNEFT-SPONSORED ADR	19,100	0.00	0.00
PHOSAGRO PJSC	4,007	0.00	0.00
PHOSAGRO PJSC-GDR	78	0.00	0.00
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	1	0.00	0.00
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	12,710	82.15	1,044,126.50
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	21,600	7.44	160,704.00
NOVOLIPETSK STEEL PJSC	103,000	0.00	0.00
PJSC ALROSA	176,000	0.00	0.00
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	48,600	0.00	0.00
POLYUS PJSC	2,355	0.00	0.00
SEVERSTAL-GDR REG S	15,800	0.00	0.00
SOUTHERN COPPER CORP	6,300	61.06	384,678.00
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	38,100	26.41	1,006,221.00
NIO INC ADR	123,700	10.97	1,356,989.00
H WORLD GROUP LTD-ADR	18,800	41.72	784,336.00
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	50,900	33.99	1,730,091.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	38,000	55.59	2,112,420.00
OZON HOLDINGS PLC - ADR	5,300	0.00	0.00
PINDUODUO INC ADR	45,830	84.03	3,851,094.90
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	41,400	13.48	558,072.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	31,300	0.00	0.00
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	11,500	0.00	0.00
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	7,100	12.70	90,170.00
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	4,500	49.82	224,190.00
ZAI LAB LTD - ADR	8,770	30.78	269,940.60
BANCO DE CHILE-ADR	18,100	20.00	362,000.00
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	13,800	15.48	213,624.00
BANCOLOMBIA S.A. -SPONS ADR	10,030	28.00	280,840.00
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	260,036	1.20	313,083.34
CREDICORP LTD	6,350	134.67	855,154.50
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	811,000	0.00	0.00
STATE BANK OF INDIA-GDR	16,980	68.80	1,168,224.00
TCS GROUP HOLDING-REG S	9,300	0.00	0.00

	VTB BANK JSC	175,780,000	0.00	0.00	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	37,700	2.89	109,066.10	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	6,020	40.51	243,870.20	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	28,650	0.00	0.00	
	ENEL CHILE SA-ADR	42,900	2.23	95,667.00	
	INTER RAO UES PJSC	3,660,000	0.00	0.00	
	360 DIGITECH INC-ADR	12,100	19.26	233,046.00	
	LUFAX HOLDING LTD	67,100	2.01	134,871.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	133,000	0.00	0.00	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	39,000	8.87	345,930.00	
	KE HOLDINGS INC ADR	58,500	14.09	824,265.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	87,648	0.81	71,345.47	
	IQIYI INC-ADR	21,400	4.65	99,510.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	71,500	8.06	576,290.00	
	AUTOHOME INC-ADR	7,500	31.61	237,075.00	
	JOYY INC	4,250	31.94	135,745.00	
	KANZHUN LTD	15,100	19.20	289,920.00	
	VK CO LTD GDR	7,000	0.00	0.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	4,500	17.92	80,640.00	
	YANDEX NV-A	23,640	0.00	0.00	
	小計銘柄数：59			20,353,104.61	
				(2,693,326,333)	
	組入時価比率：3.4%			3.7%	
メキシコペソ	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	93,958	36.27	3,407,856.66	
	CEMEX SAB - CPO	1,455,985	8.26	12,026,436.10	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	278,983	73.55	20,519,199.65	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	16,210	264.83	4,292,894.30	
	ALFA S.A.B. -A	218,000	12.86	2,803,480.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	88.02	3,071,898.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	18,900	489.74	9,256,086.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	30,400	299.73	9,111,792.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,400	172.76	2,833,264.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	492,000	71.76	35,305,920.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	44,000	163.88	7,210,720.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	52,000	135.97	7,070,440.00	

	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	170,300	154.37	26,289,211.00	
	GRUMA S.A.B.-B	15,600	260.51	4,063,956.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	131,000	85.94	11,258,140.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	110,000	33.99	3,738,900.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	68,000	63.29	4,303,720.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	230,200	148.46	34,175,492.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	209,000	35.23	7,363,070.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,559,000	18.21	46,599,390.00	
	GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	201,000	18.43	3,704,430.00	
小計	銘柄数：21			258,406,295.71	
				(1,766,672,162)	
	組入時価比率：2.2%				2.4%
リアル	COSAN SA	99,000	17.29	1,711,710.00	
	PETRO RIO SA	65,300	35.49	2,317,497.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	339,000	28.56	9,681,840.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	430,000	25.12	10,801,600.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	86,000	12.84	1,104,240.00	
	BRASKEM SA-PREF A	13,200	23.75	313,500.00	
	KLABIN SA-UNIT	61,000	19.33	1,179,130.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	13.91	642,642.00	
	GERDAU SA PFD NPV	112,000	28.70	3,214,400.00	
	VALE SA	348,552	86.32	30,087,008.64	
	SUZANO SA	67,560	46.84	3,164,510.40	
	WEG SA	155,748	38.50	5,996,298.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	71,560	55.95	4,003,782.00	
	LOCALIZA RENT A CAR SA-RIGHT	312	13.00	4,056.00	
	RUMO SA	123,000	19.15	2,355,450.00	
	CCR SA	121,000	11.10	1,343,100.00	
	AMERICANAS SA	60,039	9.18	551,158.02	
	MAGAZINE LUIZA SA	230,000	2.68	616,400.00	
	LOJAS RENNER S.A.	88,974	21.88	1,946,751.12	
	VIBRA ENERGIA SA	113,500	15.75	1,787,625.00	
	ATACADAO SA	54,000	15.79	852,660.00	
	RAIA DROGASIL SA	102,000	23.88	2,435,760.00	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	84,000	20.02	1,681,680.00	

	AMBEV SA	414,956	14.62	6,066,656.72	
	BRF SA	63,000	7.52	473,760.00	
	JBS SA	74,600	21.11	1,574,806.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	92,500	11.42	1,056,350.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	420,987	5.28	2,222,811.36	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	29,800	29.20	870,160.00	
	HYPERA SA	33,000	44.83	1,479,390.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	156,953	13.36	2,096,892.08	
	BANCO BRADESCO SA - PRAF	499,042	15.14	7,555,495.88	
	BANCO DO BRASIL SA	72,800	35.28	2,568,384.00	
	BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	43,700	28.32	1,237,584.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PRAF	437,991	25.19	11,032,993.29	
	ITAUSA SA	492,018	8.58	4,221,514.44	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	67,000	33.59	2,250,530.00	
	TOTVS SA	40,000	28.35	1,134,000.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	41,605	38.46	1,600,128.30	
	TIM SA	82,952	12.30	1,020,309.60	
	CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PRAF B	29,000	44.64	1,294,560.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	106,600	43.19	4,604,054.00	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PRAF	135,987	11.11	1,510,815.57	
	CPFL ENERGIA SA	18,400	32.70	601,680.00	
	ENERGISA SA-UNITS	20,800	44.27	920,816.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	91,000	26.97	2,454,270.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	33,600	58.11	1,952,496.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	535,999	13.35	7,155,586.65	
	BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT	109,000	24.70	2,692,300.00	
	ENGIE BRASIL SA	16,600	38.09	632,294.00	
小計	銘柄数：50			160,073,436.07	
				(4,104,811,143)	
	組入時価比率：5.2%			5.7%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	33,400	6,374.90	212,921,660.00	
	EMPRESAS CMPC SA	119,000	1,436.00	170,884,000.00	
	CIA SUD AMERICANA VAPORES	1,226,200	67.77	83,099,574.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	50,200	1,645.00	82,579,000.00	

	CENCOSUD SA	126,000	1,348.00	169,848,000.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,282	24,532.00	154,110,024.00	
	ENEL AMERICAS SA	2,325,000	110.60	257,145,000.00	
小計	銘柄数：7			1,130,587,258.00	
				(170,670,060)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	28,900	41,100.00	1,187,790,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,800	20,990.00	709,462,000.00	
小計	銘柄数：2			1,897,252,000.00	
				(53,052,857)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	8,000	19.78	158,240.00	
	FF GROUP	2,030	0.00	0.00	
	OPAP SA	20,200	12.96	261,792.00	
	JUMBO SA	10,732	15.63	167,741.16	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	206,500	0.99	206,087.00	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS	282,800	1.04	296,091.60	
	NATIONAL BANK OF GREECE	43,700	3.68	160,816.00	
	HELLENIC TELECOM	18,000	14.87	267,660.00	
	PUBLIC POWER CORP	20,000	6.54	130,900.00	
	TERNA ENERGY SA	5,100	20.20	103,020.00	
小計	銘柄数：10			1,752,347.76	
				(245,819,343)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	12,700	491.00	6,235,700.00	
	HEKTAS TICARET T.A.S	100,000	43.44	4,344,000.00	
	SASA POLYESTER SANAYI	39,000	116.80	4,555,200.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,000	41.14	4,772,240.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	62,460	58.00	3,622,680.00	
	KOC HLDGS	53,000	76.90	4,075,700.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	150,000	41.06	6,159,000.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	44,000	141.80	6,239,200.00	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	6,200	480.50	2,979,100.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	45,000	136.90	6,160,500.00	
	AKBANK T.A.S	325,000	19.72	6,409,000.00	

	HACI OMER SABANCI HOLDING	81,000	43.22	3,500,820.00	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	383,995	13.01	4,995,774.95	
	YAPI VE KREDI BANKASI A.S.	260,000	12.11	3,148,600.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	117,000	36.80	4,305,600.00	
小計	銘柄数：15			71,503,114.95	
	組入時価比率：0.6%			(507,564,861)	0.7%
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	667.50	3,370,875.00	
	MONETA MONEY BANK AS	42,000	74.50	3,129,000.00	
	CEZ AS	15,500	756.00	11,718,000.00	
小計	銘柄数：3			18,217,875.00	
	組入時価比率：0.1%			(105,729,259)	0.1%
フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	37,500	2,640.00	99,000,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	11,700	8,800.00	102,960,000.00	
	OTP BANK NYRT	22,300	10,300.00	229,690,000.00	
小計	銘柄数：3			431,650,000.00	
	組入時価比率：0.2%			(151,762,528)	0.2%
ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	59,587	63.70	3,795,691.90	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	13,800	124.10	1,712,580.00	
	LPP SA	94	10,830.00	1,018,020.00	
	ALLEGRO.EU SA	29,400	25.38	746,172.00	
	PEPCO GROUP NV	12,600	39.72	500,472.00	
	DINO POLSKA SA	4,910	382.10	1,876,111.00	
	BANK PEKAO SA	15,700	85.70	1,345,490.00	
	MBANK	1,100	300.00	330,000.00	
	PKO BANK POLSKI SA	87,100	29.97	2,610,387.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,100	259.60	804,760.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,500	34.63	1,748,815.00	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	73,000	6.69	488,370.00	
	CYFROWY POLSAT SA	18,900	17.53	331,317.00	
	CD PROJEKT RED SA	4,960	129.30	641,328.00	
小計	銘柄数：14			17,949,513.90	
	組入時価比率：0.7%			(543,227,678)	0.8%

香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY	367,000	0.00	0.00
	SUPER HI INTERNATIONAL HOLDING	11,100	0.00	0.00
	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	204,000	9.26	1,889,040.00
	CHINA COAL ENERGY CO-H	150,000	6.37	955,500.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,290,900	3.72	8,522,148.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	297,000	22.50	6,682,500.00
	PETROCHINA CO LTD-H	1,910,000	3.52	6,723,200.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	138,000	24.25	3,346,500.00
	DONGYUE GROUP LTD	108,000	8.51	919,080.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	107,000	28.00	2,996,000.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	393,000	6.51	2,558,430.00
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	176,000	4.15	730,400.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	280,000	3.26	912,800.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	250,000	7.29	1,822,500.00
	CMOC GROUP LTD-H	405,000	3.46	1,401,300.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	31,640	59.75	1,890,490.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	11.24	1,101,520.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LTD	60,000	14.24	854,400.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H	94,000	8.36	785,840.00
	ZIJIN MINING GROUP CO-H	559,000	10.46	5,847,140.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	118,000	7.19	848,420.00
	AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	202,000	3.34	674,680.00
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	92,000	8.05	740,600.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	2.78	484,832.00
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	134,000	16.66	2,232,440.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	420,000	4.14	1,738,800.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	227,250	8.19	1,861,177.50
	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	55,984	6.84	382,930.56
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	55,200	37.80	2,086,560.00
	CITIC LTD	559,000	7.88	4,404,920.00
	FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	225,940	6.18	1,396,309.20
	CRRC CORP LTD-H	320,000	3.11	995,200.00
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	57,000	20.30	1,157,100.00

SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	77,000	7.74	595,980.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	214,800	10.46	2,246,808.00	
BOC AVIATION LTD	15,000	63.00	945,000.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	281,000	3.34	938,540.00	
AIR CHINA LIMITED-H	148,000	7.30	1,080,400.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	216,000	5.18	1,118,880.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	273,000	8.15	2,224,950.00	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	10,500	142.50	1,496,250.00	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	204,000	5.82	1,187,280.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	106,000	11.36	1,204,160.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	182,000	6.17	1,122,940.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	148,000	6.79	1,004,920.00	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	129,000	7.50	967,500.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	6.04	688,560.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	62,000	32.75	2,030,500.00	
MINTH GROUP LTD	66,000	20.90	1,379,400.00	
BYD CO LTD-H	74,500	194.10	14,460,450.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	232,000	4.61	1,069,520.00	
GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	580,000	11.66	6,762,800.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	307,000	10.18	3,125,260.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	285,890	5.25	1,500,922.50	
LI AUTO INC	102,500	79.55	8,153,875.00	
XPENG INC	70,600	41.80	2,951,080.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	134,000	12.74	1,707,160.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	217,000	26.60	5,772,200.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,400	102.80	11,451,920.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	350,000	3.78	1,323,000.00	
LI NING CO LTD	219,000	67.65	14,815,350.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	72,600	86.30	6,265,380.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	105,000	8.30	871,500.00	
HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS LTD	286,000	1.47	420,420.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING	111,000	21.75	2,414,250.00	

LTD.				
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS	57,000	20.55	1,171,350.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	125,600	18.58	2,333,648.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	1,351,780	86.50	116,928,970.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	486,000	7.09	3,445,740.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	106,900	72.30	7,728,870.00	
JD.COM, INC.	196,767	227.80	44,823,522.60	
MEITUAN-CLASS B	401,900	183.20	73,628,080.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	36,600	22.15	810,690.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LIMITED	42,000	16.40	688,800.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F CO LTD	6,100	228.80	1,395,680.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	175,800	15.54	2,731,932.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	44,600	19.50	869,700.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	202,000	6.32	1,276,640.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	55,000	41.55	2,285,250.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	12,300	119.00	1,463,700.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	141,333	55.10	7,787,448.30	
NONGFU SPRING LTD	154,800	44.25	6,849,900.00	
TSING TAO BREWERY CO-H	54,000	76.95	4,155,300.00	
CHINA FEIHE LTD	292,000	6.64	1,938,880.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.00	0.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	283,000	35.70	10,103,100.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	240,000	3.57	856,800.00	
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	168,000	13.70	2,301,600.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	125,000	7.67	958,750.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	388,000	5.27	2,044,760.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	55,000	26.80	1,474,000.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	147,000	12.78	1,878,660.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	23,000	21.25	488,750.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	60,000	40.85	2,451,000.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	47,000	19.14	899,580.00	

SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	248,000	12.32	3,055,360.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO	39,400	53.35	2,101,990.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	13.06	664,754.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	132,400	19.58	2,592,392.00	
3SBIO, INC	119,000	8.29	986,510.00	
BEIGENE LTD	53,820	137.50	7,400,250.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	104,000	32.70	3,400,800.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	158,000	12.06	1,905,480.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	179,500	6.37	1,143,415.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	248,000	3.46	858,080.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	791,520	8.35	6,609,192.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	130,000	13.90	1,807,000.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	58,000	25.45	1,476,100.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,021,500	4.42	4,515,030.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,660,000	2.61	6,942,600.00	
BANK OF CHINA LTD-H	7,170,000	2.78	19,932,600.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	745,790	4.36	3,251,644.40	
CHINA CITIC BANK-H	810,000	3.40	2,754,000.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	8,684,000	4.67	40,554,280.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	257,000	2.30	591,100.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	351,692	41.65	14,647,971.80	
CHINA MINSHENG BANKING-H	589,800	2.67	1,574,766.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	5,090,000	3.85	19,596,500.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	681,000	4.68	3,187,080.00	
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	6.19	953,260.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	671,000	12.56	8,427,760.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	261,000	17.38	4,536,180.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	9.25	957,116.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	72,000	18.20	1,310,400.00	
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	850,000	2.57	2,184,500.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	634,420	7.48	4,745,461.60	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	571,500	50.45	28,832,175.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	58,000	20.95	1,215,100.00	

CHINASOFT INTERNATIONAL LIMITED	280,000	6.70	1,876,000.00
GDS HOLDINGS LIMITED	84,200	19.30	1,625,060.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	109,000	16.90	1,842,100.00
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	264,000	16.30	4,303,200.00
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	51,500	24.15	1,243,725.00
ZTE CORP-H	76,052	16.78	1,276,152.56
LENOVO GROUP LTD	718,000	6.35	4,559,300.00
XIAOMI CORPORATION	1,380,000	10.80	14,904,000.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	52,000	16.92	879,840.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	60,000	24.95	1,497,000.00
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	65,000	8.37	544,050.00
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	69,200	91.10	6,304,120.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD	49,000	17.56	860,440.00
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	1,956,000	1.99	3,892,440.00
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	46,000	26.70	1,228,200.00
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO	32,000	26.75	856,000.00
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	468,000	8.17	3,823,560.00
CHINA TOWER CORP LTD	4,300,000	0.84	3,612,000.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	24.10	867,600.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	247,000	11.16	2,756,520.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	76,000	29.10	2,211,600.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	71,100	106.20	7,550,820.00
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	316,000	5.52	1,744,320.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	405,000	1.96	793,800.00
GUANGDONG INVESTMENT	240,000	7.81	1,874,400.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	1.08	669,600.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	3.75	997,500.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H	124,400	15.22	1,893,368.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	190,050	15.60	2,964,780.00
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	11.14	920,164.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	268,000	4.79	1,283,720.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	126,000	8.76	1,103,760.00

KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	35,500	56.90	2,019,950.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY	149,000	31.10	4,633,900.00
CGN POWER CO LTD-H	980,000	1.82	1,783,600.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	284,000	8.36	2,374,240.00
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	490,000	2.76	1,352,400.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	192,000	13.10	2,515,200.00
HUANENG POWER INTL INC-H	410,000	3.10	1,271,000.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	98,000	22.15	2,170,700.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	8,000	81.55	652,400.00
PHARMARON BEIJING CO LTD	14,400	46.70	672,480.00
WUXI APPTec CO LTD	30,500	77.30	2,357,650.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	327,500	54.05	17,701,375.00
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	73,000	22.95	1,675,350.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	410,000	1.68	688,800.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	336,000	20.55	6,904,800.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	155,000	8.17	1,266,350.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	292,444	35.25	10,308,651.00
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	71,000	37.95	2,694,450.00
CHINA VANKE CO LTD-H	170,000	16.02	2,723,400.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,134,380	2.68	3,040,138.40
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	173,000	19.44	3,363,120.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	98,000	11.76	1,152,480.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO.LTD.	128,000	5.23	669,440.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	187,000	24.20	4,525,400.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	100,000	9.63	963,000.00
CHINA LITERATURE LTD	28,400	29.85	847,740.00
BILIBILI INC	19,120	186.20	3,560,144.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	368,000	1.79	658,720.00
KINGSOFT CORP LTD	91,000	24.50	2,229,500.00
NETEASE, INC.	177,950	113.30	20,161,735.00
BAIDU INC-CLASS A	199,110	112.00	22,300,320.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	166,900	69.35	11,574,515.00
TENCENT HOLDINGS LTD	570,400	320.20	182,642,080.00

小計	銘柄数：193			1,088,936,029.42 (18,457,465,698)	
	組入時価比率：23.3%			25.6%	
リンギ	DIALOG GROUP BHD	313,044	2.38	745,044.72	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	30,000	22.00	660,000.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	244,000	8.40	2,049,600.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	296,000	4.68	1,385,280.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	6.37	215,306.00	
	SIME DARBY BERHAD	220,000	2.19	481,800.00	
	MISC BHD	99,960	7.26	725,709.60	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	121,460	6.44	782,202.40	
	GENTING BHD	187,000	4.37	817,190.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	229,000	2.64	604,560.00	
	MR DIY GROUP M BHD	187,500	2.04	382,500.00	
	IOI CORP	247,000	3.90	963,300.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG	42,400	21.20	898,880.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,300	139.00	1,014,700.00	
	PPB GROUP BERHAD	51,740	17.60	910,624.00	
	QL RESOURCES BHD	119,000	5.55	660,450.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	238,000	4.35	1,035,300.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,000	1.69	197,730.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	428,000	0.82	350,960.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	156,000	6.15	959,400.00	
	AMMB HOLDING	125,000	4.24	530,000.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	596,000	5.74	3,421,040.00	
	HONG LEONG BANK	60,960	20.56	1,253,337.60	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	18.60	249,649.20	
	MALAYAN BANKING	435,000	8.78	3,819,300.00	
	PUBLIC BANK BHD	1,295,000	4.44	5,749,800.00	
	RHB BANK BHD	125,023	5.74	717,632.02	
INARI AMERTRON BHD	271,000	2.63	712,730.00		
TELEKOM MALAYSIA	129,000	5.13	661,770.00		
AXIATA GROUP BERHAD	195,000	2.98	581,100.00		
DIGI.COM BERHAD	286,000	3.84	1,098,240.00		
MAXIS BHD	265,000	3.81	1,009,650.00		

	TENAGA NASIONAL	258,000	9.17	2,365,860.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	63,000	16.60	1,045,800.00	
小計	銘柄数：34			39,056,445.54	
				(1,168,502,454)	
	組入時価比率：1.5%			1.6%	
パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	135,000	171.50	23,152,500.00	
	PTT PCL-NVDR	886,000	31.50	27,909,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	83,000	55.25	4,585,750.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	187,967	39.50	7,424,696.50	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	227,994	44.75	10,202,731.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	68,300	334.00	22,812,200.00	
	SCG PACKAGING PLC-NVDR	150,000	55.50	8,325,000.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	880,000	8.20	7,216,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	411,000	73.00	30,003,000.00	
	BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	810,000	9.60	7,776,000.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	700,000	6.05	4,235,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	270,978	31.25	8,468,062.50	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	155,025	45.50	7,053,637.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	579,997	15.30	8,873,954.10	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	258,000	23.00	5,934,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	35.25	2,597,925.00	
	CP ALL PCL-NVDR	543,000	66.00	35,838,000.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	20,900	94.00	1,964,600.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	112,000	27.25	3,052,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	426,000	24.60	10,479,600.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	199,800	16.60	3,316,680.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	912,000	28.50	25,992,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	59,000	209.00	12,331,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	49,000	144.00	7,056,000.00	
	KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	17.90	4,780,195.00	
	SCB X PCL-NVDR	81,000	105.00	8,505,000.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	26,300	708.00	18,620,400.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	920,000	4.72	4,342,400.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	114,000	190.00	21,660,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR	140,000	75.50	10,570,000.00	

	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	51,000	65.00	3,315,000.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	68,000	59.00	4,012,000.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	37.25	1,825,250.00	
	SRI SAWAD CORP PCL-NVDR	63,000	47.75	3,008,250.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	104,000	39.50	4,108,000.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	17,300	168.00	2,906,400.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	134,000	93.75	12,562,500.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	59,000	71.25	4,203,750.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	261,000	53.25	13,898,250.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	115,000	42.25	4,858,750.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	185,000	69.75	12,903,750.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	620,000	9.85	6,107,000.00	
小計	銘柄数：42			428,786,232.10	
				(1,633,675,544)	
	組入時価比率：2.1%			2.3%	
フィリピンペン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	56.80	8,292,800.00	
	AYALA CORPORATION	21,102	696.00	14,686,992.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	255,005	49.85	12,711,999.25	
	SM INVESTMENTS CORP	22,100	914.00	20,199,400.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	93,000	204.00	18,972,000.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	43,000	230.00	9,890,000.00	
	MONDE NISSIN CORP	680,000	11.70	7,956,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	67,000	137.60	9,219,200.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS	193,999	99.80	19,361,100.20	
	BDO UNIBANK INC	202,797	106.80	21,658,719.60	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	205,095	54.95	11,269,970.25	
	GLOBE TELECOM INC	2,226	2,194.00	4,883,844.00	
	PLDT INC	7,000	1,230.00	8,610,000.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	283.60	4,792,840.00	
	ACEN CORP	617,479	7.56	4,668,141.24	
	AYALA LAND INC	768,000	29.20	22,425,600.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,065,975	35.50	37,842,112.50	
小計	銘柄数：17			237,440,719.04	
				(569,311,612)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	

ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,170,000	3,810.00	4,457,700,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	147,050	26,875.00	3,951,968,750.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,126	780.00	2,255,858,280.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	377,079	6,750.00	2,545,283,250.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	760,000	2,000.00	1,520,000,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,115,813	4,010.00	4,474,410,130.00	
	VALE INDONESIA TBK	198,000	7,050.00	1,395,900,000.00	
	INDAH KIAT PULP&PAPER	240,000	9,150.00	2,196,000,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,890,000	5,675.00	10,725,750,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	1,320,000	2,620.00	3,458,400,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	178,000	10,025.00	1,784,450,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	420,000	6,825.00	2,866,500,000.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	700,000	5,850.00	4,095,000,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	820,000	4,820.00	3,952,400,000.00	
	KALBE FARMA PT	2,300,000	2,040.00	4,692,000,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	5,010,000	8,500.00	42,585,000,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	368,000	3,740.00	1,376,320,000.00	
	BANK MANDIRI	1,760,000	9,925.00	17,468,000,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	610,000	9,325.00	5,688,250,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	6,330,028	4,880.00	30,890,536,640.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,479,000	1,055.00	1,560,345,000.00	
TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	4,400,000	3,780.00	16,632,000,000.00		
小計	銘柄数：22			170,572,072,050.00	
				(1,449,862,612)	
	組入時価比率：1.8%			2.0%	
ウォン	HD HYUNDAI CO LTD	5,100	64,700.00	329,970,000.00	
	S-OIL CORPORATION	3,930	88,000.00	345,840,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,240	161,500.00	846,260,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	10,300	45,550.00	469,165,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	1,490	140,000.00	208,600,000.00	
	LG CHEM LTD - PREFERRED	630	296,000.00	186,480,000.00	
	LG CHEMICALS LTD	4,556	610,000.00	2,779,160,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP-RIGHTS	322	35,000.00	11,270,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,610	178,000.00	286,580,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,490	55,400.00	137,946,000.00	

SKC CO LTD	1,450	92,400.00	133,980,000.00
POSCO CHEMICAL CO LTD	2,241	178,500.00	400,018,500.00
HYUNDAI STEEL CO	7,399	32,350.00	239,357,650.00
KOREA ZINC CO LTD	850	571,000.00	485,350,000.00
POSCO HOLDINGS INC	7,180	288,500.00	2,071,430,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,000	48,500.00	339,500,000.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	6,900	34,900.00	240,810,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	14,400	22,200.00	319,680,000.00
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	38,700	15,000.00	580,500,000.00
ECOPRO BM CO LTD	3,960	97,000.00	384,120,000.00
LG ENERGY SOLUTION	3,280	455,500.00	1,494,040,000.00
CJ CORP	1,100	84,000.00	92,400,000.00
GS HOLDINGS CORP	3,600	46,600.00	167,760,000.00
LG CORP	9,340	82,100.00	766,814,000.00
SAMSUNG C&T CORP	7,790	118,000.00	919,220,000.00
SK INC	3,370	198,500.00	668,945,000.00
DOOSAN BOBCAT INC	3,350	35,600.00	119,260,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	1,410	120,500.00	169,905,000.00
HYUNDAI MIPO DOCKYARD CO., LTD.	2,100	85,300.00	179,130,000.00
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	3,210	72,100.00	231,441,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	63,000	5,150.00	324,450,000.00
S-1 CORPORATION	1,450	62,700.00	90,915,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,810	171,500.00	310,415,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	17,500	24,400.00	427,000,000.00
HMM COMPANY LIMITED	27,100	21,700.00	588,070,000.00
PAN OCEAN CO LTD	32,000	6,030.00	192,960,000.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	5,320	33,250.00	176,890,000.00
HANON SYSTEMS	11,650	8,260.00	96,229,000.00
HYUNDAI MOBIS	5,510	206,500.00	1,137,815,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD	12,660	157,000.00	1,987,620,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	4,130	80,100.00	330,813,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	79,900.00	117,453,000.00
KIA CORP	23,410	62,700.00	1,467,807,000.00
COWAY CO LTD	4,970	58,000.00	288,260,000.00
LG ELECTRONICS INC	10,300	90,900.00	936,270,000.00

