

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年9月20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】	野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040
【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】	4兆円を上限とします。
【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】

野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

（以下「ファンド」といいます。なお、ファンドの愛称を「未来時計DC・つみたてNISA2040」としません。）

### （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】

4兆円を上限とします。

### （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】

ありません。

**( 6 ) 【申込単位】**

1円以上1円単位（当初元本1口 = 1円）

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】**

2022年9月21日から2023年9月21日まで

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

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

**( 9 ) 【払込期日】**

取得申込日の翌々営業日までに申込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。

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 1 2 ）【その他】

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）の各債券、国内および外国（新興国を含む）の各株式、国内および外国の各不動産投資信託証券（REIT）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、信託財産の長期的な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「国内債券NOMURA-BPI総合 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」、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」とします。

##### 信託金の限度額

受益権の信託金限度額は、2兆円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

##### <商品分類>

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

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

（野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040）

##### 《商品分類表》

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

##### 《属性区分表》

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	<b>グローバル</b> <b>(日本を含む)</b> 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) 日々	北米 欧州 アジア オセアニア	<b>ファミリーファンド</b>	あり ( )	日経225  T O P I X
不動産投信 <b>その他資産</b> <b>(投資信託証券</b> <b>(資産複合</b> <b>(株式、債券、</b> <b>不動産投信)</b> <b>資産配分変更型))</b>	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	<b>なし</b>	<b>その他</b> <b>(合成指数)</b>
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型					

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

#### < 商品分類表定義 >

##### [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

##### [ 投資対象地域による区分 ]

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

##### [ 投資対象資産による区分 ]

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

があるものをいう。

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

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

#### < 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

##### 株式

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

##### 債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

#### [ 決算頻度による属性区分 ]

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

#### [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

#### [ 特殊型 ]