F&F CO LTD / NEW	1,600	139,500.00	223,200,000.00
KANGWON LAND INC	7,900	23,950.00	189,205,000.00
LOTTE SHOPPING CO	800	88,900.00	71,120,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,680	80,700.00	296,976,000.00
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	206,500.00	100,152,500.00
E-MART CO	1,710	101,500.00	173,565,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	820	390,500.00	320,210,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,800	126,500.00	227,700,000.00
KT & G CORP	10,010	96,400.00	964,964,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,460	133,500.00	328,410,000.00
LG H&H	806	705,000.00	568,230,000.00
HLB INC	8,062	30,600.00	246,697,200.00
SD BIOSENSOR INC	3,500	32,150.00	112,525,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	7,570	64,100.00	485,237,000.00
CELLTRION INC	9,030	173,000.00	1,562,190,000.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	1,950	77,900.00	151,905,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,081	71,500.00	77,291,500.00
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	499	300,500.00	149,949,500.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,320	71,100.00	236,052,000.00
YUHAN CORPORATION	3,991	59,500.00	237,464,500.00
HANA FINANCIAL HOLDINGS	27,100	44,650.00	1,210,015,000.00
INDUSTRIAL BK OF KOREA	26,100	11,100.00	289,710,000.00
KAKAOBANK CORP	12,900	25,100.00	323,790,000.00
KB FINANCIAL GROUP INC	35,000	51,600.00	1,806,000,000.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP	42,500	37,550.00	1,595,875,000.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	49,300	12,750.00	628,575,000.00
DB INSURANCE CO LTD	3,800	68,100.00	258,780,000.00
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	4,230	48,650.00	205,789,500.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	3,110	216,500.00	673,315,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	8,200	74,200.00	608,440,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	3,620	127,000.00	459,740,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS	435,410	58,100.00	25,297,321,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	74,300	52,500.00	3,900,750,000.00
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,150	52,800.00	113,520,000.00
L&F CO LTD	2,180	182,900.00	398,722,000.00

	LG INNOTEK CO LTD	1,260	274,000.00	345,240,000.00	
	LG.DISPLAY CO LTD	23,500	12,700.00	298,450,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	4,800	134,000.00	643,200,000.00	
	SAMSUNG SDI CO,LTD	4,950	622,000.00	3,078,900,000.00	
	SK HYNIX INC	49,280	77,800.00	3,833,984,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	8,699	34,900.00	303,595,100.00	
	LG UPLUS CORP	17,400	11,800.00	205,320,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER	26,600	21,900.00	582,540,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,140	57,600.00	180,864,000.00	
	MERITZ SECURITIES	24,500	6,060.00	148,470,000.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	24,737	6,520.00	161,285,240.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	9,680.00	74,826,400.00	
	SAMSUNG SECURITIES	6,800	35,250.00	239,700,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,703	806,000.00	1,372,618,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,900	24,000.00	141,600,000.00	
	HYBE CO LTD	2,010	175,000.00	351,750,000.00	
	KAKAO GAMES CORP	2,810	42,750.00	120,127,500.00	
	KRAFTON INC	2,990	172,500.00	515,775,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,631	429,500.00	700,514,500.00	
	NETMARBLE CORP	1,470	49,750.00	73,132,500.00	
	PEARL ABYSS CORP	2,860	41,900.00	119,834,000.00	
	KAKAO CORP	28,320	53,400.00	1,512,288,000.00	
	NAVER CORP	12,210	178,000.00	2,173,380,000.00	
小計	銘柄数：103			85,748,680,090.00	
				(8,883,563,257)	
	組入時価比率：11.2%			12.3%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	122,360	80.10	9,801,036.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	331,998	69.40	23,040,661.20	
	FORMOSA PLASTIC	381,424	86.80	33,107,603.20	
	NAN YA PLASTICS CORP	440,726	70.30	30,983,037.80	
	ASIA CEMENT	208,980	41.55	8,683,119.00	
	TAIWAN CEMENT	534,888	34.05	18,212,936.40	
	CHINA STEEL	1,119,544	30.70	34,370,000.80	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	6,000	1,550.00	9,300,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	268,429	46.75	12,549,055.75	

FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	313,454	31.55	9,889,473.70
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,464	911.00	11,354,704.00
CHINA AIRLINES LTD	219,000	19.00	4,161,000.00
EVA AIRWAYS CORP	202,000	28.10	5,676,200.00
EVERGREEN MARINE	101,950	167.50	17,076,625.00
WAN HAI LINES LIMITED	49,335	86.20	4,252,677.00
YANG MING MARINE TRANSPORT	143,000	67.30	9,623,900.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	143,000	28.75	4,111,250.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	142,036	33.75	4,793,715.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	14,000	278.50	3,899,000.00
GIANT MANUFACTURING	24,613	209.00	5,144,117.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	17,443	492.50	8,590,677.50
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	39,815	207.50	8,261,612.50
POU CHEN CORP	175,468	34.05	5,974,685.40
MOMO.COM INC	5,600	626.00	3,505,600.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	592.00	15,392,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	47,816	268.00	12,814,688.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	446,836	65.90	29,446,492.40
PHARMAESSENTIA CORPORATION	17,000	488.50	8,304,500.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	362,603	17.25	6,254,901.75
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,672,212	21.90	36,621,442.80
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	1,154,044	24.10	27,812,460.40
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,016,501	26.30	26,733,976.30
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	824,710	22.50	18,555,975.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	974,139	30.55	29,759,946.45
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	918,644	16.70	15,341,354.80
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	914,168	15.20	13,895,353.60
TAIWAN BUSINESS BANK	649,000	12.90	8,372,100.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	875,520	25.95	22,719,744.00
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	370,906	44.25	16,412,590.50
CHAILEASE HOLDING CO LTD	128,699	216.50	27,863,333.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	911,706	21.80	19,875,190.80
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	819,293	41.15	33,713,906.95
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,477,789	12.70	18,767,920.30

HOLDING				
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	665,463	56.70	37,731,752.10	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	1,330,113	8.75	11,638,488.75	
ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION	50,000	237.50	11,875,000.00	
ACER INC	256,767	23.15	5,944,156.05	
ADVANTECH CO.,LTD.	38,750	333.00	12,903,750.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	66,805	271.00	18,104,155.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	54,840	169.00	9,267,960.00	
COMPAL ELECTRONICS	354,590	22.95	8,137,840.50	
INVENTEC CO.,LTD	251,911	26.00	6,549,686.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	189,897	64.00	12,153,408.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	74,000	119.50	8,843,000.00	
PEGATRON CORP	199,692	64.20	12,820,226.40	
QUANTA COMPUTER INC	256,684	71.20	18,275,900.80	
WIWYNN CORP	7,000	819.00	5,733,000.00	
AUO CORP	573,606	15.40	8,833,532.40	
DELTA ELECTRONICS INC	175,681	281.00	49,366,361.00	
E INK HOLDINGS INC	77,000	167.00	12,859,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,126,649	101.00	113,791,549.00	
INNOLUX CORP	757,776	11.10	8,411,313.60	
LARGAN PRECISION CO LTD	9,040	2,140.00	19,345,600.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORPORATION	20,000	242.00	4,840,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	122,566	61.00	7,476,526.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	118,000	125.00	14,750,000.00	
WPG HOLDINGS CO LTD	170,387	47.80	8,144,498.60	
YAGEO CORPORATION	32,137	460.00	14,783,020.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	64,410	108.00	6,956,280.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	292,658	93.80	27,451,320.40	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,000	1,350.00	8,100,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	20,000	435.50	8,710,000.00	
MEDIATEK INC	138,538	660.00	91,435,080.00	
NANYA TECHNOLOGY CO	100,000	51.40	5,140,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	52,058	301.50	15,695,487.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	6,000	825.00	4,950,000.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	302,000	33.30	10,056,600.00	

	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	38,417	289.00	11,102,513.00	
	SILERGY CORP	28,000	445.00	12,460,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,246,000	455.00	1,021,930,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,106,500	41.95	46,417,675.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	102,000	81.50	8,313,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	24,000	138.00	3,312,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	20.10	4,864,200.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	338,065	112.50	38,032,312.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	144,000	65.70	9,460,800.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	154,200	94.80	14,618,160.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	169,668	43.65	7,406,008.20	
小計	銘柄数：88			2,474,011,725.10	
				(10,652,599,685)	
	組入時価比率：13.5%			14.8%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	70,000	325.10	22,757,000.00	
	COAL INDIA LTD	142,000	215.05	30,537,100.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	64,380	227.50	14,646,450.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	268,500	73.00	19,600,500.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	219,000	139.80	30,616,200.00	
	PETRONET LNG LTD	77,000	207.95	16,012,150.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	277,600	2,502.20	694,610,720.00	
	ASIAN PAINTS LTD	35,000	3,057.90	107,026,500.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	19,000	575.55	10,935,450.00	
	PI INDUSTRIES LTD	7,000	3,459.60	24,217,200.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	15,500	2,490.25	38,598,875.00	
	SRF LTD	14,200	2,219.35	31,514,770.00	
	UPL LTD	43,200	711.20	30,723,840.00	
	ACC LIMITED	6,000	2,374.10	14,244,600.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	57,000	491.25	28,001,250.00	
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	23,300	1,709.10	39,822,030.00	
	SHREE CEMENT LIMITED	880	23,271.40	20,478,832.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	9,260	6,909.40	63,981,044.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	117,000	429.55	50,257,350.00	
	JINDAL STEEL&POWER LTD	32,000	524.30	16,777,600.00	
	JSW STEEL LTD	66,000	727.85	48,038,100.00	

TATA STEEL LIMITED	699,400	102.25	71,513,650.00	
VEDANTA LTD	59,000	285.20	16,826,800.00	
BHARAT ELECTRONICS LTD	348,000	96.55	33,599,400.00	
LARSEN&TOUBRO LIMITED	62,200	2,062.75	128,303,050.00	
ABB INDIA LTD	4,700	2,680.75	12,599,525.00	
HAVELLS INDIA LTD	24,300	1,100.80	26,749,440.00	
SIEMENS LIMITED	7,000	2,787.20	19,510,400.00	
ADANI ENTERPRISES LTD	26,200	3,642.20	95,425,640.00	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,200	607.25	13,480,950.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	9,400	1,914.25	17,993,950.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	22,400	712.30	15,955,520.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	52,400	794.10	41,610,840.00	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,000	2,073.70	14,515,900.00	
BHARAT FORGE LIMITED	20,900	842.40	17,606,160.00	
MRF LTD	200	86,071.00	17,214,200.00	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD	159,000	66.90	10,637,100.00	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	9,300	2,778.50	25,840,050.00	
BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	3,541.80	19,798,662.00	
EICHER MOTORS LTD	11,600	3,113.65	36,118,340.00	
HERO MOTOCORP LTD	9,300	2,636.85	24,522,705.00	
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	81,900	1,224.60	100,294,740.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	10,790	8,141.60	87,847,864.00	
TATA MOTORS LTD	154,700	378.35	58,530,745.00	
TVS MOTOR CO LTD	18,800	1,010.50	18,997,400.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	530	43,031.35	22,806,615.50	
TITAN CO LTD	32,700	2,483.05	81,195,735.00	
INDIAN HOTELS CO LIMITED	75,000	299.50	22,462,500.00	
JUBILANT FOODWORKS LIMITED	36,000	511.25	18,405,000.00	
ZOMATO LTD	270,000	53.65	14,485,500.00	
TRENT LTD	15,000	1,284.40	19,266,000.00	
AVENUE SUPERMARTS LTD	15,800	3,875.60	61,234,480.00	
UNITED SPIRITS LTD	22,600	874.25	19,758,050.00	
VARUN BEVERAGES LTD	20,000	1,287.60	25,752,000.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	10,700	4,331.90	46,351,330.00	

MARICO LIMITED	46,000	515.55	23,715,300.00
NESTLE INDIA LIMITED	2,890	20,132.75	58,183,647.50
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	55,700	779.00	43,390,300.00
ITC LTD	281,000	326.70	91,802,700.00
COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)	10,200	1,567.60	15,989,520.00
DABUR INDIA LTD	59,800	565.85	33,837,830.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	33,400	873.40	29,171,560.00
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	74,300	2,621.10	194,747,730.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	8,770	4,700.15	41,220,315.50
BIOCON LTD	31,000	267.05	8,278,550.00
AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	437.50	8,181,250.00
CIPLA LIMITED	46,300	1,119.15	51,816,645.00
DR.REDDYS LABORATORIES	11,160	4,310.45	48,104,622.00
LUPIN LTD	14,900	756.75	11,275,575.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	90,700	1,001.55	90,840,585.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	11,540	1,562.50	18,031,250.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	12,600	644.30	8,118,180.00
AXIS BANK LIMITED	205,200	906.60	186,034,320.00
BANDHAN BANK LTD	56,000	226.50	12,684,000.00
ICICI BANK LTD	469,700	878.90	412,819,330.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	50,900	1,821.95	92,737,255.00
YES BANK LTD	1,230,000	17.45	21,463,500.00
BAJAJ FINSERV LTD	37,060	1,497.05	55,480,673.00
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	2,350	5,798.95	13,627,532.50
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	157,300	2,623.05	412,605,765.00
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	90,400	565.45	51,116,680.00
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY	23,100	1,223.60	28,265,160.00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	33,200	439.65	14,596,380.00
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	42,600	1,224.60	52,167,960.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	97,200	1,030.60	100,174,320.00
INFOSYS LTD	306,900	1,497.10	459,459,990.00
LTIMINDTREE LTD	7,562	4,266.55	32,263,651.10
MPHASIS LTD	6,200	1,919.45	11,900,590.00
TATA CONSULTANCY SVS LTD	82,600	3,228.35	266,661,710.00

	TECH MAHINDRA LTD	57,400	995.75	57,156,050.00	
	WIPRO LTD	126,700	377.65	47,848,255.00	
	TATA ELXSI LTD	2,700	5,837.60	15,761,520.00	
	INDUS TOWERS LTD	61,000	189.50	11,559,500.00	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	200,900	808.65	162,457,785.00	
	ADANI TRANSMISSION LTD	25,500	2,270.20	57,890,100.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	303,000	211.25	64,008,750.00	
	TATA POWER COMPANY LIMITED	139,000	196.90	27,369,100.00	
	ADANI TOTAL GAS LTD	26,000	3,232.60	84,047,600.00	
	GAIL INDIA LTD	190,500	91.55	17,440,275.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	34,200	401.45	13,729,590.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	24,590	6,374.60	156,751,414.00	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	40,000	699.25	27,970,000.00	
	MUTHOOT FINANCE LTD	10,000	1,043.45	10,434,500.00	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	24,000	771.25	18,510,000.00	
	SHRIRAM FINANCE LTD	25,200	1,301.50	32,797,800.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	28,800	1,809.05	52,100,640.00	
	ADANI POWER LIMITED	61,000	262.20	15,994,200.00	
	NTPC LIMITED	355,000	163.00	57,865,000.00	
	DIVIS LABORATORIES LTD	11,070	3,498.45	38,727,841.50	
	DLF LIMITED	58,000	357.00	20,706,000.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	9,300	1,173.10	10,909,830.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	6,670	3,845.60	25,650,152.00	
小計	銘柄数：112			6,639,058,081.60	
				(10,688,883,511)	
	組入時価比率：13.5%			14.8%	
カタールリヤル	QATAR FUEL CO	64,000	17.90	1,145,600.00	
	QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	220,000	3.70	815,320.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING	462,000	2.18	1,007,160.00	
	INDUSTRIES QATAR	143,000	13.14	1,879,020.00	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	294,000	4.92	1,446,480.00	
	MASRAF AL RAYAN	455,000	3.28	1,496,040.00	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	86,000	10.58	909,880.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	149,000	20.03	2,984,470.00	
	QATAR NATIONAL BANK	415,000	18.05	7,490,750.00	

	OOREDOO QSC	65,000	9.00	585,455.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	34,400	17.79	611,976.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	195,000	3.00	586,365.00	
小計	銘柄数：12			20,958,516.00	
				(758,488,694)	
	組入時価比率：1.0%			1.1%	
エジプトボンド	EASTERN CO SAE	51,525	14.21	732,170.25	
	EFG-HERMES HOLDING SAE	60,000	17.62	1,057,200.00	
小計	銘柄数：2			1,789,370.25	
				(9,568,120)	
	組入時価比率：0.0%			0.0%	
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,600	221.00	4,331,600.00	
	SASOL LTD	51,100	274.00	14,001,400.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	10,100	285.20	2,880,520.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,330	1,451.76	7,737,880.80	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	40,800	339.36	13,845,888.00	
	GOLD FIELDS LTD	84,400	185.25	15,635,100.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	40,800	61.50	2,509,200.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	81,200	210.01	17,052,812.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	7,600	485.71	3,691,396.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	26,700	188.18	5,024,406.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	249,000	46.37	11,546,130.00	
	BIDVEST GROUP LTD	25,500	221.75	5,654,625.00	
	NASPERS LTD-N SHS	19,660	2,759.80	54,257,668.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	94,000	67.67	6,360,980.00	
	MR PRICE GROUP LTD	25,000	160.19	4,004,750.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	173,000	20.42	3,532,660.00	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	32,000	102.83	3,290,560.00	
	BID CORP LTD	33,000	338.31	11,164,230.00	
	CLICKS GROUP LTD	23,700	280.44	6,646,428.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	48,100	235.31	11,318,411.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	15,300	119.42	1,827,126.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	31,500	140.08	4,412,520.00	
	ABSA GROUP LTD	77,300	197.00	15,228,100.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	7,940	1,899.21	15,079,727.40	
	NEDBANK GROUP LTD	44,579	214.82	9,576,460.78	

	STANDARD BANK GROUP LTD	117,300	173.65	20,369,145.00	
	FIRSTRAND LTD	446,000	63.44	28,294,240.00	
	REMGRO LTD	47,300	140.49	6,645,177.00	
	DISCOVERY LTD	46,907	124.15	5,823,504.05	
	OLD MUTUAL LTD	434,000	10.78	4,678,520.00	
	SANLAM LIMITED	149,000	49.30	7,345,700.00	
	MTN GROUP LTD	155,500	128.99	20,057,945.00	
	VODACOM GROUP	51,700	124.77	6,450,609.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	14,200	332.00	4,714,400.00	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	41,900	104.06	4,360,114.00	
	MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	119.00	3,172,540.00	
小計	銘柄数：36			362,522,473.03	
				(2,813,174,390)	
	組入時価比率：3.6%			3.9%	
U A E ディルハム	MULTIPLY GROUP	295,000	4.83	1,424,850.00	
	Q HOLDING PJSC	181,000	3.82	691,420.00	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	298,000	4.48	1,335,040.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	237,870	9.09	2,162,238.30	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	128,000	9.06	1,159,680.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	286,029	5.62	1,607,482.98	
	EMIRATES NBD PJSC	165,000	13.05	2,153,250.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	409,925	17.50	7,173,687.50	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	321,600	23.76	7,641,216.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	330,000	4.46	1,471,800.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	349,000	5.90	2,059,100.00	
小計	銘柄数：11			28,879,764.78	
				(1,042,559,508)	
	組入時価比率：1.3%			1.4%	
クウェートディナル	AGILITY	134,400	0.67	90,585.60	
	BOUBYAN BANK K.S.C	127,951	0.79	101,593.09	
	GULF BANK	128,000	0.31	40,192.00	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	649,000	0.80	519,849.00	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	662,000	1.07	708,340.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	189,000	0.54	103,572.00	

	MABANEE CO SAKC	40,449	0.84	34,179.40
小計	銘柄数：7			1,598,311.09 (691,637,157)
	組入時価比率：0.9%			1.0%
サウジアラビア リヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	47,751	10.62	507,115.62
	SAUDI ARABIAN OIL CO	217,700	31.40	6,835,780.00
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	10,833	40.20	435,486.60
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	28,000	11.90	333,200.00
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	19,300	142.80	2,756,040.00
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	29,300	32.60	955,180.00
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	81,000	84.90	6,876,900.00
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	29,368	21.12	620,252.16
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	67,000	13.04	873,680.00
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	19,900	39.20	780,080.00
	SAUDI ARABIAN MINING CO	76,400	63.00	4,813,200.00
	JARIR MARKETING CO	6,100	149.60	912,560.00
	NAHDI MEDICAL CO	3,400	168.00	571,200.00
	ALMARAI CO	26,300	52.60	1,383,380.00
	SAVOLA	27,400	27.25	746,650.00
	DALLAH HEALTHCARE CO	3,200	147.60	472,320.00
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	7,800	211.60	1,650,480.00
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	5,000	197.00	985,000.00
	AL RAJHI BANK	177,000	73.90	13,080,300.00
	ALINMA BANK	94,300	31.90	3,008,170.00
	ARAB NATIONAL BANK	60,800	31.45	1,912,160.00
	BANK AL - JAZIRA	34,100	18.70	637,670.00
	BANK ALBILAD	42,666	42.30	1,804,771.80
	BANQUE SAUDI FRANSI	49,200	38.55	1,896,660.00
	RIYAD BANK	124,000	30.60	3,794,400.00
	SAUDI BRITISH BANK	83,800	37.85	3,171,830.00
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	39,000	17.06	665,340.00	
THE SAUDI NATIONAL BANK	198,200	48.70	9,652,340.00	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	7,750	138.00	1,069,500.00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	2,100	240.40	504,840.00	
ELM CO	1,900	326.80	620,920.00	

	SAUDI TELECOM CO	140,700	35.65	5,015,955.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	34,300	33.80	1,159,340.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS COMPANY	29,000	10.04	291,160.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	77,000	23.00	1,771,000.00	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	5,500	176.20	969,100.00	
	ACWA POWER CO	8,700	149.20	1,298,040.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	53,000	11.74	622,220.00	
	EMAAR ECONOMIC CITY	35,000	8.45	295,750.00	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	2,800	181.00	506,800.00	
	小計	銘柄数：40		86,256,771.18	
				(3,040,551,184)	
		組入時価比率：3.8%		4.2%	
	合計			72,202,479,650	
				(72,202,479,650)	

(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(2022年12月26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	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	5,308,200	24,752,136.60	
		小計	銘柄数：1	5,308,200	24,752,136.60
				(3,275,450,236)	
			組入時価比率：4.1%		97.0%
	合計			3,275,450,236	
				(3,275,450,236)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	319,000	7,656,000.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	111,000	2,181,150.00	
		小計	銘柄数：2	430,000	9,837,150.00
				(67,254,627)	
			組入時価比率：0.1%		2.0%
	ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	300,000	4,431,000.00	
	小計	銘柄数：1	300,000	4,431,000.00	
				(34,384,560)	

	組入時価比率：0.0%		1.0%
合計			101,639,187 (101,639,187)
合計			3,377,089,423 (3,377,089,423)

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

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

(注3)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年12月26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	3,490,490,906	-	3,431,883,934	58,606,972
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	488,576,250	-	489,554,030	977,780
米ドル	488,576,250	-	489,554,030	977,780
売建	13,267,000	-	13,231,190	35,810
米ドル	13,267,000	-	13,231,190	35,810
合計	-	-	-	57,593,382

### (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)

(2022年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,784,710,413
国債証券	710,715,541,750
地方債証券	55,942,432,939
特殊債券	63,664,142,645
社債券	40,802,277,000
未収入金	1,498,917,000
未収利息	1,092,623,604
前払費用	17,384,360
流動資産合計	879,518,029,711
資産合計	879,518,029,711
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,052,187,059
未払利息	8,895
流動負債合計	2,052,195,954
負債合計	2,052,195,954
純資産の部	
元本等	
元本	693,776,840,888
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	183,688,992,869
元本等合計	877,465,833,757
純資産合計	877,465,833,757
負債純資産合計	879,518,029,711

### 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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年12月26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	1,2648円
(10,000口当たり純資産額)	(12,648円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年12月28日 至 2022年12月26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

2022年12月26日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年12月26日現在		2021年12月28日
期首		2021年12月28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		628,554,162,177円
同期中における追加設定元本額		132,913,313,658円
同期中における一部解約元本額		67,690,634,947円
期末元本額		693,776,840,888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		395,659,422円
野村世界6資産分散投信（安定コース）		42,948,071,634円
野村世界6資産分散投信（分配コース）		18,686,684,893円
野村世界6資産分散投信（成長コース）		4,351,919,383円
野村資産設計ファンド2015		339,792,545円
野村資産設計ファンド2020		364,370,399円
野村資産設計ファンド2025		394,430,455円
野村資産設計ファンド2030		341,070,626円
野村資産設計ファンド2035		200,870,431円
野村資産設計ファンド2040		243,204,199円
野村日本債券インデックスファンド		710,635,895円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）		157,540,706,149円
のむらっぴ・ファンド（保守型）		18,895,385,990円
のむらっぴ・ファンド（普通型）		32,299,589,834円
のむらっぴ・ファンド（積極型）		3,968,531,712円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）		9,693,939,326円
野村資産設計ファンド2045		35,073,708円
野村円債投資インデックスファンド		658,747,440円
野村インデックスファンド・国内債券		1,841,250,174円
マイ・ロード		37,258,903,895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		1,619,156,435円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）		19,260,644,386円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）		2,125,877,810円
野村資産設計ファンド2050		28,656,860円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		34,349,023円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		10,781,883円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		5,034,987円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		3,487,818円
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）		1,850,746,154円
のむらっぴ・ファンド（やや積極型）		824,596,872円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		45,311,835円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		16,566,150円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		67,199,728円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		9,322,376円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		7,141,172円
野村6資産均等バランス		5,868,545,393円
世界6資産分散ファンド		144,231,230円
野村資産設計ファンド2060		14,814,136円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合連動型上場投信		44,281,767,581円

ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	36,482,501,500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)	490,728,575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)	88,358,775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)	1,429,252,729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)	485,527,244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)	9,694,687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)	11,026,133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)	697,960円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,158,656,574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)	4,116,276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)	35,732,380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)	38,884,043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)	377,877,932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)	287,677,451円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	934,475,389円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	123,681,057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)	1,517,925,318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)	379,527,042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)	15,423,579円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	40,857,648,807円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	56,875,794,920円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	22,417,845,901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)	51,639,230,877円
マイバランスDC30	16,609,008,253円
マイバランスDC50	13,917,243,859円
マイバランスDC70	5,151,446,540円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	13,647,176,796円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	1,895,115,333円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	5,798,627,526円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	2,471,871,633円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	287,838,267円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	45,309,953円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	52,857,182円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	136,221,785円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	54,523,510円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	19,013,525円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	2,074,059,189円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	948,410,764円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	379,321,719円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	449,148,121円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	9,484,204円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	156,833,175円
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	654,908,469円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	3,898,152,540円
野村DCバランスファンド(年金運用戦略タイプ)	70,913,457円

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2022年12月26日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2022年12月26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432回	1,500,000,000	1,500,600,000	
		国庫債券 利付(2年)第433回	3,500,000,000	3,501,120,000	
		国庫債券 利付(2年)第434回	3,000,000,000	3,000,870,000	
		国庫債券 利付(2年)第435回	2,500,000,000	2,500,625,000	
		国庫債券 利付(2年)第436回	1,500,000,000	1,500,300,000	
		国庫債券 利付(2年)第437回	1,000,000,000	1,000,070,000	
		国庫債券 利付(2年)第438回	5,500,000,000	5,500,000,000	
		国庫債券 利付(2年)第439回	4,000,000,000	3,999,360,000	
		国庫債券 利付(2年)第442回	3,000,000,000	2,999,160,000	
		国庫債券 利付(5年)第139回	10,200,000,000	10,213,770,000	
		国庫債券 利付(5年)第140回	5,100,000,000	5,107,140,000	
		国庫債券 利付(5年)第141回	9,600,000,000	9,613,248,000	
		国庫債券 利付(5年)第142回	1,200,000,000	1,201,536,000	
		国庫債券 利付(5年)第143回	6,070,000,000	6,078,073,100	
		国庫債券 利付(5年)第144回	4,400,000,000	4,405,984,000	
		国庫債券 利付(5年)第145回	3,900,000,000	3,905,304,000	
		国庫債券 利付(5年)第146回	5,100,000,000	5,106,783,000	
		国庫債券 利付(5年)第147回	5,600,000,000	5,590,928,000	
		国庫債券 利付(5年)第148回	7,300,000,000	7,280,947,000	
		国庫債券 利付(5年)第149回	6,100,000,000	6,075,051,000	
		国庫債券 利付(5年)第150回	6,300,000,000	6,263,838,000	
		国庫債券 利付(5年)第151回	5,500,000,000	5,458,420,000	
		国庫債券 利付(5年)第152回	4,000,000,000	3,985,720,000	
		国庫債券 利付(5年)第153回	11,500,000,000	11,395,350,000	
		国庫債券 利付(5年)第154回	4,000,000,000	3,974,720,000	
		国庫債券 利付(40年)第1回	2,860,000,000	3,470,810,200	
		国庫債券 利付(40年)第2回	2,700,000,000	3,156,732,000	
国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,062,882,000			
国庫債券 利付(40年)第4回	1,630,000,000	1,903,448,800			
国庫債券 利付(40年)第5回	1,200,000,000	1,347,924,000			

国庫債券 利付(40年)第6回	2,300,000,000	2,522,801,000	
国庫債券 利付(40年)第7回	2,000,000,000	2,096,200,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	1,500,000,000	1,457,910,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	4,050,000,000	2,874,082,500	
国庫債券 利付(40年)第10回	2,010,000,000	1,680,239,400	
国庫債券 利付(40年)第11回	1,750,000,000	1,409,187,500	
国庫債券 利付(40年)第12回	2,070,000,000	1,483,155,000	
国庫債券 利付(40年)第13回	6,270,000,000	4,458,032,700	
国庫債券 利付(40年)第14回	3,960,000,000	3,014,510,400	
国庫債券 利付(40年)第15回	2,000,000,000	1,660,740,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	3,600,000,000	3,626,928,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	6,600,000,000	6,658,080,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	5,600,000,000	5,646,480,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	2,750,000,000	2,775,300,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	3,000,000,000	3,015,720,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	9,000,000,000	9,072,090,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	7,000,000,000	7,061,530,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	4,200,000,000	4,240,068,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	5,900,000,000	5,942,126,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	4,550,000,000	4,556,552,000	
国庫債券 利付(10年)第343回	6,000,000,000	6,004,140,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	6,400,000,000	6,396,416,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	7,000,000,000	6,986,140,000	
国庫債券 利付(10年)第346回	8,600,000,000	8,569,298,000	
国庫債券 利付(10年)第347回	12,000,000,000	11,941,320,000	
国庫債券 利付(10年)第348回	6,800,000,000	6,757,024,000	
国庫債券 利付(10年)第349回	4,300,000,000	4,266,159,000	
国庫債券 利付(10年)第350回	10,150,000,000	10,053,270,500	
国庫債券 利付(10年)第351回	6,000,000,000	5,933,700,000	
国庫債券 利付(10年)第352回	5,400,000,000	5,334,606,000	

国庫債券 利付(10年)第353回	2,700,000,000	2,664,333,000
国庫債券 利付(10年)第354回	1,850,000,000	1,822,916,000
国庫債券 利付(10年)第355回	1,900,000,000	1,868,707,000
国庫債券 利付(10年)第356回	3,800,000,000	3,730,156,000
国庫債券 利付(10年)第357回	2,000,000,000	1,959,900,000
国庫債券 利付(10年)第358回	7,470,000,000	7,297,144,200
国庫債券 利付(10年)第359回	10,200,000,000	9,945,204,000
国庫債券 利付(10年)第360回	12,900,000,000	12,553,248,000
国庫債券 利付(10年)第361回	10,000,000,000	9,711,600,000
国庫債券 利付(10年)第362回	9,700,000,000	9,408,224,000
国庫債券 利付(10年)第363回	11,450,000,000	11,090,928,000
国庫債券 利付(10年)第364回	10,150,000,000	9,822,561,000
国庫債券 利付(10年)第365回	12,000,000,000	11,617,320,000
国庫債券 利付(10年)第366回	1,800,000,000	1,766,376,000
国庫債券 利付(10年)第367回	7,000,000,000	6,850,200,000
国庫債券 利付(30年)第1回	500,000,000	580,370,000
国庫債券 利付(30年)第2回	500,000,000	569,715,000
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	181,702,400
国庫債券 利付(30年)第4回	1,400,000,000	1,664,152,000
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	171,232,500
国庫債券 利付(30年)第6回	600,000,000	700,404,000
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	700,044,000
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	112,426,000
国庫債券 利付(30年)第9回	265,000,000	287,535,600
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	263,695,000
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	178,318,400
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	254,295,800
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	332,166,000
国庫債券 利付(30年)第14回	800,000,000	950,968,000
国庫債券 利付(30年)第15回	900,000,000	1,080,747,000
国庫債券 利付(30年)第16回	915,000,000	1,100,113,650
国庫債券 利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,430,232,000
国庫債券 利付(30年)第18回	2,200,000,000	2,597,914,000
国庫債券 利付(30年)第19回	2,050,000,000	2,423,653,500

国庫債券	利付（30年）第20回	1,270,000,000	1,532,737,600
国庫債券	利付（30年）第21回	300,000,000	355,215,000
国庫債券	利付（30年）第22回	600,000,000	726,348,000
国庫債券	利付（30年）第23回	1,840,000,000	2,228,718,400
国庫債券	利付（30年）第24回	700,000,000	848,274,000
国庫債券	利付（30年）第25回	500,000,000	593,185,000
国庫債券	利付（30年）第26回	850,000,000	1,019,804,500
国庫債券	利付（30年）第27回	2,950,000,000	3,582,568,500
国庫債券	利付（30年）第28回	1,500,000,000	1,822,620,000
国庫債券	利付（30年）第29回	2,000,000,000	2,401,820,000
国庫債券	利付（30年）第30回	2,500,000,000	2,964,100,000
国庫債券	利付（30年）第31回	1,700,000,000	1,989,544,000
国庫債券	利付（30年）第32回	2,500,000,000	2,964,525,000
国庫債券	利付（30年）第33回	2,400,000,000	2,730,600,000
国庫債券	利付（30年）第34回	2,800,000,000	3,275,076,000
国庫債券	利付（30年）第35回	2,300,000,000	2,617,423,000
国庫債券	利付（30年）第36回	2,000,000,000	2,280,240,000
国庫債券	利付（30年）第37回	2,300,000,000	2,577,403,000
国庫債券	利付（30年）第38回	1,600,000,000	1,764,864,000
国庫債券	利付（30年）第39回	1,400,000,000	1,568,840,000
国庫債券	利付（30年）第40回	1,300,000,000	1,433,055,000
国庫債券	利付（30年）第41回	1,500,000,000	1,624,335,000
国庫債券	利付（30年）第42回	1,600,000,000	1,730,944,000
国庫債券	利付（30年）第43回	1,300,000,000	1,406,197,000
国庫債券	利付（30年）第44回	1,400,000,000	1,512,826,000
国庫債券	利付（30年）第45回	1,700,000,000	1,770,227,000
国庫債券	利付（30年）第46回	1,800,000,000	1,873,386,000
国庫債券	利付（30年）第47回	1,700,000,000	1,799,671,000
国庫債券	利付（30年）第48回	1,900,000,000	1,935,017,000
国庫債券	利付（30年）第49回	2,900,000,000	2,948,691,000
国庫債券	利付（30年）第50回	2,400,000,000	2,149,464,000
国庫債券	利付（30年）第51回	3,650,000,000	2,891,931,500
国庫債券	利付（30年）第52回	2,200,000,000	1,824,526,000
国庫債券	利付（30年）第53回	1,700,000,000	1,439,033,000
国庫債券	利付（30年）第54回	1,700,000,000	1,504,568,000
国庫債券	利付（30年）第55回	1,500,000,000	1,323,840,000
国庫債券	利付（30年）第56回	1,700,000,000	1,496,119,000
国庫債券	利付（30年）第57回	1,600,000,000	1,404,128,000
国庫債券	利付（30年）第58回	2,100,000,000	1,835,988,000
国庫債券	利付（30年）第59回	1,600,000,000	1,360,272,000
国庫債券	利付（30年）第60回	1,150,000,000	1,023,787,500
国庫債券	利付（30年）第61回	1,500,000,000	1,266,180,000

国庫債券	利付(30年)第62回	3,000,000,000	2,394,750,000
国庫債券	利付(30年)第63回	3,000,000,000	2,321,760,000
国庫債券	利付(30年)第64回	3,300,000,000	2,544,234,000
国庫債券	利付(30年)第65回	2,200,000,000	1,708,916,000
国庫債券	利付(30年)第66回	2,000,000,000	1,549,220,000
国庫債券	利付(30年)第67回	3,000,000,000	2,420,430,000
国庫債券	利付(30年)第68回	1,950,000,000	1,567,897,500
国庫債券	利付(30年)第69回	2,200,000,000	1,813,790,000
国庫債券	利付(30年)第70回	2,110,000,000	1,735,664,900
国庫債券	利付(30年)第71回	2,400,000,000	1,969,680,000
国庫債券	利付(30年)第72回	1,300,000,000	1,064,466,000
国庫債券	利付(30年)第73回	2,000,000,000	1,635,500,000
国庫債券	利付(30年)第74回	1,500,000,000	1,330,035,000
国庫債券	利付(30年)第75回	2,000,000,000	1,920,180,000
国庫債券	利付(30年)第76回	1,000,000,000	978,430,000
国庫債券	利付(20年)第67回	310,000,000	317,266,400
国庫債券	利付(20年)第68回	290,000,000	297,864,800
国庫債券	利付(20年)第69回	560,000,000	574,504,000
国庫債券	利付(20年)第70回	540,000,000	559,132,200
国庫債券	利付(20年)第71回	200,000,000	206,494,000
国庫債券	利付(20年)第72回	1,470,000,000	1,522,920,000
国庫債券	利付(20年)第73回	1,200,000,000	1,246,668,000
国庫債券	利付(20年)第74回	800,000,000	832,696,000
国庫債券	利付(20年)第75回	600,000,000	627,504,000
国庫債券	利付(20年)第76回	910,000,000	947,664,900
国庫債券	利付(20年)第77回	700,000,000	730,527,000
国庫債券	利付(20年)第78回	800,000,000	836,752,000
国庫債券	利付(20年)第79回	860,000,000	901,632,600
国庫債券	利付(20年)第80回	1,400,000,000	1,471,246,000
国庫債券	利付(20年)第81回	360,000,000	379,148,400
国庫債券	利付(20年)第82回	820,000,000	865,846,200
国庫債券	利付(20年)第83回	1,370,000,000	1,453,364,500
国庫債券	利付(20年)第84回	1,200,000,000	1,269,456,000
国庫債券	利付(20年)第85回	400,000,000	426,352,000
国庫債券	利付(20年)第86回	1,700,000,000	1,822,944,000
国庫債券	利付(20年)第87回	500,000,000	534,550,000
国庫債券	利付(20年)第88回	1,100,000,000	1,184,722,000
国庫債券	利付(20年)第89回	470,000,000	504,568,500
国庫債券	利付(20年)第90回	1,500,000,000	1,616,490,000
国庫債券	利付(20年)第91回	250,000,000	270,345,000
国庫債券	利付(20年)第92回	650,000,000	700,290,500
国庫債券	利付(20年)第93回	300,000,000	322,905,000
国庫債券	利付(20年)第94回	200,000,000	216,110,000

国庫債券 利付(20年)第95回	100,000,000	109,323,000	
国庫債券 利付(20年)第96回	400,000,000	433,740,000	
国庫債券 利付(20年)第97回	300,000,000	327,738,000	
国庫債券 利付(20年)第98回	300,000,000	326,334,000	
国庫債券 利付(20年)第99回	1,100,000,000	1,200,111,000	
国庫債券 利付(20年)第100回	820,000,000	901,573,600	
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	277,447,500	
国庫債券 利付(20年)第102回	1,500,000,000	1,670,700,000	
国庫債券 利付(20年)第103回	600,000,000	665,046,000	
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	439,048,000	
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,092,698,000	
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	442,820,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	331,530,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,749,376,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	986,517,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,219,174,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	894,336,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,000,844,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	2,000,000,000	2,228,700,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	1,700,000,000	1,900,124,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	1,000,000,000	1,124,530,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,238,644,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	1,400,000,000	1,566,628,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	557,285,000	
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	879,736,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	868,136,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	1,200,000,000	1,331,496,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	900,000,000	991,890,000	

国庫債券 利付(20年)第123回	1,500,000,000	1,691,325,000
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,119,840,000
国庫債券 利付(20年)第125回	1,400,000,000	1,595,006,000
国庫債券 利付(20年)第126回	1,200,000,000	1,347,564,000
国庫債券 利付(20年)第127回	500,000,000	557,515,000
国庫債券 利付(20年)第128回	800,000,000	894,376,000
国庫債券 利付(20年)第129回	1,300,000,000	1,442,753,000
国庫債券 利付(20年)第130回	2,200,000,000	2,447,456,000
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	883,264,000
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,439,646,000
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,562,456,000
国庫債券 利付(20年)第134回	1,900,000,000	2,125,359,000
国庫債券 利付(20年)第135回	700,000,000	776,832,000
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	770,630,000
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,113,130,000
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	875,968,000
国庫債券 利付(20年)第139回	1,000,000,000	1,104,050,000
国庫債券 利付(20年)第140回	3,000,000,000	3,343,380,000
国庫債券 利付(20年)第141回	2,600,000,000	2,896,582,000
国庫債券 利付(20年)第142回	950,000,000	1,067,401,000
国庫債券 利付(20年)第143回	1,300,000,000	1,435,642,000
国庫債券 利付(20年)第144回	1,300,000,000	1,423,019,000
国庫債券 利付(20年)第145回	2,300,000,000	2,563,327,000
国庫債券 利付(20年)第146回	2,400,000,000	2,674,248,000
国庫債券 利付(20年)第147回	4,000,000,000	4,412,080,000
国庫債券 利付(20年)第148回	2,100,000,000	2,292,759,000
	4,350,000,000	4,744,980,000

国庫債券 利付(20年)第149回			
国庫債券 利付(20年)第150回	3,330,000,000	3,592,437,300	
国庫債券 利付(20年)第151回	3,000,000,000	3,164,040,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	2,650,000,000	2,789,787,500	
国庫債券 利付(20年)第153回	2,100,000,000	2,233,056,000	
国庫債券 利付(20年)第154回	2,820,000,000	2,960,577,000	
国庫債券 利付(20年)第155回	3,850,000,000	3,942,862,000	
国庫債券 利付(20年)第156回	5,150,000,000	4,880,191,500	
国庫債券 利付(20年)第157回	6,040,000,000	5,548,404,400	
国庫債券 利付(20年)第158回	3,470,000,000	3,308,436,800	
国庫債券 利付(20年)第159回	3,010,000,000	2,899,653,400	
国庫債券 利付(20年)第160回	3,000,000,000	2,920,620,000	
国庫債券 利付(20年)第161回	3,100,000,000	2,967,537,000	
国庫債券 利付(20年)第162回	1,700,000,000	1,621,001,000	
国庫債券 利付(20年)第163回	2,600,000,000	2,470,936,000	
国庫債券 利付(20年)第164回	3,600,000,000	3,357,684,000	
国庫債券 利付(20年)第165回	2,200,000,000	2,044,328,000	
国庫債券 利付(20年)第166回	2,300,000,000	2,195,741,000	
国庫債券 利付(20年)第167回	2,600,000,000	2,396,108,000	
国庫債券 利付(20年)第168回	2,700,000,000	2,438,073,000	
国庫債券 利付(20年)第169回	4,130,000,000	3,653,769,700	
国庫債券 利付(20年)第170回	4,300,000,000	3,787,139,000	
国庫債券 利付(20年)第171回	4,000,000,000	3,507,000,000	
国庫債券 利付(20年)第172回	3,340,000,000	2,969,126,400	
国庫債券 利付(20年)第173回	4,250,000,000	3,764,140,000	
国庫債券 利付(20年)第174回	6,970,000,000	6,145,727,800	
	5,500,000,000	4,919,640,000	

		国庫債券 利付(20年)第175回			
		国庫債券 利付(20年)第176回	6,020,000,000	5,365,626,000	
		国庫債券 利付(20年)第177回	5,070,000,000	4,423,017,300	
		国庫債券 利付(20年)第178回	3,750,000,000	3,325,650,000	
		国庫債券 利付(20年)第179回	5,000,000,000	4,424,700,000	
		国庫債券 利付(20年)第180回	2,000,000,000	1,869,160,000	
		国庫債券 利付(20年)第181回	1,500,000,000	1,425,570,000	
		国庫債券 利付(20年)第182回	1,500,000,000	1,471,365,000	
		メキシコ合衆国 第19回円貨社債(2014)	200,000,000	201,448,000	
		ハンガリー円貨債券(2020)第8回	100,000,000	98,844,000	
	小計	銘柄数: 269 組入時価比率: 81.0%	716,550,000,000	710,715,541,750 81.6%	
	合計			710,715,541,750	
地方債証券	日本円	東京都 公募第731回	100,000,000	100,643,000	
		東京都 公募第736回	100,000,000	100,614,000	
		東京都 公募第745回	300,000,000	302,802,000	
		東京都 公募第760回	100,000,000	99,278,000	
		東京都 公募第761回	100,000,000	99,389,000	
		東京都 公募第769回	500,000,000	497,235,000	
		東京都 公募第778回	100,000,000	98,699,000	
		東京都 公募第784回	200,000,000	197,690,000	
		東京都 公募第813回	200,000,000	192,842,000	
		東京都 公募第822回	130,000,000	123,875,700	
		東京都 公募第830回	400,000,000	384,000,000	
		東京都 公募(30年)第7回	100,000,000	119,581,000	
		東京都 公募第10回	200,000,000	233,276,000	
		東京都 公募(20年)第3回	200,000,000	205,270,000	
		東京都 公募第7回	100,000,000	105,425,000	
		東京都 公募(20年)第13回	100,000,000	108,609,000	
		東京都 公募(20年)第16回	200,000,000	217,810,000	
		東京都 公募(20年)第17回	200,000,000	218,740,000	
		東京都 公募(20年)第20回	180,000,000	198,282,600	
		東京都 公募第23回	100,000,000	111,301,000	
		東京都 公募(20年)第26回	100,000,000	109,221,000	
		東京都 公募(20年)第28回	100,000,000	108,278,000	
		東京都 公募(20年)第29回	200,000,000	216,576,000	

東京都	公募（20年）第30回	100,000,000	107,500,000
東京都	公募（5年）第31回	300,000,000	299,403,000
東京都	公募（5年）第32回	300,000,000	298,959,000
北海道	公募平成26年度第13回	100,000,000	100,600,000
北海道	公募平成27年度第7回	100,000,000	100,941,000
北海道	公募平成29年度第5回	200,000,000	198,530,000
北海道	公募平成29年度第7回	100,000,000	99,285,000
北海道	公募平成29年度第9回	100,000,000	99,167,000
北海道	公募平成30年度第15回	246,240,000	238,119,004
北海道	公募平成30年度第18回	200,000,000	195,758,000
北海道	公募令和2年度第4回	300,000,000	290,109,000
北海道	公募令和4年度第5回	100,000,000	96,015,000
宮城県	公募第31回1号	300,000,000	302,838,000
宮城県	公募第32回2号	100,000,000	99,497,000
神奈川県	公募第205回	100,000,000	100,679,000
神奈川県	公募第206回	100,000,000	100,761,000
神奈川県	公募第208回	100,000,000	100,609,000
神奈川県	公募第210回	200,000,000	201,170,000
神奈川県	公募第212回	100,000,000	100,588,000
神奈川県	公募第231回	200,000,000	198,284,000
神奈川県	公募第243回	200,000,000	193,478,000
神奈川県	公募第247回	200,000,000	192,982,000
神奈川県	公募第258回	100,000,000	96,133,000
神奈川県	公募（30年）第3回	100,000,000	120,972,000
神奈川県	公募第7回	300,000,000	324,000,000
神奈川県	公募（20年）第14回	100,000,000	109,917,000
神奈川県	公募（20年）第17回	200,000,000	221,666,000
神奈川県	公募（20年）第20回	100,000,000	108,870,000
神奈川県	公募（20年）第21回	200,000,000	218,652,000
神奈川県	公募（20年）第26回	100,000,000	107,117,000
大阪府	公募第381回	100,000,000	100,666,000
大阪府	公募第382回	100,000,000	100,686,000
大阪府	公募第383回	100,000,000	100,744,000
大阪府	公募第384回	100,000,000	100,753,000
大阪府	公募第387回	300,000,000	301,830,000
大阪府	公募第389回	100,000,000	100,680,000
大阪府	公募第396回	200,000,000	201,874,000
大阪府	公募第417回	102,000,000	101,721,540
大阪府	公募第423回	100,000,000	99,170,000
大阪府	公募第429回	179,000,000	176,982,670
大阪府	公募第452回	100,000,000	96,402,000
大阪府	公募第467回	140,000,000	134,402,800

大阪府 公募第469回	150,000,000	143,404,500
大阪府 公募第479回	200,000,000	192,392,000
大阪府 公募第5回	100,000,000	111,096,000
大阪府 公募第8回	100,000,000	110,043,000
大阪府 公募(5年)第173回	200,000,000	199,126,000
大阪府 公募(5年)第174回	200,000,000	199,074,000
大阪府 公募(5年)第178回	400,000,000	397,688,000
大阪府 公募(5年)第184回	400,000,000	396,940,000
大阪府 公募(5年)第190回	200,000,000	197,720,000
京都府 公募平成25年度第15回	200,000,000	201,348,000
京都府 公募平成26年度第5回	100,000,000	106,822,000
京都府 公募平成26年度第7回	200,000,000	201,446,000
京都府 公募(20年)平成27年度第5回	200,000,000	207,484,000
京都府 公募(15年)平成27年度第8回	100,000,000	101,221,000
京都府 公募(15年)平成28年度第2回	200,000,000	192,896,000
京都府 公募(20年)平成28年度第5回	100,000,000	91,814,000
京都府 公募平成29年度第4回	100,000,000	99,357,000
兵庫県 公募平成26年度第17回	100,000,000	100,659,000
兵庫県 公募平成29年度第22回	100,000,000	98,931,000
兵庫県 公募(30年)第2回	200,000,000	235,030,000
兵庫県 公募(15年)第1回	300,000,000	315,420,000
兵庫県 公募(15年)第3回	200,000,000	209,108,000
兵庫県 公募(12年)第3回	300,000,000	302,787,000
兵庫県 公募(15年)第8回	100,000,000	103,610,000
兵庫県 公募(15年)第11回	100,000,000	100,800,000
兵庫県 公募第2回	100,000,000	109,396,000
兵庫県 公募第9回	100,000,000	111,425,000
兵庫県 公募(20年)第11回	200,000,000	217,980,000
兵庫県 公募(20年)第14回	100,000,000	109,221,000
兵庫県 公募(20年)第21回	100,000,000	107,796,000
兵庫県 公募(20年)第22回	100,000,000	106,181,000
静岡県 公募平成26年度第3回	165,000,000	166,282,050
静岡県 公募平成26年度第8回	100,000,000	100,721,000
静岡県 公募平成26年度第9回	200,000,000	201,472,000
静岡県 公募平成27年度第11回	115,400,000	115,139,196
静岡県 公募平成28年度第2回	300,000,000	299,034,000
静岡県 公募平成29年度第3回	100,000,000	99,398,000
静岡県 公募(31年)第1回	174,000,000	169,796,160
静岡県 公募(5年)令和3年度第2回	100,000,000	99,453,000
	300,000,000	297,873,000

静岡県 公募(5年)令和3年度第5回			
静岡県 公募(15年)第2回	200,000,000	209,538,000	
静岡県 公募(15年)第5回	200,000,000	207,146,000	
静岡県 公募(15年)第9回	100,000,000	100,918,000	
静岡県 公募(20年)第11回	100,000,000	109,138,000	
静岡県 公募(20年)第14回	200,000,000	218,372,000	
静岡県 公募(20年)第18回	100,000,000	107,061,000	
静岡県 公募(20年)第30回	200,000,000	174,952,000	
愛知県 公募平成20年度第8回	100,000,000	109,079,000	
愛知県 公募(20年)平成22年度第8回	200,000,000	218,904,000	
愛知県 公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	108,732,000	
愛知県 公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	417,904,000	
愛知県 公募平成24年度第17回	100,000,000	110,665,000	
愛知県 公募(30年)平成25年度第8回	120,000,000	134,612,400	
愛知県 公募(20年)平成25年度第17回	100,000,000	108,697,000	
愛知県 公募平成26年度第8回	100,000,000	107,899,000	
愛知県 公募平成26年度第13回	100,000,000	105,710,000	
愛知県 公募平成26年度第17回	300,000,000	301,998,000	
愛知県 公募(15年)平成27年度第2回	300,000,000	302,958,000	
愛知県 公募平成27年度第15回	100,000,000	100,849,000	
愛知県 公募平成29年度第8回	100,000,000	99,284,000	
愛知県 公募平成29年度第9回	100,000,000	99,046,000	
愛知県 公募平成30年度第7回	200,000,000	197,046,000	
愛知県 公募令和3年度第10回	200,000,000	198,124,000	
広島県 公募平成26年度第5回	109,650,000	110,049,126	
広島県 公募平成26年度第7回	200,000,000	201,364,000	
広島県 公募平成29年度第3回	100,000,000	99,016,000	
広島県 公募平成29年度第4回	211,300,000	209,715,250	
広島県 公募平成30年度第6回	300,000,000	299,727,000	
広島県 公募令和2年度第2回	100,000,000	96,743,000	
広島県 公募令和2年度第7回	300,000,000	289,656,000	
埼玉県 公募平成25年度第10回	100,000,000	100,661,000	
埼玉県 公募平成25年度第11回	100,000,000	100,672,000	
埼玉県 公募平成26年度第3回	100,000,000	100,754,000	
埼玉県 公募平成26年度第6回	200,000,000	201,410,000	
埼玉県 公募平成26年度第7回	400,000,000	402,556,000	
埼玉県 公募平成26年度第9回	100,000,000	100,591,000	
埼玉県 公募平成27年度第9回	100,000,000	100,169,000	

埼玉県	公募平成28年度第5回	100,000,000	99,387,000
埼玉県	公募平成30年度第4回	200,000,000	197,416,000
埼玉県	公募令和元年度第4回	100,000,000	97,108,000
埼玉県	公募令和2年度第4回	300,000,000	290,022,000
埼玉県	公募(15年)第1回	100,000,000	102,641,000
埼玉県	公募(15年)第2回	200,000,000	203,750,000
埼玉県	公募(15年)第3回	100,000,000	97,904,000
埼玉県	公募(25年)第2回	200,000,000	181,396,000
埼玉県	公募(30年)第9回	200,000,000	171,472,000
埼玉県	公募(20年)第6回	100,000,000	110,129,000
埼玉県	公募(20年)第16回	100,000,000	103,580,000
埼玉県	公募(20年)第19回	100,000,000	94,071,000
埼玉県	公募(20年)第20回	100,000,000	94,739,000
福岡県	公募平成26年度第1回	100,000,000	100,770,000
福岡県	公募平成27年度第1回	300,000,000	303,120,000
福岡県	公募平成29年度第1回	100,000,000	99,401,000
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	104,762,000
福岡県	公募(15年)平成27年度第1回	200,000,000	202,424,000
福岡県	公募(15年)令和元年度第1回	100,000,000	93,842,000
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	121,147,000
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	108,116,000
福岡県	公募(30年・定時償還)平成29年度第2回	100,000,000	87,853,000
福岡県	公募(30年・定時償還)令和元年度第3回	100,000,000	75,531,000
福岡県	公募(20年)平成20年度第1回	300,000,000	329,997,000
福岡県	公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	109,137,000
福岡県	公募(20年)平成22年度第1回	300,000,000	325,461,000
福岡県	公募(20年)平成22年度第2回	300,000,000	334,506,000
福岡県	公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	108,370,000
千葉県	公募平成26年度第1回	100,000,000	100,735,000
千葉県	公募平成26年度第3回	200,000,000	201,484,000
千葉県	公募平成26年度第6回	120,000,000	120,447,600
千葉県	公募平成27年度第6回	200,000,000	201,724,000
千葉県	公募平成28年度第4回	200,000,000	198,846,000
千葉県	公募平成29年度第4回	100,000,000	99,018,000
千葉県	公募平成29年度第8回	100,000,000	98,874,000
千葉県	公募令和元年度第6回	300,000,000	291,015,000

千葉県 公募令和4年度第4回	100,000,000	96,759,000
千葉県 公募(20年)第1回	400,000,000	422,300,000
千葉県 公募(20年)第8回	100,000,000	111,200,000
千葉県 公募(20年)第13回	200,000,000	218,208,000
千葉県 公募(20年)第16回	200,000,000	216,012,000
千葉県 公募(20年)第17回	100,000,000	106,155,000
新潟県 公募平成30年度第2回	200,000,000	197,672,000
新潟県 公募令和2年度第2回	120,000,000	115,432,800
長野県 公募令和3年度第1回	300,000,000	288,891,000
茨城県 公募令和3年度第3回	200,000,000	198,374,000
群馬県 公募第12回	100,000,000	100,929,000
群馬県 公募(5年)第13回	300,000,000	297,576,000
群馬県 公募(20年)第3回	100,000,000	108,717,000
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	187,993,490
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	100,722,000
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	100,676,000
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	201,484,000
共同発行市場地方債 公募第137回	500,000,000	503,480,000
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	156,114,450
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	543,412,800
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,005,820,000
共同発行市場地方債 公募第152回	400,000,000	403,680,000
共同発行市場地方債 公募第154回	300,000,000	302,034,000
共同発行市場地方債 公募第156回	200,000,000	199,480,000
共同発行市場地方債 公募第157回	300,000,000	298,938,000
共同発行市場地方債 公募第161回	300,000,000	298,158,000
共同発行市場地方債 公募第172回	600,000,000	596,880,000
共同発行市場地方債 公募第184回	100,000,000	98,500,000
共同発行市場地方債 公募第186回	400,000,000	395,280,000
共同発行市場地方債 公募第188回	300,000,000	296,520,000
共同発行市場地方債 公募第190回	610,000,000	598,269,700
共同発行市場地方債 公募第191回	100,000,000	97,907,000

共同発行市場地方債 公募第194回	200,000,000	195,026,000	
共同発行市場地方債 公募第196回	400,000,000	388,156,000	
共同発行市場地方債 公募第197回	300,000,000	290,922,000	
共同発行市場地方債 公募第200回	100,000,000	96,837,000	
共同発行市場地方債 公募第206回	300,000,000	289,911,000	
共同発行市場地方債 公募第213回	300,000,000	287,901,000	
共同発行市場地方債 公募第215回	400,000,000	384,164,000	
共同発行市場地方債 公募第228回	300,000,000	286,647,000	
共同発行市場地方債 公募第229回	250,000,000	241,087,500	
共同発行市場地方債 公募第234回	300,000,000	290,142,000	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	110,112,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	105,091,000	
堺市 公募第3回	100,000,000	95,333,000	
長崎県 公募令和元年度第3回	100,000,000	97,077,000	
長崎県 公募令和4年度第3回	100,000,000	96,791,000	
島根県 公募(30年)平成29年度第1回	100,000,000	88,079,000	
佐賀県 公募平成28年度第1回	100,000,000	99,263,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	201,322,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	142,938,620	
熊本県 公募平成28年度第2回	132,000,000	131,021,880	
熊本市 公募平成29年度第1回	100,000,000	99,078,000	
新潟市 公募平成29年度第1回	100,000,000	99,091,000	
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	100,372,000	
大阪市 公募平成26年度第5回	100,000,000	100,774,000	
大阪市 公募平成27年度第6回	100,000,000	100,847,000	
大阪市 公募令和2年度第2回	300,000,000	289,917,000	
大阪市 公募令和3年度第2回	300,000,000	288,060,000	
大阪市 公募(15年)第1回	100,000,000	105,442,000	
大阪市 公募(20年)第1回	300,000,000	327,813,000	
大阪市 公募(20年)第5回	100,000,000	111,336,000	
大阪市 公募(20年)第6回	100,000,000	110,101,000	
大阪市 公募(20年)第17回	200,000,000	219,350,000	
大阪市 公募(20年)第26回	100,000,000	94,255,000	
名古屋市 公募第488回	300,000,000	302,349,000	
名古屋市 公募第489回	100,000,000	100,605,000	
名古屋市 公募第501回	200,000,000	198,264,000	

名古屋市 公募第503回	100,000,000	98,899,000	
名古屋市 公募第504回	200,000,000	197,424,000	
名古屋市 公募第511回	200,000,000	192,702,000	
名古屋市 公募第512回	300,000,000	290,118,000	
名古屋市 公募(12年)第1回	200,000,000	204,342,000	
名古屋市 公募(15年)第2回	100,000,000	102,464,000	
名古屋市 公募(20年)第19回	100,000,000	92,197,000	
京都市 公募平成29年度第1回	100,000,000	99,356,000	
京都市 公募平成29年度第4回	101,280,000	100,419,120	
京都市 公募(20年)第2回	100,000,000	105,302,000	
京都市 公募(20年)第5回	200,000,000	216,466,000	
京都市 公募(20年)第6回	100,000,000	109,443,000	
京都市 公募(20年)第13回	100,000,000	105,680,000	
京都市 公募(20年)第15回	200,000,000	186,864,000	
神戸市 公募平成26年度第17回	300,000,000	300,780,000	
神戸市 公募平成28年度第1回	200,000,000	199,298,000	
神戸市 公募平成30年度第2回	200,000,000	171,472,000	
横浜市 公募公債平成26年度5回	200,000,000	201,256,000	
横浜市 公募平成28年度第5回	300,000,000	299,148,000	
横浜市 公募平成29年度第3回	100,000,000	99,428,000	
横浜市 公募2019年度第3回	200,000,000	193,566,000	
横浜市 公募(30年)第2回	200,000,000	237,046,000	
横浜市 公募(20年)第11回	100,000,000	107,603,000	
横浜市 公募(20年)第18回	100,000,000	110,597,000	
横浜市 公募(20年)第26回	100,000,000	110,239,000	
横浜市 公募(20年)第30回	100,000,000	105,874,000	
札幌市 公募(15年)平成23年度第9回	200,000,000	209,748,000	
札幌市 公募(20年)平成24年度第1回	100,000,000	109,707,000	
札幌市 公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	110,282,000	
札幌市 公募平成26年度第4回	100,000,000	100,593,000	
札幌市 公募平成26年度第9回	200,000,000	201,086,000	
札幌市 公募(5年)令和3年度第8回	100,000,000	95,677,000	
札幌市 公募(5年)令和4年度第4回	100,000,000	97,441,000	
川崎市 公募(20年)第14回	100,000,000	109,516,000	
川崎市 公募(20年)第17回	100,000,000	107,776,000	
川崎市 公募(20年)第19回	100,000,000	105,740,000	
川崎市 公募(30年)第11回	100,000,000	85,161,000	
北九州市 公募(10年)令和2年度第2回	200,000,000	191,790,000	
北九州市 公募(20年)第3回	200,000,000	218,310,000	

	北九州市 公募（20年）第14回	100,000,000	109,407,000	
	福岡市 公募（20年）平成21年度第3回	200,000,000	221,020,000	
	福岡市 公募（20年）平成23年度第4回	100,000,000	110,215,000	
	福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	107,254,000	
	福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	100,713,000	
	福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	161,108,800	
	福岡市 公募（5年）2020年度第9回	300,000,000	298,434,000	
	広島市 公募平成26年度第2回	100,000,000	100,599,000	
	広島市 公募平成27年度第2回	500,000,000	504,235,000	
	広島市 公募（10年）平成30年度第6回	241,000,000	236,040,220	
	広島市 公募（10年）令和3年度第6回	100,000,000	96,143,000	
	千葉県 公募平成26年度第2回	200,000,000	201,358,000	
	三重県 公募平成28年度第1回	155,000,000	154,299,400	
	福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	199,288,000	
	福井県 公募令和元年度第3回	200,000,000	193,468,000	
	福井県 公募令和4年度第5回	100,000,000	96,764,000	
	徳島県 公募平成29年度第2回	200,000,000	198,156,000	
	徳島県 公募平成30年度第2回	300,000,000	296,511,000	
	山梨県 公募令和元年度第1回	100,000,000	96,733,000	
	岡山県 公募平成28年度第2回	168,900,000	168,117,993	
	岡山県 公募令和2年度第3回	300,000,000	289,857,000	
	岡山県 公募令和3年度第1回	100,000,000	95,752,000	
	秋田県 公募令和3年度第1回	116,600,000	111,813,570	
	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	110,120,000	
	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	333,741,000	
	福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	109,689,000	
	福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	101,161,000	
	福岡北九州高速道路債券 第145回	100,000,000	93,330,000	
小計	銘柄数：313 組入時価比率：6.4%	55,321,040,000	55,942,432,939	6.4%
合計			55,942,432,939	
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	100,481,000
		新関西国際空港債券 政府保証第5回	117,000,000	116,360,010
		新関西国際空港社債 財投機関債第6回	300,000,000	314,022,000

新関西国際空港社債 財投機関債第9回	100,000,000	103,585,000	
新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	102,563,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	102,669,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第66回	400,000,000	398,072,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第78回	200,000,000	198,556,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第82回	100,000,000	99,329,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000	296,964,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第96回	200,000,000	196,436,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第101回	300,000,000	296,010,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第137回	400,000,000	397,432,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第138回	400,000,000	382,316,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第37回	400,000,000	397,652,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	300,000,000	297,279,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第52回	410,000,000	409,028,300	
日本政策投資銀行社債 政府保証第55回	300,000,000	294,180,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第75回	370,000,000	360,461,400	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第1回	400,000,000	504,884,000	
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	118,705,000	
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	214,226,000	
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	107,562,000	
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	326,409,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第26回	100,000,000	120,088,000	
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	250,280,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第39回	300,000,000	330,552,000	
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	111,228,000	
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	108,672,000	
	100,000,000	109,400,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第95回			
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	380,131,500	
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	110,208,000	
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	100,691,000	
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	100,674,000	
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	201,184,000	
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	201,094,000	
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	201,428,000	
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	298,938,000	
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	100,965,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第151回	100,000,000	103,129,000	
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	101,263,000	
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	101,910,000	
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	72,300,000	
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	93,249,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第204回	100,000,000	81,164,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第260回	200,000,000	153,360,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第90回	100,000,000	110,761,000	
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	221,728,000	
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	221,914,000	
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	223,340,000	
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	222,380,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第111回	100,000,000	110,624,000	
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	219,872,000	
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	113,796,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第146回	100,000,000	110,324,000	
	100,000,000	109,769,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第164回			
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	109,660,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第167回	100,000,000	109,856,000	
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	109,559,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	200,000,000	217,924,000	
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	333,258,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第176回	200,000,000	219,320,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第181回	100,000,000	109,895,000	
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	110,771,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第185回	200,000,000	221,656,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第196回	400,000,000	443,928,000	
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	137,959,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	745,000,000	750,319,300	
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	107,738,000	
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	107,121,000	
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	107,706,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	300,000,000	302,454,000	
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	107,005,000	
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	191,434,500	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第229回	630,000,000	634,977,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第233回	100,000,000	105,612,000	
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	100,701,000	
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	519,120,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第241回	200,000,000	201,510,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第245回	300,000,000	308,172,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第246回	100,000,000	103,796,000	
	400,000,000	402,876,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第258回			
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	403,827,050	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第271回	151,000,000	150,408,080	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第296回	200,000,000	188,988,000	
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	99,388,000	
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	400,791,560	
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	99,264,000	
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	595,560,000	
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	98,919,000	
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	87,207,000	
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	495,690,000	
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	129,481,710	
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	98,702,000	
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	197,146,000	
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	98,964,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第398回	100,000,000	76,909,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第28回	400,000,000	480,324,000	
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	121,380,000	
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	1,035,960,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	300,000,000	365,664,000	
地方公営企業等金融機構債券（20年）第1回	100,000,000	108,905,000	
地方公共団体金融機構債券（20年）第1回	300,000,000	331,827,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	100,000,000	110,195,000	
地方公共団体金融機構債券 F16回	100,000,000	106,735,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	300,000,000	333,468,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第7回	400,000,000	443,968,000	
	300,000,000	323,952,000	

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(20年)第20回	100,000,000	109,154,000	
地方公共団体金融機構債券 F104回	100,000,000	102,479,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	101,389,000	
地方公共団体金融機構債券 F122回	100,000,000	104,476,000	
地方公共団体金融機構債券 F124回	100,000,000	104,468,000	
地方公共団体金融機構債券 F132回	500,000,000	511,670,000	
地方公共団体金融機構債券 F142回	100,000,000	101,631,000	
地方公共団体金融機構債券 F145回	200,000,000	203,900,000	
地方公共団体金融機構債券 F147回	100,000,000	103,817,000	
地方公共団体金融機構債券 F160回	100,000,000	102,884,000	
地方公共団体金融機構債券(20年)第29回	100,000,000	108,800,000	
地方公共団体金融機構債券(15年)第2回	200,000,000	207,166,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第56回	591,000,000	595,408,860	
政保 地方公共団体金融機構債券第59回	116,000,000	116,882,760	
地方公共団体金融機構債券(20年)第38回	100,000,000	106,569,000	
地方公共団体金融機構債券 F240回	300,000,000	309,162,000	
地方公共団体金融機構債券 F248回	100,000,000	106,082,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第64回	100,000,000	100,743,000	
地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	100,715,000	
地方公共団体金融機構債券(20年)第39回	200,000,000	211,602,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第65回	400,000,000	403,092,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第69回	420,000,000	422,683,800	
地方公共団体金融機構債券(20年)第43回	100,000,000	102,604,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第72回	189,000,000	190,763,370	
地方公共団体金融機構債券 第74回	300,000,000	302,577,000	
	100,000,000	100,829,000	

地方公共団体金融機構債券 第77回			
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回	509,000,000	512,563,000	
地方公共団体金融機構債券 第79回	400,000,000	403,208,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第80回	300,000,000	301,662,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (8年) 第5回	500,000,000	500,655,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回	116,000,000	115,516,280	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第53回	200,000,000	178,668,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第91回	300,000,000	298,239,000	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第58回	100,000,000	95,452,000	
地方公共団体金融機構債券 第95回	200,000,000	198,362,000	
地方公共団体金融機構債券 第101回	400,000,000	395,916,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第108回	157,000,000	155,046,920	
政保 地方公共団体金融機構債券 第110回	100,000,000	98,582,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第113回	110,000,000	108,867,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第119回	116,000,000	113,226,440	
政保 地方公共団体金融機構債券 11回	500,000,000	499,130,000	
地方公共団体金融機構債券 12回	200,000,000	157,072,000	
公営企業債券(20年) 第19回 財投機関債	100,000,000	107,975,000	
公営企業債券(20年) 第20回 財投機関債	100,000,000	107,766,000	
公営企業債券(20年) 第23回 財投機関債	200,000,000	217,308,000	
公営企業債券(20年) 第24回 財投機関債	100,000,000	109,328,000	
公営企業債券(20年) 第25回 財投機関債	100,000,000	110,678,000	
首都高速道路 第28回	200,000,000	197,424,000	
阪神高速道路 第25回	100,000,000	99,041,000	
日本政策金融公庫債券 政府保証第63回	270,000,000	260,193,600	
都市再生債券 財投機関債第93回	100,000,000	103,196,000	
都市再生債券 財投機関債第96回	200,000,000	201,482,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	102,604,000	
都市再生債券 財投機関債第101回	100,000,000	102,055,000	

都市再生債券 財投機関債第109回	100,000,000	101,698,000	
都市再生債券 財投機関債第113回	300,000,000	303,441,000	
都市再生債券 財投機関債第121回	200,000,000	196,328,000	
都市再生債券 財投機関債第127回	100,000,000	99,169,000	
都市再生債券 財投機関債第155回	100,000,000	75,049,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	104,946,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第17回	400,000,000	400,044,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	160,364,510	
関西国際空港債券 政府保証第54回	300,000,000	332,793,000	
中部国際空港債券 政府保証第22回	300,000,000	299,775,000	
預金保険機構債券 政府保証第230回	600,000,000	599,952,000	
預金保険機構債券 政府保証第231回	300,000,000	299,946,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	400,000,000	431,136,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第6回	200,000,000	218,082,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	100,000,000	103,893,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第49回	100,000,000	110,306,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	100,000,000	109,472,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	100,000,000	110,849,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回	300,000,000	315,429,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	100,000,000	110,860,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第81回	100,000,000	109,947,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第85回	200,000,000	218,668,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回	200,000,000	209,780,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第94回	100,000,000	109,771,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第115回	100,000,000	109,738,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第120回	100,000,000	110,216,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第123回	200,000,000	219,310,000	

住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	114,735,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第132回	200,000,000	206,036,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第137回	100,000,000	104,239,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第143回	100,000,000	103,648,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第162回	100,000,000	103,883,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回	450,000,000	453,384,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第188回	300,000,000	298,398,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第198回	300,000,000	297,594,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第208回	200,000,000	198,328,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第223回	100,000,000	96,761,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第244回	130,000,000	128,100,700	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第277回	100,000,000	75,608,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第301回	300,000,000	298,266,000	
成田国際空港 第17回	400,000,000	401,916,000	
成田国際空港 第19回	100,000,000	99,854,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第6回	200,000,000	209,090,000	
商工債券 利付第829回い号	200,000,000	199,822,000	
商工債券 利付第831回い号	200,000,000	199,618,000	
商工債券 利付第833回い号	100,000,000	99,717,000	
商工債券 利付第845回い号	300,000,000	298,968,000	
商工債券 利付第852回い号	100,000,000	99,310,000	
商工債券 利付第854回い号	400,000,000	396,564,000	
商工債券 利付第856回い号	200,000,000	198,146,000	
商工債券 利付第868回い号	100,000,000	98,905,000	
しんきん中金債券 利付第374回	300,000,000	298,224,000	
しんきん中金債券 利付第377回	100,000,000	99,298,000	
しんきん中金債券 利付第379回	400,000,000	396,804,000	
しんきん中金債券 利付第380回	100,000,000	99,105,000	
商工債券 利付(3年)第258回	100,000,000	99,764,000	
商工債券 利付(10年)第15回	200,000,000	201,302,000	
商工債券 利付(10年)第41回	200,000,000	193,344,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関 債	200,000,000	221,130,000	
国際協力機構債券 第23回財投機 関債	100,000,000	100,641,000	

国際協力機構債券 第25回財投機関債	100,000,000	107,005,000	
国際協力機構債券 第32回財投機関債	100,000,000	102,624,000	
国際協力機構債券 第35回財投機関債	100,000,000	99,344,000	
東日本高速道路 第57回	100,000,000	99,140,000	
東日本高速道路 第61回	200,000,000	193,540,000	
東日本高速道路 第83回	200,000,000	197,868,000	
東日本高速道路 第86回	400,000,000	393,752,000	
中日本高速道路 第63回	100,000,000	100,736,000	
中日本高速道路 第79回	300,000,000	299,088,000	
中日本高速道路 第86回	100,000,000	99,168,000	
中日本高速道路 第89回	100,000,000	98,969,000	
中日本高速道路 第90回	300,000,000	296,580,000	
中日本高速道路 第91回	200,000,000	197,426,000	
西日本高速道路 第22回	400,000,000	402,812,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	100,573,000	
西日本高速道路 第30回	300,000,000	298,197,000	
西日本高速道路 第50回	200,000,000	199,470,000	
西日本高速道路 第64回	200,000,000	197,424,000	
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	201,336,000	
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	106,041,000	
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	503,345,000	
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	287,148,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第135回	300,000,000	288,693,000	
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	19,888,000	19,964,966	
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	22,904,000	23,286,038	
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	41,064,000	41,210,187	
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	39,368,000	39,577,831	
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	61,140,000	61,434,694	
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	10,994,000	11,129,775	
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	16,916,000	17,764,675	
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	56,274,000	58,894,117	
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	50,546,000	52,191,272	

貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	59,649,000	62,209,731
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	44,028,000	45,552,249
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	29,292,000	30,606,332
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	55,359,000	57,766,009
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	63,762,000	65,612,373
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	96,363,000	99,021,655
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	85,692,000	88,440,999
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	57,488,000	59,156,876
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	20,471,000	21,248,898
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	49,888,000	51,883,520
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	33,218,000	33,893,986
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	73,342,000	74,843,310
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	32,302,000	32,973,235
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	99,453,000	102,273,487
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	21,053,000	21,990,911
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	21,530,000	22,499,926
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	20,303,000	21,245,262
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	19,566,000	20,426,121
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	54,712,000	56,548,681
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	78,228,000	80,854,896
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	26,225,000	27,146,808
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	63,452,000	65,146,168
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	59,448,000	61,999,508
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	59,616,000	62,129,410
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	105,330,000	108,942,819
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	58,498,000	60,528,465
	104,736,000	107,313,552

貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	94,716,000	96,640,629	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	75,370,000	77,750,184	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	62,720,000	64,528,844	
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	156,800,000	159,722,752	
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	268,555,000	273,219,800	
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	41,559,000	42,082,643	
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	42,648,000	43,223,321	
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	43,836,000	44,248,496	
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	92,820,000	92,949,948	
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	98,486,000	97,753,264	
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	51,811,000	51,989,229	
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	55,542,000	55,530,336	
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	164,748,000	165,514,078	
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	170,769,000	172,087,336	
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	115,018,000	115,690,855	
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	55,907,000	56,110,501	
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	57,049,000	57,415,254	
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	216,900,000	211,056,714	
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	145,644,000	142,304,383	
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券	146,374,000	142,707,331	
貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券	72,980,000	71,239,427	
貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券	146,166,000	142,538,159	
貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券	73,460,000	71,287,787	
貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券	74,001,000	71,919,351	
貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券	75,388,000	73,344,231	
	300,704,000	291,673,858	

貸付債権担保第 1 2 5 回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第 1 2 6 回住宅金融支援機構債券	228,126,000	221,286,782	
貸付債権担保第 1 2 8 回住宅金融支援機構債券	152,254,000	147,593,505	
貸付債権担保第 1 2 9 回住宅金融支援機構債券	155,766,000	151,251,901	
貸付債権担保第 1 3 4 回住宅金融支援機構債券	158,156,000	152,574,674	
貸付債権担保第 1 3 5 回住宅金融支援機構債券	79,609,000	76,766,958	
貸付債権担保第 1 3 6 回住宅金融支援機構債券	79,781,000	77,192,904	
貸付債権担保第 1 4 0 回住宅金融支援機構債券	80,110,000	77,121,897	
貸付債権担保第 1 4 2 回住宅金融支援機構債券	247,731,000	237,224,728	
貸付債権担保第 1 4 4 回住宅金融支援機構債券	245,880,000	235,479,276	
貸付債権担保第 1 5 0 回住宅金融支援機構債券	432,335,000	409,412,598	
貸付債権担保第 1 5 2 回住宅金融支援機構債券	174,666,000	166,844,456	
貸付債権担保第 1 5 4 回住宅金融支援機構債券	176,212,000	167,774,969	
貸付債権担保第 1 6 4 回住宅金融支援機構債券	277,446,000	263,912,184	
貸付債権担保第 1 6 5 回住宅金融支援機構債券	183,790,000	175,436,744	
貸付債権担保第 1 6 6 回住宅金融支援機構債券	277,416,000	265,850,526	
貸付債権担保第 1 6 7 回住宅金融支援機構債券	186,108,000	178,230,048	
貸付債権担保第 1 6 8 回住宅金融支援機構債券	185,806,000	177,758,742	
貸付債権担保第 1 6 9 回住宅金融支援機構債券	280,908,000	268,371,075	
貸付債権担保第 1 7 0 回住宅金融支援機構債券	469,730,000	447,901,646	
貸付債権担保第 1 7 4 回住宅金融支援機構債券	286,395,000	273,292,428	
貸付債権担保第 1 7 5 回住宅金融支援機構債券	289,104,000	275,498,765	
貸付債権担保第 1 7 6 回住宅金融支援機構債券	289,386,000	274,563,649	
貸付債権担保第 1 7 7 回住宅金融支援機構債券	193,340,000	184,670,634	
貸付債権担保第 1 7 8 回住宅金融支援機構債券	290,115,000	279,200,873	
貸付債権担保第 1 7 9 回住宅金融支援機構債券	291,327,000	279,548,649	
	194,848,000	187,699,026	

		貸付債権担保第180回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第183回住宅金融支援機構債券	592,194,000	570,803,952	
		貸付債権担保第185回住宅金融支援機構債券	298,293,000	288,664,101	
		貸付債権担保第186回住宅金融支援機構債券	199,690,000	195,919,852	
	小計	銘柄数：336 組入時価比率：7.3%	62,674,591,000	63,664,142,645	7.3%
	合計			63,664,142,645	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行(BFCM)第24回円貨社債	100,000,000	99,247,000	
		フランス相互信用連合銀行(BFCM)第29回円貨社債	200,000,000	198,200,000	
		フランス相互信用連合銀行(BFCM)第31回円貨社債	100,000,000	93,850,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー第14回円貨社債	100,000,000	97,671,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー第6回非上位円貨社債	200,000,000	200,640,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー第4回非上位円貨社債	200,000,000	200,652,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー第25回非上位円貨社債	200,000,000	193,250,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー第6回円貨社債(2014)	100,000,000	100,084,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー第16回円貨社債(2018)	100,000,000	95,827,000	
		マラヤン・バンキング・ベルハッド第4回円貨社債(2019)	100,000,000	99,578,000	
		スタンダード・チャータード第3回円貨社債(2015)	100,000,000	99,405,000	
		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	97,790,000	
		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	95,221,000	
		サンタンデル銀行第1回円貨社債	100,000,000	98,613,000	
		フランス電力第4回円貨社債(2017)	100,000,000	96,604,000	
		ビー・エヌ・ビー・パリバ第1回円貨社債(2017)	100,000,000	99,990,000	
		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	199,770,000	
		INPEX第1回社債間限定同順位特約付	500,000,000	496,545,000	
		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	194,708,000	
		五洋建設第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,069,000	

大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	93,344,000	
大和ハウス工業 第25回特定社債間限定同順位特約付	300,000,000	287,943,000	
明治ホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,344,000	
アサヒグループホールディングス 第16回特定社債間限定同順位	300,000,000	297,651,000	
麒麟ホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,726,000	
コカ・コーラボトラーズジャパン 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,222,000	
コカ・コーラボトラーズジャパン 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,749,000	
味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,982,000	
日本たばこ産業 第13回	100,000,000	98,157,000	
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	98,626,000	
森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特	200,000,000	198,654,000	
森ビル 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	92,041,000	
東急不動産ホールディングス 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,490,000	
セブン&アイ・ホールディングス 第14回社債間限定同順位特約	600,000,000	597,414,000	
セブン&アイ・ホールディングス 第15回社債間限定同順位特約	200,000,000	197,392,000	
東レ 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,220,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,441,000	
旭化成 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,704,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付	200,000,000	195,904,000	
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	99,118,000	
王子ホールディングス 第42回社債間限定同順位特約付	600,000,000	596,118,000	
日本製紙 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	93,424,000	
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,953,000	
イビデン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,596,000	
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,502,000	
J S R 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,015,000	
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	97,467,000	

三菱ケミカルホールディングス 第33回社債間限定同順位特約付	200,000,000	192,638,000	
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	89,130,000	
ダイセル 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,332,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,880,000	
電通 第6回社債間限定同順位特約付	300,000,000	294,582,000	
武田薬品工業 第16回社債間限定同順位特約付	200,000,000	189,098,000	
アステラス製薬 第1回無担保社債間限定	100,000,000	99,909,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,871,000	
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	99,644,000	
オリエンタルランド 第18回社債間限定同順位特約付	200,000,000	192,746,000	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,725,000	
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	197,604,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	84,949,000	
楽天 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,256,000	
出光興産 第14回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,834,000	
JXホールディングス 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,552,000	
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,206,000	
住友理工 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,648,000	
日本碍子 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,444,000	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	300,000,000	296,052,000	
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	99,640,000	
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	99,894,000	
三菱マテリアル 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,139,000	
住友金属鉱山 第33回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,148,000	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,100,000	
日立建機 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,412,000	
	100,000,000	99,438,000	

荏原製作所 第10回社債間限定同順位特約付			
ダイキン工業 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,587,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	208,100,000	
セイコーエプソン 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,626,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,986,000	
パナソニック 第21回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,434,000	
パナソニック 第22回社債間限定同順位特約付	200,000,000	196,528,000	
パナソニック 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,177,000	
T D K 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,884,000	
デンソー 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,844,000	
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	98,733,000	
三菱重工業 第35回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,838,000	
三菱重工業 第38回社債間限定同順位特約付（第2回グリーンボ	300,000,000	296,469,000	
J A 三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,891,000	
三井住友トラスト・パナソニックファイナンス 第9回社債間限定	100,000,000	99,281,000	
トヨタ自動車 第26回社債間限定同順位特約付	700,000,000	694,400,000	
トヨタ自動車 第27回社債間限定同順位特約付	300,000,000	288,312,000	
楽天カード 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,371,000	
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	100,193,000	
ニコン 第22回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,286,000	
丸紅 第113回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,288,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,975,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,958,000	
三井物産 第64回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,881,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,822,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,376,000	
	100,000,000	98,959,000	

住友商事 第53回社債間限定同順位特約付			
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,788,000	
クレディセゾン 第65回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,782,000	
クレディセゾン 第76回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,547,000	
イオン 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,755,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付	100,000,000	100,557,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第7回劣後特約付	100,000,000	102,142,000	
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	99,512,000	
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	200,000,000	200,998,000	
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	108,856,000	
三菱東京UFJ銀行 第23回劣後特約付	100,000,000	112,290,000	
三菱東京UFJ銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	108,597,000	
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	301,422,000	
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	100,685,000	
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	101,716,000	
三井住友信託銀行 第18回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,346,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,520,000	
セブン銀行 第12回社債間限定同順位特約付	300,000,000	297,126,000	
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	201,030,000	
みずほ銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	107,768,000	
みずほリース 第3回社債間限定同順位特約付	300,000,000	298,398,000	
みずほリース 第7回社債間限定同順位特約付	200,000,000	195,624,000	
NTTファイナンス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,443,000	
NTTファイナンス 第16回日本電信電話保証付	100,000,000	99,613,000	
NTTファイナンス 第17回日本電信電話保証付	200,000,000	197,824,000	
NTTファイナンス 第18回日本電信電話保証付	300,000,000	292,677,000	
東京センチュリー 第33回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,622,000	

ホンダファイナンス 第63回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	99,602,000	
ホンダファイナンス 第69回社債 間限定同順位特約付	200,000,000	198,098,000	
SBIホールディングス 第26回 社債間限定同順位特約付	200,000,000	197,448,000	
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	98,751,000	
トヨタファイナンス 第96回社債 間限定同順位特約付	800,000,000	794,072,000	
リコーリース 第28回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	98,591,000	
イオンフィナンシャルサービス 第 6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,836,000	
アコム 第78回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,256,000	
オリエントコーポレーション 第3 2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,165,000	
日立キャピタル 第61回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	99,395,000	
日立キャピタル 第80回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	96,402,000	
オリックス 第202回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	95,537,000	
三井住友ファイナンス&リース 第 27回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,818,000	
三菱UFJリース 第52回社債間 限定同順位特約付	300,000,000	296,709,000	
三菱UFJリース 第56回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	98,880,000	
三菱UFJリース 第76回社債間 限定同順位特約付	300,000,000	290,322,000	
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	100,978,000	
大和証券グループ本社 第36回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	98,949,000	
三井住友海上火災保険 第7回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	98,981,000	
三井不動産 第60回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	98,428,000	
三井不動産 第68回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,729,000	
三井不動産 第71回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	193,194,000	
三菱地所 第93回担保提供制限等 財務上特約無	200,000,000	221,270,000	
三菱地所 第120回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	98,892,000	
三菱地所 第129回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	99,264,000	
三菱地所 第135回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	95,384,000	
	100,000,000	99,475,000	

東京建物 第25回社債間限定同順位特約付			
ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	88,661,000	
住友不動産 第109回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,722,000	
イオンモール 第22回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,399,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,930,000	
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	110,754,000	
森トラスト総合リート投資法人 第13回	100,000,000	99,822,000	
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	100,752,000	
相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付	200,000,000	201,006,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,611,000	
東京急行電鉄 第83回社債間限定同順位特約付	200,000,000	193,202,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,576,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	93,664,000	
京成電鉄 第58回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,138,000	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	200,000,000	219,822,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,074,000	
東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,615,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,193,000	
東日本旅客鉄道 第119回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,780,000	
東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付	100,000,000	83,325,000	
東日本旅客鉄道 第145回社債間限定同順位特約付	200,000,000	140,422,000	
東日本旅客鉄道 第147回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,196,000	
東日本旅客鉄道 第153回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,692,000	
東日本旅客鉄道 第164回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,043,000	
東日本旅客鉄道 第165回社債間限定同順位特約付	100,000,000	85,658,000	
東日本旅客鉄道 第167回社債間限定同順位特約付	100,000,000	74,444,000	
	100,000,000	107,511,000	

西日本旅客鉄道 第13回社債間限定同順位特約付			
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	300,000,000	324,345,000	
西日本旅客鉄道 第60回社債間限定同順位特約付	200,000,000	192,108,000	
西日本旅客鉄道 第65回社債間限定同順位特約付	200,000,000	191,344,000	
西日本旅客鉄道 第66回社債間限定同順位特約付	200,000,000	173,828,000	
西日本旅客鉄道 第77回社債間限定同順位特約付	100,000,000	73,931,000	
東海旅客鉄道 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,644,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	219,864,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,306,000	
東海旅客鉄道 第73回社債間限定同順位特約付	300,000,000	296,586,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,970,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	98,552,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	92,266,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	87,202,000	
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	195,038,000	
西日本鉄道 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,620,000	
阪急阪神ホールディングス 第47回	400,000,000	412,764,000	
阪急阪神ホールディングス 第49回	100,000,000	95,004,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,225,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,468,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	93,397,000	
日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,173,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,341,000	
九州旅客鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	164,302,000	
九州旅客鉄道 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	85,695,000	
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	88,721,000	
K D D I 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,645,000	
ソフトバンク 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,951,000	

ソフトバンク 第12回社債間限定 同順位特約付	200,000,000	194,290,000	
ソフトバンク 第14回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	98,405,000	
ソフトバンク 第16回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	94,121,000	
東京電力 第548回	100,000,000	104,570,000	
東京電力 第560回	100,000,000	103,411,000	
中部電力 第500回	200,000,000	201,642,000	
中部電力 第524回	100,000,000	98,678,000	
中部電力 第530回	200,000,000	191,240,000	
中部電力 第559回	100,000,000	91,131,000	
中部電力 第560回	100,000,000	91,766,000	
関西電力 第509回	100,000,000	98,851,000	
関西電力 第511回	300,000,000	295,062,000	
関西電力 第527回	200,000,000	199,802,000	
関西電力 第535回	200,000,000	197,856,000	
中国電力 第400回	100,000,000	98,185,000	
中国電力 第402回	100,000,000	99,854,000	
中国電力 第406回	100,000,000	89,728,000	
中国電力 第416回	100,000,000	96,222,000	
中国電力 第422回	600,000,000	570,210,000	
中国電力 第425回	100,000,000	95,003,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	101,853,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	100,771,000	
北陸電力 第326回	200,000,000	178,844,000	
北陸電力 第330回	100,000,000	96,131,000	
東北電力 第475回	100,000,000	100,841,000	
東北電力 第481回	200,000,000	202,108,000	
東北電力 第484回	100,000,000	92,492,000	
東北電力 第491回	100,000,000	99,048,000	
東北電力 第508回	100,000,000	96,868,000	
東北電力 第521回	300,000,000	286,524,000	
東北電力 第529回	200,000,000	196,978,000	
四国電力 第293回	100,000,000	92,541,000	
九州電力 第428回	105,000,000	105,966,000	
九州電力 第449回	200,000,000	197,138,000	
九州電力 第451回	100,000,000	98,597,000	
九州電力 第476回	100,000,000	96,500,000	
九州電力 第478回	100,000,000	88,816,000	
九州電力 第481回	300,000,000	286,749,000	
九州電力 第484回	200,000,000	191,048,000	
九州電力 第493回	300,000,000	294,846,000	

北海道電力 第321回	100,000,000	101,043,000	
北海道電力 第323回	100,000,000	101,727,000	
北海道電力 第338回	100,000,000	92,542,000	
北海道電力 第345回	300,000,000	299,634,000	
電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,883,000	
電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,792,000	
電源開発 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,857,000	
電源開発 第59回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,546,000	
電源開発 第73回社債間限定同順位特約付	200,000,000	187,022,000	
東京電力パワーグリッド 第6回	100,000,000	98,457,000	
東京電力パワーグリッド 第11回	300,000,000	293,493,000	
東京電力パワーグリッド 第15回	300,000,000	288,279,000	
東京電力パワーグリッド 第28回	100,000,000	98,057,000	
東京電力パワーグリッド 第35回	100,000,000	98,454,000	
東京電力パワーグリッド 第38回	400,000,000	398,080,000	
東京電力パワーグリッド 第40回	400,000,000	381,364,000	
東京電力パワーグリッド 第45回	300,000,000	284,511,000	
東京電力パワーグリッド 第50回	100,000,000	95,550,000	
J E R A 第3回無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,544,000	
東京瓦斯 第28回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,711,000	
東京瓦斯 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,341,000	
東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,146,000	
東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付	100,000,000	83,463,000	
大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	76,974,000	
大阪瓦斯 第43回社債間限定同順位特約付	200,000,000	158,910,000	
北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,857,000	
北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	91,760,000	
広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,119,000	
ファーストリテイリング 第7回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,137,000	
ファーストリテイリング 第8回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	93,093,000	
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	99,898,000	
小計	銘柄数：277	41,605,000,000	40,802,277,000

	組入時価比率：4.7%		4.7%
合計			40,802,277,000
合計			871,124,394,334

(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)

(2022年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	138,820,296
コール・ローン	767,994,050
国債証券	81,566,721,409
派生商品評価勘定	2,794,713,689
未収入金	33,992,509
未収利息	504,110,134
前払費用	70,368,462
差入委託証拠金	250,004
流動資産合計	85,876,970,553
資産合計	85,876,970,553
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	379,856
未払金	164,920,169
未払解約金	4,954,716
未払利息	1,181
その他未払費用	607,100
流動負債合計	170,863,022
負債合計	170,863,022
純資産の部	
元本等	
元本	83,852,935,482
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,853,172,049
元本等合計	85,706,107,531
純資産合計	85,706,107,531
負債純資産合計	85,876,970,553

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 為替予約取引</p>
-------------------	--

2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。 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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年12月26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	1.0221円
(10,000口当たり純資産額)	(10,221円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年12月28日 至 2022年12月26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> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2022年12月26日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、	附属明細表に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。	

## (その他の注記)

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年12月26日現在	
期首	2021年12月28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	72,748,893,031円
同期中における追加設定元本額	31,857,868,640円
同期中における一部解約元本額	20,753,826,189円
期末元本額	83,852,935,482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	1,992,320,870円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	896,504,529円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	42,253,790円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	13,263,355円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	6,193,696円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	4,290,646円
野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	10,217,381,206円
インデックス・ブレンド(タイプ )	9,398,212円
インデックス・ブレンド(タイプ )	5,808,722円
インデックス・ブレンド(タイプ )	33,318,907円
インデックス・ブレンド(タイプ )	8,582,897円
インデックス・ブレンド(タイプ )	11,001,100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)	48,712,969,356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)	9,850,728,591円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	4,976,702,946円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	152,177,590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)	21,840,879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)	44,597,805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
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	805,841,770円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2022年12月26日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2022年12月26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	1,500,000.00	1,450,429.65	
		US TREASURY BOND	610,000.00	644,598.40	
		US TREASURY BOND	1,800,000.00	1,975,710.78	
		US TREASURY BOND	20,000.00	21,360.15	
		US TREASURY BOND	510,000.00	426,427.72	
		US TREASURY BOND	250,000.00	239,521.47	
		US TREASURY N/B	500,000.00	488,732.95	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,477,039.05	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,953,641.60	
		US TREASURY N/B	700,000.00	686,393.26	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	954,334.40	
		US TREASURY N/B	500,000.00	487,500.00	
		US TREASURY N/B	300,000.00	288,269.52	
		US TREASURY N/B	400,000.00	391,828.12	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,457,636.70	
		US TREASURY N/B	300,000.00	292,359.36	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	964,863.20	
		US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,130,745.97	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,939,257.80	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,942,187.40	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	946,914.00	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,932,343.60	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,938,710.80	
US TREASURY N/B	800,000.00	778,124.96			
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,429,785.00			

US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,167,210.88	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,928,984.20	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,748,742.12	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,878,750.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	770,781.20	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,920,234.20	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,466,103.45	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,815,663.80	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,890,898.40	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,874,609.30	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,871,953.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,874,726.30	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	948,515.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	961,835.90	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,854,687.50	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,403,730.45	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,925,703.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	949,921.80	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,887,851.30	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,303,906.16	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,422,216.75	
US TREASURY N/B	800,000.00	768,874.96	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	951,835.90	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,407,421.80	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,350,617.10	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,908,046.80	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,454,121.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	936,171.80	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,895,546.80	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,416,308.50	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,425,781.25	
US TREASURY N/B	500,000.00	457,832.00	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,191,917.94	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,934,609.20	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,005,425.51	

US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,820,781.20	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,454,472.60	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,450,136.70	
US TREASURY N/B	700,000.00	636,179.67	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,943,750.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,938,515.60	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,810,390.60	
US TREASURY N/B	2,780,000.00	2,632,095.10	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	2,991,257.58	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,911,640.40	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,351,669.80	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,504,687.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	897,617.10	
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,558,192.04	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,398,730.25	
US TREASURY N/B	500,000.00	446,777.30	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,043,937.50	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,384,570.25	
US TREASURY N/B	500,000.00	473,183.55	
US TREASURY N/B	700,000.00	646,898.42	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,349,804.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	931,718.70	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,323,681.50	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,473,031.25	
US TREASURY N/B	500,000.00	455,468.75	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	919,257.80	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,123,066.10	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,416,476.40	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,191,708.96	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,104,164.04	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,350,644.40	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,815,664.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	935,625.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,787,968.60	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,012,945.23	

US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,888,203.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	865,410.10	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,906,757.80	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,562,722.30	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,724,609.20	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,422,451.05	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,290,908.10	
US TREASURY N/B	200,000.00	194,574.20	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	853,398.40	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	2,978,499.84	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,106,853.41	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,020,546.80	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	3,802,429.38	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,279,658.10	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,284,785.10	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,503,798.62	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,743,906.20	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,496,250.00	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,328,417.75	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	856,562.50	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	2,941,609.22	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,730,781.20	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,305,761.70	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,803,125.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	875,390.60	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,172,851.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	886,250.00	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,170,500.00	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,477,250.00	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,361,132.75	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,291,992.00	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,061,812.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,930,312.40	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,362,394.43	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,005,156.10	

US TREASURY N/B	200,000.00	176,195.30	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,504,218.75	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,424,257.70	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,721,171.80	
US TREASURY N/B	500,000.00	576,523.40	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,360,066.30	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	3,419,339.79	
US TREASURY N/B	500,000.00	554,970.70	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	906,339.83	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	1,956,167.94	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,034,144.30	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	1,976,062.32	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	857,617.10	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,702,210.72	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,841,406.20	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,611,562.50	
US TREASURY N/B	340,000.00	387,440.60	
US TREASURY N/B	1,760,000.00	1,910,287.45	
US TREASURY N/B	400,000.00	384,578.12	
US TREASURY N/B	800,000.00	842,156.24	
US TREASURY N/B	400,000.00	433,406.24	
US TREASURY N/B	500,000.00	533,339.80	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,262,798.78	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,281,992.00	
US TREASURY N/B	340,000.00	338,950.76	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	761,929.68	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,670,874.88	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,327,851.40	
US TREASURY N/B	300,000.00	333,316.38	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	722,363.20	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,150,986.30	
US TREASURY N/B	400,000.00	388,265.60	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	838,453.08	
US TREASURY N/B	500,000.00	441,699.20	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	728,476.50	

US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,057,406.16	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	777,812.50	
US TREASURY N/B	400,000.00	344,156.24	
US TREASURY N/B	500,000.00	447,382.80	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	823,398.40	
US TREASURY N/B	250,000.00	227,812.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	246,351.54	
US TREASURY N/B	800,000.00	697,968.72	
US TREASURY N/B	300,000.00	282,257.79	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,503,687.36	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,905,148.30	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,355,937.44	
US TREASURY N/B	300,000.00	232,171.86	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,147,688.87	
US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,281,096.66	
US TREASURY N/B	920,000.00	777,435.88	
US TREASURY N/B	2,530,000.00	1,947,111.52	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,073,515.49	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,386,034.99	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,484,296.74	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	842,265.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	842,265.60	
US TREASURY N/B	1,520,000.00	1,222,768.71	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,046,093.75	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,688,828.00	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,210,835.92	
US TREASURY N/B	900,000.00	761,291.01	
US TREASURY N/B	300,000.00	272,466.78	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,122,021.25	
US TREASURY N/B	500,000.00	414,794.90	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	944,886.67	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	747,363.20	
US TREASURY N/B	600,000.00	410,097.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	557,753.90	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	922,218.72	

小計	US TREASURY N/B	1,600,000.00	986,843.68	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	657,285.10	
	US TREASURY N/B	3,200,000.00	2,371,187.20	
	US TREASURY N/B	300,000.00	203,179.68	
	US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,048,124.96	
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,078,066.35	
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,406,484.29	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,703,437.40	
	銘柄数：208	346,720,000.00	314,004,674.26	(41,552,238,544)
組入時価比率：48.5%			51.0%	
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	586,542.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	260,000.00	254,410.26	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,882,418.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	491,833.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	947,357.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	190,120.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	294,659.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	540,999.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	938,879.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	364,526.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	1,174,819.68	
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	665,674.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,150,000.00	1,007,958.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	526,486.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	435,617.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	815,224.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	943,646.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	733,704.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	479,602.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	550,000.00	606,727.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,040,000.00	958,806.16	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	622,185.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	361,501.00	
CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	271,554.60		

小計	銘柄数：24  組入時価比率：1.9%	17,920,000.00	17,095,254.50  (1,660,462,069)  2.0%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,100,000.00	12,693,451.98
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	5,024,398.50
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,200,000.00	2,913,824.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,000,000.00	12,771,360.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	8,825,100.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,700,000.00	4,469,841.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,000,000.00	3,928,600.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,700,000.00	12,819,775.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,100,000.00	2,836,593.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,000,000.00	6,514,140.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,200,000.00	8,866,316.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	4,442,500.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,300,000.00	3,903,884.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,200,000.00	3,813,282.48
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,300,000.00	9,068,973.12
	小計	銘柄数：15  組入時価比率：0.8%	108,800,000.00
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	229,724.00
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	289,200.00
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	670,756.94
	BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,422,983.40
	BELGIUM KINGDOM	150,000.00	138,310.35
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	702,976.00
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	272,079.42
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,069,807.20
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	245,100.00
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	600,465.11
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	773,300.00
	BELGIUM KINGDOM	550,000.00	592,815.30
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	78,000.00
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	639,750.72
	BELGIUM KINGDOM	120,000.00	101,011.56

BELGIUM KINGDOM	400,000.00	374,677.20	
BELGIUM KINGDOM	300,000.00	340,020.00	
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	542,959.65	
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	368,053.00	
BELGIUM KINGDOM	400,000.00	292,830.40	
BELGIUM KINGDOM	300,000.00	197,835.60	
BELGIUM KINGDOM	370,000.00	305,924.58	
BELGIUM KINGDOM GOVT	670,000.00	793,713.49	
BONOS Y OBLIG DE	600,000.00	471,892.56	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	98,177.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,920,000.00	1,946,899.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	650,000.00	625,134.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	943,250.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	778,160.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	653,045.54	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	836,553.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	687,891.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	1,374,600.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	20,000.00	19,412.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	441,018.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	471,629.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	1,328,925.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	470,850.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	724,560.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	465,240.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	343,220.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	919,166.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	641,375.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	330,000.00	365,491.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,800,000.00	1,632,066.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,800,000.00	1,548,360.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	423,468.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	413,581.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	275,115.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	519,780.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	629,280.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	185,117.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	628,950.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,100,000.00	911,323.71	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	545,331.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	466,123.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	336,180.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	798,930.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	62,680.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	612,858.05	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	850,000.00	753,870.95	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	589,018.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	325,343.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	333,992.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	278,861.10	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	970,270.00	
BUNDES OblIGATION	300,000.00	286,872.00	
BUNDES OblIGATION	1,500,000.00	1,419,259.50	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	924,000.00	
BUNDES OblIGATION	1,500,000.00	1,423,410.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	416,684.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	605,675.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	691,096.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	429,875.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	191,774.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	481,140.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	848,043.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	275,139.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,270,000.00	2,080,182.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	1,647,492.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	780,087.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	909,220.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,113,450.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,800,000.00	1,584,414.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	342,304.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,200,000.00	1,176,768.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	623,810.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	169,370.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	837,830.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	251,436.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,343,122.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	817,790.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	572,705.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	807,650.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	470,630.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	1,728,700.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,200,000.00	888,456.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	651,393.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,184,786.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	407,995.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	882,693.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	60,000.00	79,583.46	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	738,519.53	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	821,548.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	910,000.00	947,601.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	810,880.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	715,572.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	317,118.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	1,200,000.00	1,165,092.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	1,200,000.00	1,160,892.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	1,400,000.00	1,349,586.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	500,000.00	496,015.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,237,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	294,255.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	951,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,515,195.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	436,720.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,350,000.00	1,398,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	477,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	767,400.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	964,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	195,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	316,833.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000.00	1,095,106.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,028,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,692,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	515,405.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	381,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,007,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	538,740.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	471,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,320,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	448,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	474,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,374,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	829,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	497,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	240,000.00	250,272.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	471,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	885,995.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,600,000.00	1,483,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	941,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,074,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	772,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	578,830.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	157,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	165,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	307,716.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	789,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	451,279.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	400,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	444,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	506,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,650,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,070,000.00	882,643.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	1,610,000.00	1,663,291.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	701,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	209,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	77,290.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	475,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,272,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	162,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	365,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	411,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	735,210.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	530,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	580,000.00	591,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	289,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	378,718.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	371,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	334,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	358,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	344,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	230,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	344,410.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	216,569.41	
FINNISH GOVERNMENT	810,000.00	758,912.49	
FINNISH GOVERNMENT	740,000.00	740,460.28	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	240,775.80	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	157,947.00	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	412,685.05	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	206,726.70	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	286,440.60	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	152,571.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,500,000.00	2,426,762.50	
FRANCE (GOVT OF)	710,000.00	706,316.52	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	943,513.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,400,000.00	1,318,926.00	
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	570,018.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,023,935.00	

FRANCE (GOVT OF)	750,000.00	684,192.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,900,000.00	1,703,954.20	
FRANCE (GOVT OF)	3,000,000.00	2,792,640.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,600,000.00	1,450,240.00	
FRANCE (GOVT OF)	200,000.00	180,434.70	
FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	1,077,000.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,740,906.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,300,000.00	1,079,461.50	
FRANCE (GOVT OF)	1,220,000.00	1,201,922.04	
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,207,174.50	
FRANCE (GOVT OF)	1,600,000.00	1,247,604.80	
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	611,520.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	921,287.00	
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	662,425.60	
FRANCE (GOVT OF)	2,400,000.00	1,911,360.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	385,450.00	
FRANCE (GOVT OF)	360,000.00	303,120.00	
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	194,582.79	
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	180,115.50	
FRANCE (GOVT OF)	1,910,000.00	1,540,845.89	
FRANCE (GOVT OF)	1,250,000.00	886,857.50	
FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	392,537.60	
FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	382,256.35	
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	220,001.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,600,000.00	1,572,066.88	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,100,000.00	1,189,650.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,600,000.00	1,525,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,600,000.00	2,393,037.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,410,000.00	1,445,884.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	900,000.00	901,890.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,200,000.00	1,391,965.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,140,000.00	1,941,975.10	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	371,973.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,290,000.00	2,693,956.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	441,883.60	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	920,000.00	1,092,434.68	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,200,000.00	1,222,970.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	700,000.00	824,208.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	800,000.00	971,828.00	
IRISH GOVERNMENT	500,000.00	455,577.65	
IRISH GOVERNMENT	400,000.00	314,185.92	
IRISH TSY 0.2%	200,000.00	179,984.92	
IRISH TSY 0.2% 2030	1,000,000.00	819,784.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	200,000.00	144,201.40	
IRISH TSY 1.7% 2037	350,000.00	294,395.50	
IRISH TSY 1% 2026	650,000.00	618,915.31	
IRISH TSY 2% 2045	350,000.00	287,522.20	
IRISH TSY 2031	200,000.00	156,042.40	
IRISH TSY 3.4% 2024	500,000.00	505,538.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	993,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,200,000.00	1,108,829.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	372,300.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,100,000.00	1,019,150.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	905,250.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	256,716.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,100,000.00	904,343.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	653,641.92	
NETHERLANDS GOVERNMENT	550,000.00	539,961.45	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	458,498.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	650,000.00	436,429.63	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	212,576.04	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	582,447.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	650,000.00	676,407.55	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	252,989.45	
REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	141,064.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	69,300.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	191,620.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	491,168.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	600,000.00	578,857.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	293,029.80	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	280,683.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	364,512.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	634,304.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,200,000.00	1,039,200.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	395,065.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	417,291.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	530,000.00	501,720.26	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	69,373.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	259,866.19	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	176,490.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	204,208.14	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	152,060.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	120,854.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	118,821.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	394,155.16	
	SPANISH GOVERNMENT	90,000.00	104,608.08	
	SPANISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,318,790.00	
	SPANISH GOVERNMENT	910,000.00	970,923.59	
小計	銘柄数：278	212,670,000.00	195,586,454.82 (27,436,867,882)	
	組入時価比率：32.0%		33.6%	
英債券	UK TREASURY	500,000.00	481,256.00	
	UK TREASURY	500,000.00	483,298.60	
	UK TREASURY	400,000.00	393,873.12	
	UK TREASURY	1,000,000.00	928,599.00	
	UK TREASURY	300,000.00	279,696.96	
	UK TREASURY	1,000,000.00	959,550.00	
	UK TREASURY	670,000.00	622,496.59	
	UK TREASURY	800,000.00	707,448.00	
	UK TREASURY	1,000,000.00	900,730.00	
	UK TREASURY	300,000.00	307,992.90	
	UK TREASURY	400,000.00	359,780.00	
	UK TREASURY	90,000.00	100,996.36	
	UK TREASURY	400,000.00	331,720.00	
	UK TREASURY	800,000.00	670,560.00	

UK TREASURY	700,000.00	548,525.04
UK TREASURY	600,000.00	649,469.04
UK TREASURY	600,000.00	451,440.00
UK TREASURY	100,000.00	79,440.00
UK TREASURY	300,000.00	315,210.00
UK TREASURY	1,200,000.00	900,180.00
UK TREASURY	500,000.00	533,002.50
UK TREASURY	1,000,000.00	678,968.00
UK TREASURY	460,000.00	479,082.64
UK TREASURY	1,070,000.00	812,317.89
UK TREASURY	500,000.00	547,593.00
UK TREASURY	300,000.00	199,603.20
UK TREASURY	600,000.00	620,172.00
UK TREASURY	100,000.00	103,141.00
UK TREASURY	200,000.00	128,468.60
UK TREASURY	350,000.00	374,488.80
UK TREASURY	600,000.00	557,084.28
UK TREASURY	1,580,000.00	1,643,642.40
UK TREASURY	700,000.00	432,607.00
UK TREASURY	350,000.00	226,835.00
UK TREASURY	1,040,000.00	1,089,512.73
UK TREASURY	800,000.00	437,944.00
UK TREASURY	110,000.00	107,256.60
UK TREASURY	300,000.00	174,008.10
UK TREASURY	300,000.00	179,460.00
UK TREASURY	500,000.00	309,000.00
UK TREASURY	200,000.00	211,129.00
UK TREASURY	200,000.00	151,392.00
UK TREASURY	400,000.00	387,080.00
UK TSY 0 1/2% 2061	400,000.00	144,420.00
UK TSY 0 5/8% 2050	500,000.00	226,545.40
UK TSY 1 5/8% 2071	150,000.00	84,322.50
UK TSY 3 1/4% 2044	300,000.00	268,740.00
UNITED KINGDOM GILT	1,000,000.00	1,011,084.60
UNITED KINGDOM GILT	800,000.00	429,630.40

小計	UNITED KINGDOM(GOVERNMEN	780,000.00	842,088.00
	銘柄数：50	27,750,000.00	23,862,881.25 (3,805,652,301)
	組入時価比率：4.4%		4.7%
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	2,500,000.00	2,485,000.00
	SWEDISH GOVERNMENT	2,700,000.00	2,551,606.11
	SWEDISH GOVERNMENT	1,000,000.00	918,866.70
	SWEDISH GOVERNMENT	3,500,000.00	3,161,617.55
	SWEDISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,255,611.90
	SWEDISH GOVERNMENT	1,600,000.00	1,900,450.72
	小計	銘柄数：6	12,800,000.00
	組入時価比率：0.2%		0.2%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,750,000.00	2,744,316.85
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,941,860.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	500,000.00	476,644.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,750,000.00	1,663,200.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,421,175.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	919,956.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,762,798.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,285,110.00
小計	銘柄数：8	13,000,000.00	12,215,059.85 (163,681,801)
	組入時価比率：0.2%		0.2%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	900,000.00	856,453.50
	KINGDOM OF DENMARK	1,400,000.00	1,363,740.00
	KINGDOM OF DENMARK	2,300,000.00	2,084,248.50
	KINGDOM OF DENMARK	2,100,000.00	1,820,910.00
	KINGDOM OF DENMARK	2,000,000.00	1,589,941.40
	KINGDOM OF DENMARK	3,600,000.00	4,574,012.76
	KINGDOM OF DENMARK	1,600,000.00	905,660.48
小計	銘柄数：7	13,900,000.00	13,194,966.64 (248,989,020)
	組入時価比率：0.3%		0.3%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	6,200,000.00	5,741,634.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000.00	3,130,630.00

小計	POLAND GOVERNMENT BOND	3,900,000.00	3,112,200.00
	銘柄数 : 3	13,900,000.00	11,984,464.00 (362,700,215)
	組入時価比率 : 0.4%		0.4%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	397,980.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	566,733.60
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,340,000.00	1,338,071.33
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	534,053.52
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	350,000.00	314,370.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	525,644.70
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	289,901.31
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	820,000.00	768,545.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	860,043.24
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	489,496.45
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	755,600.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,106,595.12
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	162,151.68
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	417,660.15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	118,500.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	239,544.18
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	663,395.76
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,470,000.00	1,551,823.58
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,383,736.50
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	439,076.50
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	144,546.15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	285,504.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	569,505.16
AUSTRALIAN GOVERNMENT	270,000.00	219,618.00	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	298,050.00	
小計	銘柄数 : 25	15,590,000.00	14,440,145.93 (1,278,241,717)
	組入時価比率 : 1.5%		1.6%
ニュージーランド ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	370,000.00	347,761.52
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	143,040.00
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	130,961.40
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	250,000.00	250,175.00

小計	NEW ZEALAND GOVERNMENT	200,000.00	160,902.06
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	200,000.00	185,086.46
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	80,330.59
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	123,000.00
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	139,402.08
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	200,000.00	197,288.00
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	180,000.00	146,383.45
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	64,785.82
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	107,760.00
	銘柄数：13	2,350,000.00	2,076,876.38 (172,048,439)
組入時価比率：0.2%		0.2%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	399,730.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	395,419.36
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	374,676.24
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	684,791.03
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	661,445.47
	SINGAPORE GOVERNMENT	730,000.00	749,861.32
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	301,146.12
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	295,475.55
	SINGAPORE GOVERNMENT	750,000.00	745,573.20
	SINGAPORE GOVERNMENT	810,000.00	802,482.95
	SINGAPORE GOVERNMENT	900,000.00	808,470.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	900,000.00	827,928.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	280,345.44
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	516,326.70
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	345,678.16
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	344,092.00
	小計	銘柄数：16	8,890,000.00
組入時価比率：1.0%		1.0%	
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,029,984.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,000,000.00	17,928,068.40
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	8,946,337.50
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	1,986,924.60
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,011,583.60

	CHINA GOVERNMENT BOND	13,000,000.00	12,851,441.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,000,000.00	7,941,634.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,000,000.00	7,919,624.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,067,179.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	13,976,202.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	9,893,216.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,055,031.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,003,262.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	3,952,778.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	8,881,139.70	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,250,736.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,106,112.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,500,000.00	11,800,416.80	
小計	銘柄数：18	154,500,000.00	154,601,675.00	
			(2,926,671,548)	
	組入時価比率：3.4%		3.6%	
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	600,000.00	589,818.90	
	ISRAEL FIXED BOND	1,500,000.00	1,503,315.45	
	ISRAEL FIXED BOND	400,000.00	372,899.44	
	ISRAEL FIXED BOND	2,000,000.00	1,880,511.00	
	ISRAEL FIXED BOND	1,000,000.00	842,352.70	
	ISRAEL FIXED BOND	900,000.00	1,130,647.23	
	ISRAEL FIXED BOND	800,000.00	816,968.24	
小計	銘柄数：7	7,200,000.00	7,136,512.96	
			(269,516,834)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
合計			81,566,721,409	
			(81,566,721,409)	

(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	2022年12月26日現在	
	契約額等(円)	

		うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	162,425,613	-	162,738,330	312,717
米ドル	92,266,573	-	92,605,730	339,157
ユーロ	70,159,040	-	70,132,600	26,440
売建	86,279,317,454	-	83,485,296,338	2,794,021,116
米ドル	43,602,995,432	-	41,849,497,100	1,753,498,332
カナダドル	1,771,394,012	-	1,691,625,684	79,768,328
メキシコペソ	748,471,340	-	717,262,850	31,208,490
ユーロ	29,268,519,361	-	28,685,524,455	582,994,906
英ポンド	4,176,332,639	-	4,023,577,845	152,754,794
スウェーデンクローナ	166,706,403	-	160,143,825	6,562,578
ノルウェークローネ	169,902,360	-	164,581,380	5,320,980
デンマーククローネ	269,607,599	-	264,165,555	5,442,044
ズロチ	362,847,431	-	360,975,723	1,871,708
豪ドル	1,377,303,340	-	1,317,002,060	60,301,280
ニュージーランドドル	182,529,518	-	176,139,924	6,389,594
シンガポールドル	860,026,709	-	834,037,542	25,989,167
人民元	3,028,063,910	-	2,963,588,750	64,475,160
新シェゲル	294,617,400	-	277,173,645	17,443,755
合計	-	-	-	2,794,333,833

## (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)

(2022年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	143,276,428
コール・ローン	1,631,572,013
国債証券	656,459,574,848
派生商品評価勘定	169,095
未収利息	6,688,857,750
前払費用	592,058,094
その他未収収益	18,796,246
流動資産合計	665,534,304,474
資産合計	665,534,304,474
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,401,035
未払金	161,697,964
未払解約金	1,101,388,827
未払利息	2,509
その他未払費用	7,860,341
流動負債合計	1,272,350,676
負債合計	1,272,350,676
純資産の部	
元本等	
元本	270,203,818,499
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	394,058,135,299
元本等合計	664,261,953,798
純資産合計	664,261,953,798
負債純資産合計	665,534,304,474

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年12月26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	2,4584円
(10,000口当たり純資産額)	(24,584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	230,403,840,578円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	
3. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価	
貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。	
有価証券	241,869,416,522円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年12月28日 至 2022年12月26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、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>    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

2022年12月26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>

## 2. 時価の算定方法

## 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年12月26日現在	
期首	2021年12月28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	246,248,944,233円
同期中における追加設定元本額	51,481,480,347円
同期中における一部解約元本額	27,526,606,081円
期末元本額	270,203,818,499円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	79,008,900円
バランスセレクト50	80,438,549円
バランスセレクト70	79,802,104円
野村外国債券インデックスファンド	261,535,375円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,534,482,646円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	23,050,895,512円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	2,185,239,908円
野村資産設計ファンド2015	21,512,854円
野村資産設計ファンド2020	23,068,943円
野村資産設計ファンド2025	38,153,443円
野村資産設計ファンド2030	49,694,801円
野村資産設計ファンド2035	39,445,390円
野村資産設計ファンド2040	62,723,363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）	74,502,056,519円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	6,782,798,760円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	26,671,991,475円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	7,485,546,668円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	601,460,989円
野村資産設計ファンド2045	11,745,518円
野村インデックスファンド・外国債券	1,004,798,077円
マイ・ロード	8,392,102,542円
ネクストコア	93,130,372円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	337,209,978円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	7,760,280,561円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,374,056,649円
野村資産設計ファンド2050	10,829,747円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	4,449,540円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	2,912,427円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,830,763円

野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,498,958円
のむラップ・ファンド(やや保守型)	957,966,427円
のむラップ・ファンド(やや積極型)	1,227,242,997円
インデックス・ブレンド(タイプ )	3,893,161円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,795,113円
インデックス・ブレンド(タイプ )	11,353,968円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,339,837円
インデックス・ブレンド(タイプ )	10,987,080円
野村6資産均等バランス	2,947,446,320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)	6,690,157,396円
世界6資産分散ファンド	71,153,957円
野村資産設計ファンド2060	5,718,077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	10,132,142,352円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	10,529,048,808円
野村外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	6,180,117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)	968,805,719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)	174,436,463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)	987,176,871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)	399,215,958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)	1,304,911円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	8,162,859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)	344,419円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,603,601,683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)	4,567,098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)	26,441,843円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	7,193,625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)	163,119,049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)	141,982,111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)	1,847,620,825円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	60,673,742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)	806,879,544円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	1,898,719,106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)	5,706,930円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,544,380円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,699,833円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	5,895,063円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	614,969,392円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,520,011,482円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	7,034,671,264円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	5,548,992,340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)	23,253,909,325円
マイバランスDC30	2,246,718,349円
マイバランスDC50	1,724,912,320円
マイバランスDC70	1,276,055,211円
野村DC外国債券インデックスファンド	9,317,807,926円
野村DC運用戦略ファンド	3,379,441,802円

野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	433,894,464円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	349,777,402円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	762,469,101円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	333,962,953円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	23,666,950円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	55,881,940円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	26,076,096円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	20,034,793円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	14,261,781円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	7,286,299円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	263,646,950円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	149,179,739円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	86,420,752円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	110,791,039円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	3,672,723円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	38,686,238円
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	64,646,753円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	240,388,638円
野村DCバランスファンド(年金運用戦略タイプ)	35,365,504円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2022年12月26日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2022年12月26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	62,000,000.00	59,951,092.20	
		US TREASURY BOND	132,000,000.00	139,486,868.40	
		US TREASURY BOND	44,200,000.00	48,514,675.82	
		US TREASURY BOND	140,750,000.00	150,322,097.85	
		US TREASURY BOND	100,000.00	107,035.15	
		US TREASURY BOND	900,000.00	752,519.52	
		US TREASURY BOND	1,200,000.00	1,149,703.08	
		US TREASURY N/B	200,000.00	195,493.18	
		US TREASURY N/B	29,300,000.00	28,851,496.11	

US TREASURY N/B	200,000.00	192,555.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,797.49	
US TREASURY N/B	45,900,000.00	44,836,074.72	
US TREASURY N/B	800,000.00	784,449.44	
US TREASURY N/B	200,000.00	192,402.50	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,431,501.60	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,800,000.00	
US TREASURY N/B	15,800,000.00	15,453,757.22	
US TREASURY N/B	200,000.00	192,179.68	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	9,110,003.79	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,066.40	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,166,109.36	
US TREASURY N/B	400,000.00	389,812.48	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,486.32	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,087,163.98	
US TREASURY N/B	50,850,000.00	49,305,629.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,109.37	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,691.40	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,608,663.86	
US TREASURY N/B	700,000.00	678,548.78	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,696,093.56	
US TREASURY N/B	86,600,000.00	84,167,752.40	
US TREASURY N/B	14,400,000.00	13,568,624.64	
US TREASURY N/B	18,400,000.00	17,746,654.64	
US TREASURY N/B	300,000.00	291,457.02	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,937.50	
US TREASURY N/B	25,200,000.00	24,279,607.80	
US TREASURY N/B	500,000.00	480,058.55	
US TREASURY N/B	300,000.00	293,220.69	
US TREASURY N/B	300,000.00	281,566.38	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,143,621.04	
US TREASURY N/B	750,000.00	718,652.32	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	977,265.60	
US TREASURY N/B	10,800,000.00	10,108,546.20	
US TREASURY N/B	2,050,000.00	1,964,396.30	

US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,485,156.00	
US TREASURY N/B	900,000.00	882,878.85	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,363.28	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	11,926,765.16	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,998,281.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,582.03	
US TREASURY N/B	4,600,000.00	4,429,116.90	
US TREASURY N/B	500,000.00	474,960.90	
US TREASURY N/B	42,050,000.00	40,478,049.05	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	8,886,210.70	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,447,900.29	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,275,546.79	
US TREASURY N/B	200,000.00	187,640.62	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,826,078.03	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,183.59	
US TREASURY N/B	200,000.00	187,656.24	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,894,179.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	282,750.00	
US TREASURY N/B	25,100,000.00	23,945,987.34	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,020,749.76	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,683,773.20	
US TREASURY N/B	17,300,000.00	16,195,772.14	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,777.34	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	31,605,315.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	92,136.71	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,527.34	
US TREASURY N/B	48,800,000.00	47,351,250.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,566.40	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	7,671,712.79	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,730.46	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	969,492.10	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,078.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,964.84	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,900,273.40	
US TREASURY N/B	200,000.00	181,765.62	

US TREASURY N/B	300,000.00	291,562.50	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,040,140.56	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,810,390.60	
US TREASURY N/B	35,150,000.00	33,279,907.52	
US TREASURY N/B	700,000.00	675,445.26	
US TREASURY N/B	200,000.00	180,476.56	
US TREASURY N/B	43,750,000.00	42,461,422.50	
US TREASURY N/B	200,000.00	180,222.64	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,972.65	
US TREASURY N/B	200,000.00	179,523.42	
US TREASURY N/B	51,300,000.00	48,741,007.23	
US TREASURY N/B	13,200,000.00	12,751,405.92	
US TREASURY N/B	200,000.00	179,625.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,598,437.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	179,453.12	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	15,927,568.86	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,355.46	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,858,125.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	953,828.10	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,968,570.12	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,731,835.50	
US TREASURY N/B	200,000.00	180,148.42	
US TREASURY N/B	42,300,000.00	40,127,167.44	
US TREASURY N/B	300,000.00	269,355.45	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,663,453.08	
US TREASURY N/B	300,000.00	281,976.54	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,328,523.34	
US TREASURY N/B	800,000.00	745,374.96	
US TREASURY N/B	300,000.00	269,542.95	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	6,692,202.72	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,750.00	
US TREASURY N/B	39,950,000.00	36,591,703.12	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	10,931,250.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,964.84	
US TREASURY N/B	11,500,000.00	10,571,464.70	

US TREASURY N/B	300,000.00	267,691.38	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,137,124.72	
US TREASURY N/B	300,000.00	269,648.43	
US TREASURY N/B	13,300,000.00	12,361,206.20	
US TREASURY N/B	81,000,000.00	74,252,635.20	
US TREASURY N/B	500,000.00	450,937.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	92,013.67	
US TREASURY N/B	200,000.00	180,085.92	
US TREASURY N/B	200,000.00	181,566.40	
US TREASURY N/B	36,950,000.00	34,571,343.75	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,251,578.02	
US TREASURY N/B	100,000.00	92,085.93	
US TREASURY N/B	300,000.00	261,550.77	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,410.15	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	14,711,971.70	
US TREASURY N/B	37,350,000.00	35,608,701.91	
US TREASURY N/B	67,500,000.00	63,285,198.75	
US TREASURY N/B	200,000.00	172,460.92	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,830.07	
US TREASURY N/B	300,000.00	258,181.62	
US TREASURY N/B	300,000.00	291,861.30	
US TREASURY N/B	100,000.00	85,339.84	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,332,570.26	
US TREASURY N/B	35,700,000.00	33,228,888.84	
US TREASURY N/B	100,000.00	85,582.03	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,796.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	84,843.75	
US TREASURY N/B	300,000.00	255,427.71	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	927,421.80	
US TREASURY N/B	300,000.00	256,511.70	
US TREASURY N/B	500,000.00	426,552.70	
US TREASURY N/B	500,000.00	428,261.70	
US TREASURY N/B	27,700,000.00	26,231,141.02	
US TREASURY N/B	100,000.00	87,195.31	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,313,437.50	

US TREASURY N/B	100,000.00	87,406.25	
US TREASURY N/B	53,600,000.00	50,972,340.40	
US TREASURY N/B	500,000.00	436,171.85	
US TREASURY N/B	16,400,000.00	14,285,936.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	85,656.25	
US TREASURY N/B	16,150,000.00	15,324,835.13	
US TREASURY N/B	10,100,000.00	8,691,128.78	
US TREASURY N/B	100,000.00	86,539.06	
US TREASURY N/B	300,000.00	261,152.34	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,305,500.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	87,539.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	86,914.06	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	2,836,000.00	
US TREASURY N/B	35,050,000.00	32,684,125.00	
US TREASURY N/B	18,000,000.00	16,064,296.20	
US TREASURY N/B	8,100,000.00	7,431,750.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,445.31	
US TREASURY N/B	28,900,000.00	26,495,427.52	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,968,093.75	
US TREASURY N/B	300,000.00	289,546.86	
US TREASURY N/B	100,000.00	92,910.15	
US TREASURY N/B	300,000.00	262,488.27	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	957,734.30	
US TREASURY N/B	400,000.00	352,390.60	
US TREASURY N/B	100,000.00	80,808.59	
US TREASURY N/B	200,000.00	172,117.18	
US TREASURY N/B	75,600,000.00	87,170,338.08	
US TREASURY N/B	13,600,000.00	10,880,530.40	
US TREASURY N/B	100,000.00	79,519.53	
US TREASURY N/B	156,450,000.00	173,650,332.03	
US TREASURY N/B	100,000.00	82,394.53	
US TREASURY N/B	100,000.00	85,050.78	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	13,858,659.10	
US TREASURY N/B	35,650,000.00	29,352,759.04	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,145,702.60	

US TREASURY N/B	100,000.00	93,179.68	
US TREASURY N/B	800,000.00	736,562.48	
US TREASURY N/B	5,750,000.00	6,251,215.42	
US TREASURY N/B	19,750,000.00	22,505,741.20	
US TREASURY N/B	100,000.00	108,539.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,144.53	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,157,964.83	
US TREASURY N/B	100,000.00	108,351.56	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,240,027.16	
US TREASURY N/B	100,000.00	109,808.59	
US TREASURY N/B	100,000.00	106,308.59	
US TREASURY N/B	11,900,000.00	7,627,852.40	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,691.40	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	2,603,259.74	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,429.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	66,392.57	
US TREASURY N/B	100,000.00	111,105.46	
US TREASURY N/B	200,000.00	144,472.64	
US TREASURY N/B	100,000.00	105,917.96	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,611,380.82	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	6,988,780.80	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	6,498,011.37	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,003,554.56	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	1,675,495.95	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,117.18	
US TREASURY N/B	600,000.00	466,687.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	86,039.06	
US TREASURY N/B	500,000.00	447,382.80	
US TREASURY N/B	200,000.00	164,679.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,125.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	82,117.18	
US TREASURY N/B	290,000.00	253,013.66	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,085.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,980.46	
US TREASURY N/B	8,900,000.00	8,037,812.50	

	US TREASURY N/B	39,950,000.00	34,595,761.17	
	US TREASURY N/B	44,800,000.00	37,966,248.32	
	US TREASURY N/B	44,700,000.00	34,593,607.14	
	US TREASURY N/B	24,400,000.00	20,631,341.92	
	US TREASURY N/B	17,500,000.00	14,463,475.25	
	US TREASURY N/B	3,200,000.00	2,704,124.80	
	US TREASURY N/B	49,700,000.00	38,249,582.21	
	US TREASURY N/B	28,200,000.00	21,656,717.34	
	US TREASURY N/B	36,500,000.00	26,626,461.65	
	US TREASURY N/B	14,200,000.00	11,709,452.06	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,684,531.20	
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,431,851.52	
	US TREASURY N/B	11,400,000.00	9,170,765.34	
	US TREASURY N/B	9,300,000.00	7,483,593.75	
	US TREASURY N/B	500,000.00	422,207.00	
	US TREASURY N/B	100,000.00	86,488.28	
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,268,818.35	
	US TREASURY N/B	100,000.00	90,822.26	
	US TREASURY N/B	470,000.00	398,939.99	
	US TREASURY N/B	100,000.00	82,958.98	
	US TREASURY N/B	11,250,000.00	8,176,903.87	
	US TREASURY N/B	300,000.00	224,208.96	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	683,496.00	
	US TREASURY N/B	20,600,000.00	11,489,730.34	
	US TREASURY N/B	26,200,000.00	15,101,331.54	
	US TREASURY N/B	32,600,000.00	20,106,939.98	
	US TREASURY N/B	25,800,000.00	16,957,955.58	
	US TREASURY N/B	75,850,000.00	56,204,546.60	
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	948,171.84	
	US TREASURY N/B	100,000.00	65,507.81	
	US TREASURY N/B	100,000.00	71,871.09	
	US TREASURY N/B	100,000.00	82,734.37	
小計	銘柄数：251	2,708,410,000.00	2,529,093,735.39 (334,674,974,004)	
	組入時価比率：50.4%		50.9%	

カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	488,785.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,849,507.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,595,942.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	34,400,000.00	32,589,080.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	95,060.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,500,000.00	4,355,284.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	1,931,055.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	687,537.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	315,583.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	281,663.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	14,200,000.00	13,021,499.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	92,010.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	182,263.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	293,596.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	756,116.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	17,480,000.00	20,133,184.32	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	950,964.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	284,519.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	438,243.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,950,000.00	5,220,994.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	87,123.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	90,580.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	849,281.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	16,900,000.00	20,665,996.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,940,000.00	4,724,083.64	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	551,570.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	9,812,002.00	
CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,198,507.70		
CANADIAN GOVERNMENT	12,100,000.00	9,410,557.20		
CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	795,302.20		
CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	814,663.80		
小計	銘柄数：31	139,620,000.00	139,562,559.06	
			(13,555,711,361)	
	組入時価比率：2.0%		2.1%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	78,500,000.00	76,063,815.30	

	MEX BONOS DESARR FIX RT	61,500,000.00	61,800,101.55
	MEX BONOS DESARR FIX RT	59,000,000.00	53,723,630.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	122,000,000.00	111,293,280.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,000,000.00	882,510.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	110,800,000.00	105,374,124.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	77,300,000.00	75,920,195.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	106,600,000.00	99,750,950.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	400,000.00	366,012.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	57,867,277.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	48,600,000.00	46,837,278.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,200,000.00	60,595,700.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	54,000,000.00	49,025,520.00
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	64,800,000.00	63,190,264.32
小計	銘柄数：14	906,000,000.00	862,690,657.17
	組入時価比率：0.9%		(5,898,043,484)
			0.9%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	5,550,000.00	5,543,340.00
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	964,000.00
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,628,981.14
	BELGIUM KINGDOM	9,600,000.00	10,186,531.20
	BELGIUM KINGDOM	3,800,000.00	3,604,891.28
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	1,844,138.00
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	906,931.40
	BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	5,794,789.00
	BELGIUM KINGDOM	11,400,000.00	9,779,003.22
	BELGIUM KINGDOM	7,500,000.00	8,083,845.00
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	84,600.00
	BELGIUM KINGDOM	2,800,000.00	2,239,127.52
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	84,176.30
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	3,966,900.00
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,343,677.20
	BELGIUM KINGDOM	4,950,000.00	3,643,724.70
	BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	1,976,605.20
	BELGIUM KINGDOM	3,600,000.00	2,989,738.80
	BELGIUM KINGDOM	2,200,000.00	1,819,011.04
	BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	13,095,625.00

BELGIUM KINGDOM GOVT	10,500,000.00	12,438,793.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,050,000.00	7,216,006.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,600,000.00	13,790,536.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,300,000.00	10,290,668.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,100,000.00	2,042,670.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,100,000.00	5,690,825.42	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	19,650,000.00	20,547,847.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,600,000.00	6,485,833.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000.00	1,099,680.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	2,911,920.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,050,000.00	37,541,691.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	754,606.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	94,170.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	90,570.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,300,000.00	10,514,424.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	772,245.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,800,000.00	2,573,667.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,250,000.00	5,726,562.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	16,350,000.00	18,108,442.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	90,670.34	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	430,100.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	3,851,614.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000.00	1,110,702.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	4,851,900.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	828,476.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	545,331.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,900,000.00	2,214,085.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,793,581.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,000,000.00	13,482,877.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	2,838,102.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,500,000.00	8,835,277.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,600,000.00	5,205,407.20	
BUNDESobligation	2,600,000.00	2,486,224.00	
BUNDESobligation	1,300,000.00	1,201,200.00	
BUNDESobligation	2,950,000.00	2,692,052.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	592,368.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,400,000.00	2,344,776.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,588,949.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,700,000.00	11,258,676.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,600,000.00	18,468,492.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	917,130.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	641,466.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	21,300,000.00	25,065,414.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	183,550.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,300,000.00	22,164,892.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	545,532.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,700,000.00	11,913,915.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	88,892.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	88,023.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	4,903,200.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	25,201,924.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	32,100,000.00	39,194,742.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,800,000.00	23,213,976.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	16,700,000.00	19,785,934.54	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,100,000.00	2,529,569.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,700,000.00	4,599,951.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,800,000.00	3,713,894.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,130,000.00	1,283,887.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000.00	4,826,594.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,700,000.00	12,183,444.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	24,200,000.00	19,623,296.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	2,703,510.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	300,000.00	297,609.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	24,000,000.00	24,414,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	295,338.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000.00	1,177,020.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,156,044.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	7,373,949.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,600,000.00	7,375,724.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	989,550.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000.00	1,979,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	33,200,000.00	34,395,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	763,440.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,275,875.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	385,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,300,000.00	1,226,615.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,750,000.00	11,471,525.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,880,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,396,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	91,258.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,600,000.00	19,122,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	93,710.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	1,907,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	26,600,000.00	30,164,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	91,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	89,790.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	188,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	186,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	35,450,000.00	39,778,445.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,600,000.00	2,467,140.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	183,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,000,000.00	15,642,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	94,290.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	752,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	40,550,000.00	43,587,195.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	96,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	827,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,000,000.00	22,550,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,850,000.00	1,481,295.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	666,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	84,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,550,000.00	12,705,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	1,968,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,154,860.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	22,300,000.00	23,038,130.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	15,000,000.00	13,153,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	77,290.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,300,000.00	7,890,810.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	424,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	406,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	5,220,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	164,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,100,000.00	12,708,630.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	8,976,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	4,528,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	2,343,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	7,892,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,900,000.00	5,437,570.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,100,000.00	2,864,305.10	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	693,903.00	
FINNISH GOVERNMENT	600,000.00	619,680.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	95,593.80	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	1,873,858.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	3,302,052.60	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,062,538.40	
FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,096,815.20	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	1,650,740.20	
FINNISH GOVERNMENT	4,500,000.00	3,100,900.50	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	381,920.80	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	762,855.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	96,702.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	99,481.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,695,762.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	9,595,313.10	
FRANCE (GOVT OF)	3,100,000.00	2,885,635.00	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	12,133,004.80	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	7,447,040.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,900,000.00	6,224,997.15	
FRANCE (GOVT OF)	15,100,000.00	13,552,250.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,300,000.00	2,872,494.90	

FRANCE (GOVT OF)	16,300,000.00	16,058,466.60	
FRANCE (GOVT OF)	15,000,000.00	12,420,480.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	79,640.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	84,200.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	8,551,291.36	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,418,972.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	280,384.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	819,120.75	
FRANCE (GOVT OF)	2,400,000.00	1,760,011.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,700,000.00	1,670,321.06	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,650,000.00	11,517,975.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	5,719,500.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	276,119.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	36,400,000.00	37,326,380.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,700,000.00	11,724,570.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	40,150,000.00	46,572,835.65	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	12,000,000.00	10,889,580.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	21,050,000.00	26,100,147.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	38,850,000.00	45,703,140.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,300,000.00	2,540,830.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,350,000.00	6,352,745.15	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,450,000.00	24,918,021.90	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,650,000.00	9,007,423.65	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,840,000.00	18,027,409.40	
IRISH GOVERNMENT	130,000.00	137,702.96	
IRISH GOVERNMENT	11,400,000.00	10,387,170.42	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	542,846.82	
IRISH TSY 1.3% 2033	5,100,000.00	4,345,710.00	
IRISH TSY 1.35% 2031	3,300,000.00	2,960,304.60	
IRISH TSY 1.5% 2050	2,900,000.00	2,090,920.30	
IRISH TSY 1.7% 2037	3,100,000.00	2,607,503.00	
IRISH TSY 1% 2026	400,000.00	380,870.96	
IRISH TSY 2.4% 2030	7,500,000.00	7,322,775.00	
IRISH TSY 2% 2045	1,600,000.00	1,314,387.20	
IRISH TSY 3.4% 2024	4,700,000.00	4,752,060.96	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	98,000.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	99,300.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,416,116.40	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,396,125.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,316,250.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	13,912,530.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	905,250.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	1,711,446.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	687,716.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	11,750,000.00	11,535,540.17	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	6,850,000.00	7,851,785.10	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	354,293.40	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	5,009,048.50	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	9,800,000.00	10,198,144.60	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	358,518.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	613,048.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,245,530.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	687,635.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,600,000.00	4,437,905.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,900,000.00	8,432,460.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,871,220.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	8,793,132.36	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	11,600,000.00	10,045,600.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	9,550,000.00	9,040,431.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,200,000.00	1,355,823.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,400,000.00	2,450,497.68	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,000,000.00	5,322,100.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,188,212.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,650,000.00	3,165,185.44	
	SPANISH GOVERNMENT	34,000,000.00	39,518,608.00	
	SPANISH GOVERNMENT	28,950,000.00	34,708,155.00	
	SPANISH GOVERNMENT	9,250,000.00	9,869,278.25	
小計	銘柄数：227	1,511,300,000.00	1,561,808,785.44 (219,090,536,421)	
	組入時価比率：33.0%		33.4%	

英債券	UK TREASURY	700,000.00	673,758.40
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,159,916.64
	UK TREASURY	4,350,000.00	4,283,370.18
	UK TREASURY	17,920,000.00	18,426,537.47
	UK TREASURY	200,000.00	186,464.64
	UK TREASURY	2,300,000.00	2,206,965.00
	UK TREASURY	8,110,000.00	7,534,996.13
	UK TREASURY	1,680,000.00	1,485,640.80
	UK TREASURY	400,000.00	360,292.00
	UK TREASURY	8,600,000.00	8,829,129.80
	UK TREASURY	200,000.00	179,890.00
	UK TREASURY	6,650,000.00	7,462,508.97
	UK TREASURY	700,000.00	580,510.00
	UK TREASURY	200,000.00	167,640.00
	UK TREASURY	7,200,000.00	7,793,628.48
	UK TREASURY	9,260,000.00	9,729,482.00
	UK TREASURY	17,350,000.00	18,495,186.75
	UK TREASURY	750,000.00	509,226.00
	UK TREASURY	10,830,000.00	11,279,271.72
	UK TREASURY	2,800,000.00	2,729,356.00
	UK TREASURY	4,250,000.00	4,654,540.50
	UK TREASURY	1,600,000.00	1,653,792.00
	UK TREASURY	500,000.00	515,705.00
	UK TREASURY	320,000.00	342,389.76
	UK TREASURY	18,440,000.00	17,121,056.87
	UK TREASURY	5,900,000.00	6,137,652.00
	UK TREASURY	3,000,000.00	1,854,030.00
	UK TREASURY	16,100,000.00	10,434,410.00
	UK TREASURY	5,350,000.00	5,604,704.94
	UK TREASURY	1,100,000.00	602,173.00
	UK TREASURY	6,750,000.00	6,581,655.00
	UK TREASURY	1,400,000.00	837,480.00
UK TREASURY	700,000.00	432,600.00	
UK TREASURY	8,250,000.00	8,709,071.25	
UK TREASURY	100,000.00	75,696.00	

小計	UK TREASURY	200,000.00	193,540.00
	UK TSY 0 1/2% 2061	5,600,000.00	2,021,880.00
	UK TSY 0 5/8% 2050	1,500,000.00	679,636.20
	UK TSY 3 1/4% 2044	7,000,000.00	6,270,600.00
	UNITED KINGDOM GILT	5,700,000.00	5,763,182.22
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	7,170,000.00	7,740,732.00
	銘柄数：41 組入時価比率：4.6%	202,330,000.00	192,300,297.72 (30,668,051,480) 4.7%
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	34,350,000.00	34,143,900.00
	SWEDISH GOVERNMENT	16,000,000.00	15,120,628.80
	SWEDISH GOVERNMENT	17,300,000.00	15,896,393.91
	SWEDISH GOVERNMENT	4,100,000.00	3,703,609.13
	SWEDISH GOVERNMENT	13,100,000.00	10,965,677.26
	SWEDISH GOVERNMENT	21,300,000.00	25,299,750.21
	銘柄数：6 組入時価比率：0.2%	106,150,000.00	105,129,959.31 (1,321,483,588) 0.2%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	22,800,000.00	22,752,881.52
	NORWEGIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	12,913,369.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	6,768,344.80
	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	9,694,080.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	8,906,030.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	28,000,000.00	25,758,768.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,400,000.00	6,522,352.60
	NORWEGIAN GOVERNMENT	13,000,000.00	11,937,097.90
小計	銘柄数：8 組入時価比率：0.2%	111,200,000.00	105,252,923.82 (1,410,389,179) 0.2%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	25,200,000.00	24,547,320.00
	KINGDOM OF DENMARK	6,500,000.00	5,890,267.50
	KINGDOM OF DENMARK	37,250,000.00	32,299,475.00
	KINGDOM OF DENMARK	38,100,000.00	48,408,301.71
	KINGDOM OF DENMARK	7,500,000.00	4,245,283.50
小計	銘柄数：5	114,550,000.00	115,390,647.71 (2,177,421,522)

	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	38,800,000.00	35,931,516.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	8,300,000.00	7,294,040.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	54,500,000.00	44,899,825.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,300,000.00	2,633,400.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	5,014,980.00	
	小計	銘柄数：5	112,300,000.00	95,773,761.00
			(2,898,516,257)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,487,375.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	8,787,334.16	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,680,000.00	18,157,819.68	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,200,000.00	6,517,994.28	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,159,605.24	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	286,681.08	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,664,287.93	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,300,000.00	8,783,850.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	22,200,000.00	20,472,009.72	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	4,621,322.88	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	2,756,556.99	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	237,000.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	479,088.36	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,100,000.00	2,570,658.57	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	15,600,000.00	16,468,331.88	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	276,747.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,050,000.00	2,678,366.65	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,350,000.00	9,010,043.35	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,550,000.00	1,382,910.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,250,000.00	1,830,552.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	4,636,380.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	1,788,300.00	
小計	銘柄数：22	123,680,000.00	117,053,215.37	
			(10,361,550,624)	
	組入時価比率：1.6%		1.6%	
ニュージーランド ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4,000,000.00	3,814,400.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4,000,000.00	4,002,800.00	

小計	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3,000,000.00	2,776,296.90	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4,000,000.00	3,717,388.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2,000,000.00	1,626,482.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1,000,000.00	647,858.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1,000,000.00	718,400.00	
	銘柄数：7	19,000,000.00	17,303,626.70	(1,433,432,435)
	組入時価比率：0.2%			0.2%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,431,059.08	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,298,447.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,087,403.24	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,700,000.00	2,641,336.83	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	472,461.05	
	SINGAPORE GOVERNMENT	5,850,000.00	6,009,162.70	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	492,459.25	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	298,229.28	
	SINGAPORE GOVERNMENT	5,260,000.00	5,211,185.61	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,980,000.00	3,086,713.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,220,000.00	2,962,142.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,950,000.00	1,954,319.25	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	1,962,041.46	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	1,814,810.34	
	小計	銘柄数：14	32,110,000.00	31,721,771.49
	組入時価比率：0.5%			0.5%
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	403,147.44	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,000,000.00	1,004,321.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,711,941.18	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3,300,000.00	3,196,833.42	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,900,000.00	3,054,353.66	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,497,949.75	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	7,871,458.14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	2,919,805.26	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	16,600,000.00	16,938,970.34	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,611,375.34	

	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,200,000.00	9,081,711.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,178,805.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	278,626.99	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,400,000.00	15,887,240.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,474,010.24	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	9,550,320.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	11,100,000.00	11,111,010.09	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,600,000.00	11,283,241.02	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,500,000.00	10,813,938.45	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	314,651.85	
小計	銘柄数：20	119,380,000.00	121,183,711.77	
			(3,625,610,643)	
	組入時価比率：0.5%		0.6%	
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	141,900,000.00	142,112,736.48	
	CHINA GOVERNMENT BOND	144,100,000.00	143,524,147.58	
	CHINA GOVERNMENT BOND	49,900,000.00	49,602,471.25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	73,500,000.00	73,019,479.05	
	CHINA GOVERNMENT BOND	89,500,000.00	89,672,788.70	
	CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	32,622,889.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	84,800,000.00	84,096,473.76	
	CHINA GOVERNMENT BOND	54,000,000.00	53,606,032.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	25,000,000.00	24,748,827.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	70,000,000.00	70,522,508.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	60,000,000.00	60,089,256.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	74,000,000.00	73,874,214.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	45,500,000.00	45,014,132.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	33,454,007.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,016,314.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	19,763,892.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	31,500,000.00	31,267,476.45	
	CHINA GOVERNMENT BOND	70,300,000.00	69,371,568.99	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	16,253,682.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	36,000,000.00	37,910,030.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	87,700,000.00	89,991,004.64	
小計	銘柄数：21	1,258,700,000.00	1,260,533,933.20	

			(23,862,411,569)	
		組入時価比率：3.6%	3.6%	
新シケル	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	4,915,157.50	
	ISRAEL FIXED BOND	6,200,000.00	6,213,703.86	
	ISRAEL FIXED BOND	12,200,000.00	11,652,712.88	
	ISRAEL FIXED BOND	6,500,000.00	7,127,321.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	4,701,277.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,800,000.00	5,446,994.60	
	ISRAEL FIXED BOND	4,500,000.00	3,790,587.15	
	ISRAEL FIXED BOND	5,900,000.00	4,541,294.90	
	ISRAEL FIXED BOND	7,200,000.00	9,045,177.84	
	ISRAEL FIXED BOND	5,700,000.00	5,820,898.71	
小計	銘柄数：10	64,000,000.00	63,255,126.44	
			(2,388,886,779)	
		組入時価比率：0.4%	0.4%	
合計			656,459,574,848	
			(656,459,574,848)	

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

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

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

(3)貸付有価証券の明細(2022年12月26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	5,325,000	
		US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	25,000,000	
		US TREASURY N/B	18,000,000	
		US TREASURY N/B	10,385,000	
		US TREASURY N/B	2,500,000	
		US TREASURY N/B	33,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	23,000,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	14,000,000	
		US TREASURY N/B	5,500,000	
		US TREASURY N/B	19,000,000	
		US TREASURY N/B	10,700,000	
		US TREASURY N/B	19,000,000	
		US TREASURY N/B	33,000,000	
		US TREASURY BOND	43,000,000	
		US TREASURY BOND	50,000,000	

US TREASURY BOND	13,000,000
US TREASURY N/B	18,300,000
US TREASURY N/B	15,000,000
US TREASURY N/B	26,000,000
US TREASURY N/B	27,000,000
US TREASURY N/B	35,500,000
US TREASURY BOND	50,000,000
US TREASURY BOND	5,000,000
US TREASURY BOND	50,000,000
US TREASURY BOND	5,000,000
US TREASURY BOND	16,000,000
US TREASURY N/B	11,000,000
US TREASURY N/B	23,000,000
US TREASURY N/B	11,800,000
US TREASURY N/B	14,450,000
US TREASURY N/B	170,000
US TREASURY N/B	170,000
US TREASURY N/B	655,000
US TREASURY N/B	26,000,000
US TREASURY N/B	4,157,000
US TREASURY N/B	8,400,000
US TREASURY N/B	19,000,000
US TREASURY N/B	1,530,000
US TREASURY N/B	5,000,000
US TREASURY N/B	50,000,000
US TREASURY N/B	425,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	15,300,000
US TREASURY N/B	10,877,000
US TREASURY N/B	19,000,000
US TREASURY N/B	15,600,000
US TREASURY N/B	5,000,000
US TREASURY N/B	11,000,000
US TREASURY N/B	5,000,000
US TREASURY N/B	30,000,000
US TREASURY N/B	20,000,000
US TREASURY N/B	7,395,000
US TREASURY N/B	24,500,000
US TREASURY N/B	6,000,000
US TREASURY N/B	31,000,000
US TREASURY N/B	41,000,000
US TREASURY N/B	35,000,000
US TREASURY N/B	5,200,000
US TREASURY N/B	2,000,000
US TREASURY N/B	1,000,000
US TREASURY BOND	17,000,000
US TREASURY BOND	25,000,000
US TREASURY N/B	22,500,000
US TREASURY N/B	30,000,000

	US TREASURY N/B	17,000,000
	US TREASURY N/B	25,000,000
	US TREASURY N/B	24,000,000
	US TREASURY N/B	37,000,000
	US TREASURY N/B	11,191,000
	US TREASURY N/B	8,000,000
	US TREASURY N/B	13,000,000
	US TREASURY N/B	22,000,000
	US TREASURY N/B	5,200,000
	US TREASURY N/B	23,000,000
	US TREASURY N/B	19,000,000
	US TREASURY N/B	11,000,000
	US TREASURY N/B	14,000,000
	US TREASURY N/B	30,000,000
	US TREASURY N/B	27,000,000
	US TREASURY N/B	24,000,000
	US TREASURY N/B	8,000,000
	US TREASURY N/B	12,000,000
	US TREASURY N/B	15,000,000
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,900,000
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,000,000
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,000,000
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	6,400,000
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	6,290,000
ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,295,000
	BUNDESREPUBLIC	2,507,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000
	BUNDESREPUBLIC	1,700,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	595,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,640,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,450,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,275,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,160,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,930,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,375,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,550,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,802,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,448,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,900,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,900,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,500,000

	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,400,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,900,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,900,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,100,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	16,400,000	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000	
	BELGIUM KINGDOM	3,400,000	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,610,000	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,500,000	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,600,000	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,200,000	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2,100,000	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,900,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	671,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	850,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	9,900,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6,200,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	15,810,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,800,000	

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年12月26日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	464,316,950	-	463,085,010	1,231,940
米ドル	238,317,529	-	238,129,020	188,509
ユーロ	168,788,160	-	168,318,240	469,920
新シェケル	57,211,261	-	56,637,750	573,511
合計	464,316,950	-	463,085,010	1,231,940

## (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）

（2022年12月26日現在）

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	82,386,628
コール・ローン	11,239,708
国債証券	7,151,297,645
未収利息	77,091,735
前払費用	8,163,064
流動資産合計	7,330,178,780
<b>資産合計</b>	<b>7,330,178,780</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,504
未払金	10,067,708
未払解約金	1,587,889
未払利息	17
その他未払費用	468,700
流動負債合計	12,139,818
<b>負債合計</b>	<b>12,139,818</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	5,134,940,091
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,183,098,871
元本等合計	7,318,038,962
<b>純資産合計</b>	<b>7,318,038,962</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>7,330,178,780</b>

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

3.費用・収益の計上基準	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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年12月26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	1.4251円
(10,000口当たり純資産額)	(14,251円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年12月28日 至 2022年12月26日
1.金融商品に対する取組方針
当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク
当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。
当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。
これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。
3.金融商品に係るリスク管理体制
委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。
市場リスクの管理
市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。
信用リスクの管理
信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。
流動性リスクの管理
流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年12月26日現在
---------------

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2. 時価の算定方法

## 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年12月26日現在		
期首		2021年12月28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		6,347,454,617円
同期中における追加設定元本額		1,029,601,664円
同期中における一部解約元本額		2,242,116,190円
期末元本額		5,134,940,091円
期末元本額の内訳*		
野村資産設計ファンド2015		11,389,563円
野村資産設計ファンド2020		12,212,557円
野村資産設計ファンド2025		20,286,579円
野村資産設計ファンド2030		26,760,764円
野村資産設計ファンド2035		21,197,588円
野村資産設計ファンド2040		33,833,636円
野村資産設計ファンド2045		6,314,142円
野村インデックスファンド・新興国債券		713,351,455円
ネクストコア		4,142,066円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		593,892,871円
野村資産設計ファンド2050		5,940,012円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		2,425,088円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		1,570,069円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		986,963円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		808,064円
インデックス・ブレンド(タイプ )		1,029,503円
インデックス・ブレンド(タイプ )		3,183,115円
世界6資産分散ファンド		126,123,039円
野村資産設計ファンド2060		2,979,626円
ノムラF O F s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)		2,786,983,814円
野村F O F s用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)		842,967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)		139,342,921円
野村D C新興国債券(現地通貨建て)インデックスファンド		473,352,411円
野村D C運用戦略ファンド		111,086,393円
野村D C運用戦略ファンド(マイルド)		10,780,051円

野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	10,688,868円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	7,586,662円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	3,941,442円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	1,907,862円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2022年12月26日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2022年12月26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	6,600,000.00	6,395,174.28		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,100,000.00	14,168,803.77		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,000,000.00	5,463,420.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,500,000.00	13,227,480.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	4,412,550.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	3,450,000.00	3,281,053.50		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,800,000.00	10,607,220.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	12,200,000.00	11,416,150.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,200,000.00	3,843,126.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	2,931,363.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,100,000.00	5,878,753.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,700,000.00	6,841,450.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,600,000.00	9,623,528.00		
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	7,800,000.00	7,606,235.52		
		小計	銘柄数：14	111,750,000.00	105,696,307.07	(722,624,512)
		組入時価比率：9.9%		10.1%		
		リアル	LETRA TESOURO NACIONAL	4,420,000.00	4,138,208.64	
			LETRA TESOURO NACIONAL	7,000,000.00	6,159,973.40	
			LETRA TESOURO NACIONAL	3,500,000.00	2,910,224.10	
			LETRA TESOURO NACIONAL	4,100,000.00	3,015,493.83	
			LETRA TESOURO NACIONAL	3,600,000.00	2,478,762.72	
			NOTA DO TESOURO NACIONAL	391,000.00	3,911,562.04	
			NOTA DO TESOURO NACIONAL	230,000.00	2,222,037.13	
			NOTA DO TESOURO NACIONAL	250,000.00	2,340,540.75	
			NOTA DO TESOURO NACIONAL	160,000.00	1,464,023.68	
	小計	銘柄数：9	23,651,000.00	28,640,826.29		

			(734,445,300)	
	組入時価比率：10.0%		10.3%	
チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	180,000,000.00	166,455,000.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	190,000,000.00	184,575,500.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	60,000,000.00	59,255,478.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	295,000,000.00	288,377,250.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	240,000,000.00	239,107,848.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	115,000,000.00	128,989,750.00	
小計	銘柄数：6	1,080,000,000.00	1,066,760,826.00	
	組入時価比率：2.2%		(161,035,014)	2.3%
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,790,000,000.00	1,592,992,600.00	
	TITULOS DE TESORERIA	950,000,000.00	925,896,980.00	
	TITULOS DE TESORERIA	890,000,000.00	766,316,967.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	685,757,070.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,460,000,000.00	1,096,668,196.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,330,000,000.00	1,014,663,783.00	
	TITULOS DE TESORERIA	800,000,000.00	571,763,280.00	
	TITULOS DE TESORERIA	990,000,000.00	683,946,252.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,850,000,000.00	1,241,933,675.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	529,709,760.00	
	TITULOS DE TESORERIA	560,000,000.00	324,058,784.00	
小計	銘柄数：11	12,420,000,000.00	9,433,707,347.00	
	組入時価比率：3.6%		(263,794,758)	3.7%
ソル	BONOS DE TESORERIA	200,000.00	197,402.00	
	BONOS DE TESORERIA	480,000.00	439,851.88	
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	527,311.98	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	559,976.90	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	519,590.40	
	PERU BONO SOBERANO	700,000.00	733,442.36	
	PERU BONO SOBERANO	500,000.00	471,374.25	
	PERU BONO SOBERANO	320,000.00	286,012.28	
	REPUBLIC OF PERU	1,100,000.00	1,042,924.52	
小計	銘柄数：9	5,300,000.00	4,777,886.57	
	組入時価比率：2.3%		(165,633,082)	2.3%
ウルグアイペソ	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	3,674,000.00	
小計	銘柄数：1	4,000,000.00	3,674,000.00	
	組入時価比率：0.2%		(12,494,171)	0.2%
セルビアディナール	SERBIA TREASURY BONDS	22,000,000.00	18,529,856.40	

小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.3%	22,000,000.00	18,529,856.40 (22,197,026) 0.3%
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	528,060.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	810,000.00	810,810.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	1,014,900.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	2,021,400.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	400,000.00	430,800.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	500,000.00	571,000.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	700,000.00	775,950.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,192,000.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,873,500.00
小計	銘柄数：9 組入時価比率：0.9%	8,250,000.00	9,218,420.00 (65,436,954) 0.9%
チェココルナ	CZECH REPUBLIC	14,000,000.00	13,335,980.00
	CZECH REPUBLIC	4,000,000.00	4,104,000.00
	CZECH REPUBLIC	6,400,000.00	5,568,768.00
	CZECH REPUBLIC	11,500,000.00	9,486,005.00
	CZECH REPUBLIC	4,300,000.00	4,420,400.00
	CZECH REPUBLIC	3,400,000.00	2,992,816.00
	CZECH REPUBLIC	13,200,000.00	10,051,800.00
	CZECH REPUBLIC	5,800,000.00	4,377,840.00
	CZECH REPUBLIC	11,300,000.00	8,643,935.00
	CZECH REPUBLIC	5,200,000.00	4,884,620.00
小計	銘柄数：10 組入時価比率：5.4%	79,100,000.00	67,866,164.00 (393,868,069) 5.5%
フォロント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	51,000,000.00	47,598,300.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	27,000,000.00	25,298,406.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	68,000,000.00	59,956,620.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	55,536,856.20
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	85,000,000.00	66,623,867.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	26,000,000.00	19,460,350.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	107,000,000.00	79,977,150.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	57,000,000.00	50,476,834.50
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	102,000,000.00	70,492,710.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	130,000,000.00	87,620,000.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	88,000,000.00	47,493,600.00
小計	銘柄数：11 組入時価比率：2.9%	804,000,000.00	610,534,693.70 (214,656,061) 3.0%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,432,100.00

小計	POLAND GOVERNMENT BOND	3,100,000.00	2,870,817.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	1,933,360.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,700,000.00	2,106,000.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	500,000.00	442,850.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,800,000.00	3,830,400.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,400,000.00	2,259,300.00
	銘柄数：7	20,200,000.00	16,874,827.00
組入時価比率：7.0%		(510,703,139)	
			7.1%
ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	21,000,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	21,000,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	28,300,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	32,500,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,000,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	38,700,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	29,000,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,700,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	16,000,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	24,000,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,200,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	26,500,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,500,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	0.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	51,000,000.00	0.00
	銘柄数：18	427,400,000.00	0.00
	組入時価比率：0.0%		(0)
			0.0%
レイ	ROMANIA	500,000.00	490,285.00
	ROMANIA	1,000,000.00	956,250.00
	ROMANIA	800,000.00	755,552.80
	ROMANIA	920,000.00	874,920.00
	ROMANIA	500,000.00	456,900.00
	ROMANIA	500,000.00	461,477.50
	ROMANIA	700,000.00	610,127.28
	ROMANIA	760,000.00	706,104.60
	ROMANIA	550,000.00	438,705.30
	ROMANIA	1,150,000.00	993,577.00
	ROMANIA	1,900,000.00	1,404,280.50
小計	銘柄数：11	9,280,000.00	8,148,179.98
			(232,524,612)

	組入時価比率：3.2%		3.3%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	806,294.88	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,850,000.00	2,857,958.34	
	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	774,989.92	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,800,000.00	1,895,805.72	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	416,054.84	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	700,000.00	702,494.45	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,398,851.86	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	605,496.78	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,215,024.68	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,306,953.18	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,411,359.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,475,915.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	497,548.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,082,618.28	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,926,436.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,111,059.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,570,000.00	1,442,031.49	
	小計	銘柄数：17	24,220,000.00	23,926,892.22 (715,851,939)
		組入時価比率：9.8%		10.0%
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,200,000.00	12,330,662.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	14,831,950.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,900,000.00	12,851,154.15	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	12,276,535.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,300,000.00	13,046,210.25	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,300,000.00	13,475,530.74	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,400,000.00	9,808,273.96	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	11,864,844.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,800,000.00	13,207,221.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,800,000.00	13,959,783.68	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,100,000.00	11,640,437.16	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,396,864.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,101,810.76	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,900,000.00	11,799,245.74	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,100,000.00	9,446,109.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,400,000.00	8,405,680.92	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,700,000.00	13,881,224.08	
	小計	銘柄数：17	191,200,000.00	190,323,537.74 (725,132,678)
		組入時価比率：9.9%		10.1%
ルピア	INDONESIA GOVERNMENT	5,530,000,000.00	5,706,010,499.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,800,000,000.00	3,924,158,160.00	

	INDONESIA GOVERNMENT	4,300,000,000.00	4,332,812,870.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,580,000,000.00	1,763,562,030.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,000,000,000.00	3,848,420,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,450,000,000.00	4,566,023,070.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	4,891,632,500.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,230,000,000.00	3,607,125,110.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,500,000,000.00	3,773,394,450.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,346,492,826.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,600,000,000.00	4,639,063,200.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,500,000,000.00	4,379,884,650.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,790,557,280.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,700,000,000.00	4,531,293,500.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,600,000,000.00	1,736,797,760.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,800,000,000.00	1,866,255,660.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	4,782,203,510.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,180,000,000.00	1,299,639,846.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,192,310,500.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,500,803,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,800,000,000.00	1,745,199,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,600,000,000.00	2,695,659,720.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,300,000,000.00	2,376,004,190.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,800,000,000.00	2,803,332,000.00	
小計	銘柄数：24	81,680,000,000.00	84,098,635,331.00	
			(714,838,400)	
	組入時価比率：9.8%		10.0%	
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	8,400,000.00	8,412,593.28	
	CHINA GOVERNMENT BOND	900,000.00	894,116.07	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,800,000.00	7,815,058.68	
	CHINA GOVERNMENT BOND	400,000.00	397,081.72	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,200,000.00	7,253,743.68	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,201,785.12	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,400,000.00	2,374,371.84	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,082,546.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	500,000.00	496,309.15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	700,000.00	697,737.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,167,157.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	400,000.00	410,449.28	
小計	銘柄数：12	37,900,000.00	38,202,950.82	
			(723,197,140)	
	組入時価比率：9.9%		10.1%	
エジプトポンド	EGYPT GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	1,843,954.00	
	EGYPT GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,498,274.00	

小計	EGYPT GOVERNMENT BOND	6,300,000.00	5,715,605.70	
	EGYPT GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	2,911,585.28	
	銘柄数：4	17,500,000.00	15,969,418.98	
	組入時価比率：1.2%		(85,391,677) 1.2%	
	ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	15,300,000.00	16,195,323.87
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,600,000.00	12,138,601.12
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,160,000.00	2,553,596.00
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,300,000.00	11,374,864.90
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000.00	8,361,649.89
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000.00	3,166,157.76
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000.00	7,866,540.00
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000.00	5,770,287.15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,050,000.00	3,168,945.70
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		8,800,000.00	6,870,807.68	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		14,200,000.00	11,125,122.06	
小計	銘柄数：11	105,110,000.00	88,591,896.13	
	組入時価比率：9.4%		(687,473,113) 9.6%	
合計			7,151,297,645 (7,151,297,645)	

(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	2022年12月26日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	5,307,260	-	5,291,756	15,504
米ドル	5,307,260	-	5,291,756	15,504
合計	5,307,260	-	5,291,756	15,504

(注)時価の算定方法

### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

2023年1月31日現在

資産総額	145,640,652円
負債総額	140,261円
純資産総額（ - ）	145,500,391円
発行済口数	119,755,802口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2150円

## 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

2023年1月31日現在

資産総額	66,106,362円
負債総額	66,532円
純資産総額（ - ）	66,039,830円
発行済口数	51,491,879口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2825円

## 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

2023年1月31日現在

資産総額	41,037,288円
負債総額	41,600円
純資産総額（ - ）	40,995,688円
発行済口数	31,157,528口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3158円

## 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

2023年1月31日現在

資産総額	34,194,424円
負債総額	34,322円
純資産総額（ - ）	34,160,102円
発行済口数	25,622,715口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3332円

## （参考）国内株式マザーファンド

2023年1月31日現在

資産総額	503,233,047,864円
負債総額	23,751,541,720円
純資産総額（ - ）	479,481,506,144円
発行済口数	223,424,080,004口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1461円

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2023年1月31日現在

資産総額	1,425,282,669,061円
負債総額	5,074,699,607円
純資産総額（ - ）	1,420,207,969,454円
発行済口数	311,091,961,787口
1口当たり純資産額（ / ）	4.5652円

## （参考）新興国株式マザーファンド

2023年1月31日現在

資産総額	93,241,636,190円
負債総額	3,161,412,523円
純資産総額（ - ）	90,080,223,667円
発行済口数	56,093,712,369口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6059円

## （参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

2023年1月31日現在

資産総額	867,653,562,191円
負債総額	12,702,020,342円
純資産総額（ - ）	854,951,541,849円
発行済口数	681,018,132,088口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2554円

## （参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

2023年1月31日現在

資産総額	219,446,732,339円
負債総額	108,713,835,437円
純資産総額（ - ）	110,732,896,902円
発行済口数	107,248,193,398口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0325円

## （参考）外国債券マザーファンド

2023年1月31日現在

資産総額	668,855,917,791円
負債総額	1,352,520,246円
純資産総額（ - ）	667,503,397,545円
発行済口数	268,231,361,208口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4885円

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2023年1月31日現在

資産総額	8,002,809,137円
負債総額	11,130,766円
純資産総額（ - ）	7,991,678,371円
発行済口数	5,464,846,901口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4624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

2023年2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。

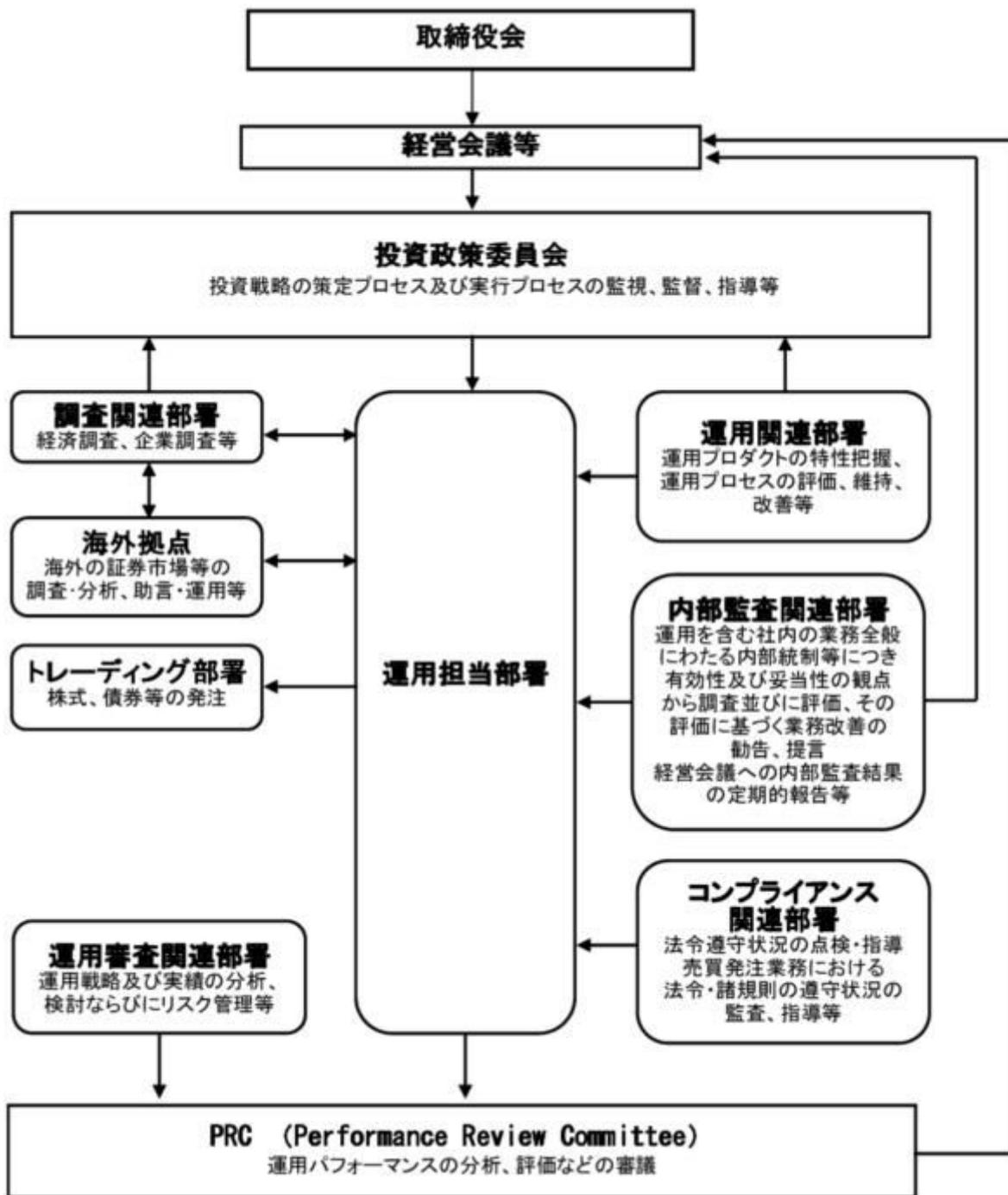
###### 代表取締役・業務執行取締役

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2023年1月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

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

追加型株式投資信託	1,006	39,212,144
単位型株式投資信託	197	844,284
追加型公社債投資信託	14	6,391,881
単位型公社債投資信託	483	1,102,736
合計	1,700	47,551,045

### 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(2021年4月1日から2022年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2022年4月1日から2022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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		4,281	2,006
金銭の信託		35,912	35,894
有価証券		30,400	29,300
前払金		-	11
前払費用		167	454
未収入金		632	694
未収委託者報酬		24,499	27,176
未収運用受託報酬		4,347	4,002
短期貸付金		-	1,835
その他		268	57
貸倒引当金		14	15
流動資産計		100,496	101,417
固定資産			
有形固定資産		2,666	1,744

建物	2	1,935		1,219	
器具備品	2	731		525	
無形固定資産			5,429		5,210
ソフトウェア		5,428		5,209	
その他		0		0	
投資その他の資産			16,487		16,067
投資有価証券		1,767		2,201	
関係会社株式		9,942		9,214	
長期差入保証金		330		443	
長期前払費用		15		13	
前払年金費用		1,301		1,297	
繰延税金資産		3,008		2,784	
その他		122		112	
固定資産計			24,583		23,023
資産合計			125,080		124,440

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

繰越利益剰余金		31,395		30,030	
評価・換算差額等			57		174
その他有価証券評価差額金			57		174
純資産合計			87,654		86,407
負債・純資産合計			125,080		124,440

## (2) 【損益計算書】

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

		前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,540		3,530	
受取利息		0		10	
金銭の信託運用益		1,698		-	
その他		447		1,268	
営業外収益計			6,687		4,809
営業外費用					
金銭の信託運用損		-		1,387	
時効後支払損引当金繰入額		13		12	
為替差損		26		23	
その他		32		266	
営業外費用計			72		1,689
経常利益			36,157		36,477
特別利益					
投資有価証券等売却益		71		26	
株式報酬受入益		48		53	
固定資産売却益		-		9	
資産除去債務履行差額		-		141	
移転補償金		2,077		-	
特別利益計			2,197		230
特別損失					
投資有価証券等売却損		-		0	
投資有価証券等評価損		36		-	
関係会社株式評価損		582		727	
固定資産除却損	2	105		374	
資産除去債務履行差額		-		0	
事務所移転費用		406		54	
特別損失計			1,129		1,158
税引前当期純利益			37,225		35,549
法人税、住民税及び事業税			11,239		10,474
法人税等調整額			290		171
当期純利益			26,276		24,904

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本							株主 資本 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		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	29,069	54,360	85,270
当期変動額									
剰余金の配当							23,950	23,950	23,950
当期純利益							26,276	26,276	26,276
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,326	2,326	2,326
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	10	10	85,281
当期変動額			
剰余金の配当			23,950
当期純利益			26,276
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	46	46	46
当期変動額合計	46	46	2,372
当期末残高	57	57	87,654

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		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	31,395	56,686	87,596
当期変動額									
剰余金の配当							26,268	26,268	26,268
当期純利益							24,904	24,904	24,904

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,364	1,364	1,364
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,030	55,322	86,232

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	57	57	87,654
当期変動額			
剰余金の配当			26,268
当期純利益			24,904
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	116	116	116
当期変動額合計	116	116	1,247
当期末残高	174	174	86,407

## [重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(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 ... 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
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4．外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 6年 附属設備 6～15年 器具備品 4～15年

## 6．引当金の計上基準

## (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。

## (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。

## (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。

## (3) 退職給付引当金

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

## 退職給付見込額の期間帰属方法

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

## 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

## (4) 時効後支払損引当金

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

## 7．収益及び費用の計上基準

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

## 委託者報酬

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

## 運用受託報酬

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

## 成功報酬

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

## 8．消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。

9. 連結納税制度の適用	<p>連結納税制度を適用しております。</p> <p>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>
--------------	--

## [ 会計上の見積りに関する注記 ]

該当事項はありません。

## [ 会計方針の変更 ]

## （収益認識に関する会計基準等の適用）

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

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

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

これによる財務諸表に与える影響は軽微であります。

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

## （時価の算定に関する会計基準の適用）

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

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

## [ 未適用の会計基準等 ]

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

## (1) 概要

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

## (2) 適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 1,256百万円	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 1,223百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 346百万円 器具備品 643 合計 990	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 589百万円 器具備品 618 合計 1,207

損益計算書関係

前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,334百万円	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 3,525百万円
2. 固定資産除却損 建物 -百万円 器具備品 2 ソフトウェア 102 合計 105	2. 固定資産除却損 建物 346百万円 器具備品 28 ソフトウェア - 合計 374

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

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

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

### (1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

#### 普通株式の配当に関する事項

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

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

2022年5月18日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

#### 普通株式の配当に関する事項

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

## 金融商品関係

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとん

どないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### (1) 現金・預金

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

### (2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引

先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,767百万円、関係会社株式9,942百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について618百万円（投資有価証券35百万円、関係会社株式582百万円）減損処理を行っております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	4,281	-	-	-
金銭の信託	35,912	-	-	-
未収委託者報酬	24,499	-	-	-
未収運用受託報酬	4,347	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	30,400	-	-	-
合計	99,441	-	-	-

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持等を目的と

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

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

## （２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。

(単位：百万円)

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

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

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

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

- ( ) 1 市場価格のない株式等には非上場株式等が含まれております。  
2 非上場株式等について、当事業年度において727百万円減損処理を行っております。

(注) 3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	2,006	-	-	-
金銭の信託	35,894	-	-	-
未収委託者報酬	27,176	-	-	-
未収運用受託報酬	4,002	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	29,300	-	-	-
短期貸付金	1,835			
合計	100,215	-	-	-

### 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

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

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

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

#### 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## デリバティブ取引

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

## 有価証券関係

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(2021年3月31日)

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

区分	前事業年度 (百万円)
子会社株式	9,835
関連会社株式	106

## 4．その他有価証券(2021年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 譲渡性預金	30,400	30,400	-
小計	30,400	30,400	-
合計	30,400	30,400	-

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

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

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2022年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2022年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2022年3月31日)

市場価格のない株式等の貸借対照表計上額

区分	当事業年度 (百万円)
子会社株式	9,107
関連会社株式	106

4．その他有価証券(2022年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 譲渡性預金	29,300	29,300	-
小計	29,300	29,300	-
合計	29,300	29,300	-

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

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

該当事項はありません。

デリバティブ取引関係

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

## 退職給付関係

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
1. 採用している退職給付制度の概要	
当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
2. 確定給付制度	
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	23,761 百万円
勤務費用	1,016
利息費用	139
数理計算上の差異の発生額	893
退職給付の支払額	781
その他	28
退職給付債務の期末残高	23,270
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	17,413 百万円
期待運用収益	409
数理計算上の差異の発生額	1,328
事業主からの拠出額	824
退職給付の支払額	626
年金資産の期末残高	19,349
(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表	
積立型制度の退職給付債務	19,959 百万円
年金資産	19,349
	610
非積立型制度の退職給付債務	3,311
未積立退職給付債務	3,921
未認識数理計算上の差異	2,074
未認識過去勤務費用	151
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998
退職給付引当金	3,299
前払年金費用	1,301
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	1,016 百万円
利息費用	139
期待運用収益	409
数理計算上の差異の費用処理額	469
過去勤務費用の費用処理額	34
確定給付制度に係る退職給付費用	1,182
(5) 年金資産に関する事項	
年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	52%
株式	30%
生保一般勘定	11%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.8%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、206百万円でした。

## 当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,270 百万円
勤務費用	961
利息費用	176
数理計算上の差異の発生額	1,521
退職給付の支払額	904
その他	14
退職給付債務の期末残高	21,967

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	961 百万円
利息費用	176
期待運用収益	454
数理計算上の差異の費用処理額	322
過去勤務費用の費用処理額	45
確定給付制度に係る退職給付費用	959
(5) 年金資産に関する事項	
年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	51%
株式	32%
生保一般勘定	10%
生保特別勘定	6%
その他	1%
合計	100%
長期期待運用収益率の設定方法	
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。	
(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企業年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.5%

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

## 税効果会計関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022年3月31日)
------------------------	------------------------

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
	百万円		百万円
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	1,176	賞与引当金	1,381
退職給付引当金	1,022	退職給付引当金	990
関係会社株式評価減	784	関係会社株式評価減	1,010
未払事業税	430	未払事業税	285
投資有価証券評価減	428	投資有価証券評価減	110
減価償却超過額	223	減価償却超過額	272
時効後支払損引当金	179	時効後支払損引当金	182
関係会社株式売却損	148	関係会社株式売却損	505
ゴルフ会員権評価減	135	ゴルフ会員権評価減	92
資産除去債務	425	資産除去債務	348
未払社会保険料	95	未払社会保険料	114
その他	358	その他	84
繰延税金資産小計	5,410	繰延税金資産小計	5,376
評価性引当額	1,530	評価性引当額	1,795
繰延税金資産合計	3,879	繰延税金資産合計	3,581
繰延税金負債		繰延税金負債	
資産除去債務に対応する除去費用	361	資産除去債務に対応する除去費用	233
関係会社株式評価益	80	関係会社株式評価益	81
その他有価証券評価差額金	25	その他有価証券評価差額金	78
前払年金費用	403	前払年金費用	402
繰延税金負債合計	871	繰延税金負債合計	796
繰延税金資産の純額	3,008	繰延税金資産の純額	2,784
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	
法定実効税率	31.0%	法定実効税率	31.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	3.5%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.9%
タックスヘイブン税制	1.9%	タックスヘイブン税制	1.8%
外国税額控除	0.5%	外国税額控除	0.5%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.2%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.4%
その他	0.3%	その他	0.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.9%

### 資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

#### 1. 当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

#### 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

#### 3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：百万円)

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

## 収益認識に関する注記

### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当事業年度（自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）

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

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

### 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

[重要な会計方針] 7. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## セグメント情報等

前事業年度（自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）

### 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### 2. 関連情報

#### （1）製品・サービスごとの情報

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

#### （2）地域ごとの情報

##### 売上高

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

##### 有形固定資産

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

### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

### (1) 製品・サービスごとの情報

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

### (2) 地域ごとの情報

#### 売上高

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

#### 有形固定資産

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

### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 関連当事者情報

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

### (ア) 親会社及び法人主要株主等

(イ) 子会社等  
該当はありません。

### (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)

親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1)	26,722	未払手数料	5,690
							コマーシャル・ペーパーの償還(*2)	20,000	有価証券	-
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

(\*2) コマーシャル・ペーパーの購入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

## (イ) 子会社等

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

## （ウ）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	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）	29,119	未払手数料	6,013

## （エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

## 1株当たり情報

前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
1株当たり純資産額	17,018円01銭	1株当たり純資産額	16,775円81銭
1株当たり当期純利益	5,101円61銭	1株当たり当期純利益	4,835円10銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	26,276百万円	損益計算書上の当期純利益	24,904百万円
普通株式に係る当期純利益	26,276百万円	普通株式に係る当期純利益	24,904百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

中間財務諸表

中間貸借対照表

		2022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		1,959
金銭の信託		40,970
有価証券		8,000
未収委託者報酬		27,052
未収運用受託報酬		4,915
短期貸付金		1,448
その他		923
貸倒引当金		16
流動資産計		85,253
固定資産		
有形固定資産	1	1,534
無形固定資産		5,483
ソフトウェア		5,482
その他		0
投資その他の資産		15,974
投資有価証券		2,133
関係会社株式		10,025
長期差入保証金		519
前払年金費用		1,433
繰延税金資産		1,758
その他		104
固定資産計		22,993
資産合計		108,246

		2022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		12,363
未払収益分配金		0
未払償還金		11
未払手数料		8,301
関係会社未払金		3,205
その他未払金	2	842
未払費用		9,504
未払法人税等		1,213
賞与引当金		2,096
その他		226
流動負債計		25,405
固定負債		
退職給付引当金		3,045
時効後支払損引当金		595
資産除去債務		1,123
固定負債計		4,763
負債合計		30,169
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		17,180
資本剰余金		13,729
資本準備金		11,729
その他資本剰余金		2,000
利益剰余金		46,860
利益準備金		685
その他利益剰余金		46,175
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		21,568
評価・換算差額等		307

その他有価証券評価差額金		307
純資産合計		78,077
負債・純資産合計		108,246

## 中間損益計算書

区分	注記 番号	自 2022年4月 1日 至 2022年9月30日
		金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		57,740
運用受託報酬		9,162
その他営業収益		181
営業収益計		67,085
営業費用		
支払手数料		19,423
調査費		14,540
その他営業費用		2,613
営業費用計		36,577
一般管理費	1	14,575
営業利益		15,931
営業外収益	2	7,366
営業外費用	3	1,574
経常利益		21,723
特別利益	4	30
特別損失	5	49
税引前中間純利益		21,705
法人税、住民税及び事業税		4,322
法人税等調整額		966
中間純利益		16,415

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

(単位：百万円)

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

	資本金	資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	資本合計
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,030	55,322	86,232
当中間期変動額									
剰余金の配当							24,877	24,877	24,877
中間純利益							16,415	16,415	16,415
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	-	-	-	-	-	-	8,461	8,461	8,461
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	21,568	46,860	77,770

(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	174	174	86,407
当中間期変動額			
剰余金の配当			24,877
中間純利益			16,415
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	132	132	132
当中間期変動額合計	132	132	8,329
当中間期末残高	307	307	78,077

## [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 市場価格のない ... 時価法 株式等以外のもの (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。)  市場価格のない ... 移動平均法による原価法 株式等
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

## 5. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	6年
附属設備	6～15年
器具備品	4～15年

## (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。

## 6. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

債権の貸倒損失に備えるため、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。

## (2) 賞与引当金

賞与の支払いに備えるため、支払見込額に基づき当中間会計期間に見合う分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) 時効後支払損引当金

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

7. 収益及び費用の計上基準	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <p><b>委託者報酬</b></p> <p>委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p><b>運用受託報酬</b></p> <p>運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき契約期間の純資産総額等に対する一定割合として認識され、確定した報酬を顧問口座によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p><b>成功報酬</b></p> <p>成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
8. 消費税等の会計処理方法	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理していません。</p>

## [会計方針の変更]

（時価の算定に関する会計基準の適用）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することとしております。

これによる中間財務諸表に与える影響はありません。

## [追加情報]

当社は、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。

また、実務対応報告第42号第32項（1）に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

## [注記事項]

## 中間貸借対照表関係

2022年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	1,577百万円

## 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 2022年4月 1日
		至 2022年9月30日
1	減価償却実施額	
	有形固定資産	210百万円
	無形固定資産	992百万円
2	営業外収益のうち主要なもの	
	受取配当金	6,933百万円
3	営業外費用のうち主要なもの	
	金銭の信託運用損	1,439百万円
	時効後支払損引当金繰入	7百万円
4	特別利益の内訳	
	投資有価証券等売却益	10百万円
	株式報酬受入益	19百万円
5	特別損失の内訳	
	投資有価証券等売却損	16百万円
	固定資産除却損	33百万円

## 中間株主資本等変動計算書関係

		自 2022年4月 1日										
		至 2022年9月30日										
1	発行済株式に関する事項											
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>株式の種類</th> <th>当事業年度期首</th> <th>増加</th> <th>減少</th> <th>当中間会計期間末</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>普通株式</td> <td>5,150,693株</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>5,150,693株</td> </tr> </tbody> </table>	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	
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											
	2022年5月18日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。											
	・普通株式の配当に関する事項											
	(1) 配当金の総額	24,877百万円										
	(2) 1株当たり配当額	4,830円										
	(3) 基準日	2022年3月31日										
	(4) 効力発生日	2022年6月30日										

## 金融商品関係

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

2022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。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	40,970	40,970	-

資産計	40,970	40,970	-
(2)その他（デリバティブ取引）	74	74	-
負債計	74	74	-

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

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

	中間貸借対照表計上額 (百万円)
市場価格のない株式等（ ）	10,260
組合出資金等	1,898
合計	12,159

（ ）市場価格のない株式等には非上場株式等が含まれております。

## 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

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

### （1）時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	中間貸借対照表計上額（単位：百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託（運用目的・その他）	-	40,970	-	40,970
資産計	-	40,970	-	40,970
デリバティブ取引（通貨関連）	-	74	-	74
負債計	-	74	-	74

（注）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

#### 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。構成物のレベルに基づき、レベル2の時価に分類しております。

#### デリバティブ取引

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

## 有価証券関係

当中間会計期間末（2022年9月30日）

## 1．売買目的有価証券(2022年9月30日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(2022年9月30日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(2022年9月30日)

市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額

区分	中間貸借対照表 計上額（百万円）
子会社株式	9,919
関連会社株式	106

## 4．その他有価証券(2022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	8,000	8,000	-
小計	8,000	8,000	-
合計	8,000	8,000	-

## デリバティブ取引関係

## 1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

当中間会計期間（2022年9月30日）

区分	取引の種類	契約額等 （百万円）	契約額等 のうち一年超 （百万円）	時価 （百万円）	評価損益 （百万円）
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,371	-	74	74

## 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 2022年4月 1日 至 2022年9月30日
期首残高	1,123
有形固定資産の取得に伴う増加 時の経過による調整額	-
中間期末残高	1,123

## 収益認識に関する注記

## 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

区分	当中間会計期間 (自 2022年4月 1日 至 2022年9月30日)
委託者報酬	57,740百万円
運用受託報酬	8,912百万円
成功報酬（注）	250百万円
その他営業収益	181百万円
合計	67,085百万円

（注）成功報酬は、中間損益計算書において委託者報酬または運用受託報酬に含めて表示していません。

## 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

[重要な会計方針] 7. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## セグメント情報等

当中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月 1日 至 2022年9月30日
------------------------------

1株当たり純資産額	15,158円67銭
-----------	------------

1株当たり中間純利益	3,187円11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、潜在株式がないため、記載していません。

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	16,415百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	16,415百万円
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 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

\* 2023年1月末現在

## (2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
野村証券株式会社	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。

\* 2023年1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】

(2022年9月末現在の持株比率5.0%以上を記載します。)

## (1) 受託者

該当事項はありません。

## (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【その他】

(1)目論見書の表紙にロゴ・マークや図案を採用すること、またファンドの形態などの記載をすることがあります。

(2)目論見書の巻末に約款を掲載する場合があります。

(3)届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助ける

ため、当該内容を説明した図表等を付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

- (4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- (6)目論見書の表紙裏等にインターネットホームページに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含む）も掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)目論見書に当該委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額および目論見書の使用を開始する日を記載することがあります。
- (8)目論見書に投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

2022年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

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

#### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第63期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### その他の記載内容

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

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

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的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。

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

## 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2023年3月7日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

## EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型の2021年12月28日から2022年12月26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2022年12月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2023年3月7日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

## EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型の2021年12月28日から2022年12月26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2022年12月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2023年3月7日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

## EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型の2021年12月28日から2022年12月26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2022年12月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2023年3月7日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

## EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016-2035-2037年目標型の2021年12月28日から2022年12月26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2022年12月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2022年11月24日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚  
業務執行社員指定有限責任社員 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2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022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2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022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、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。

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

## 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。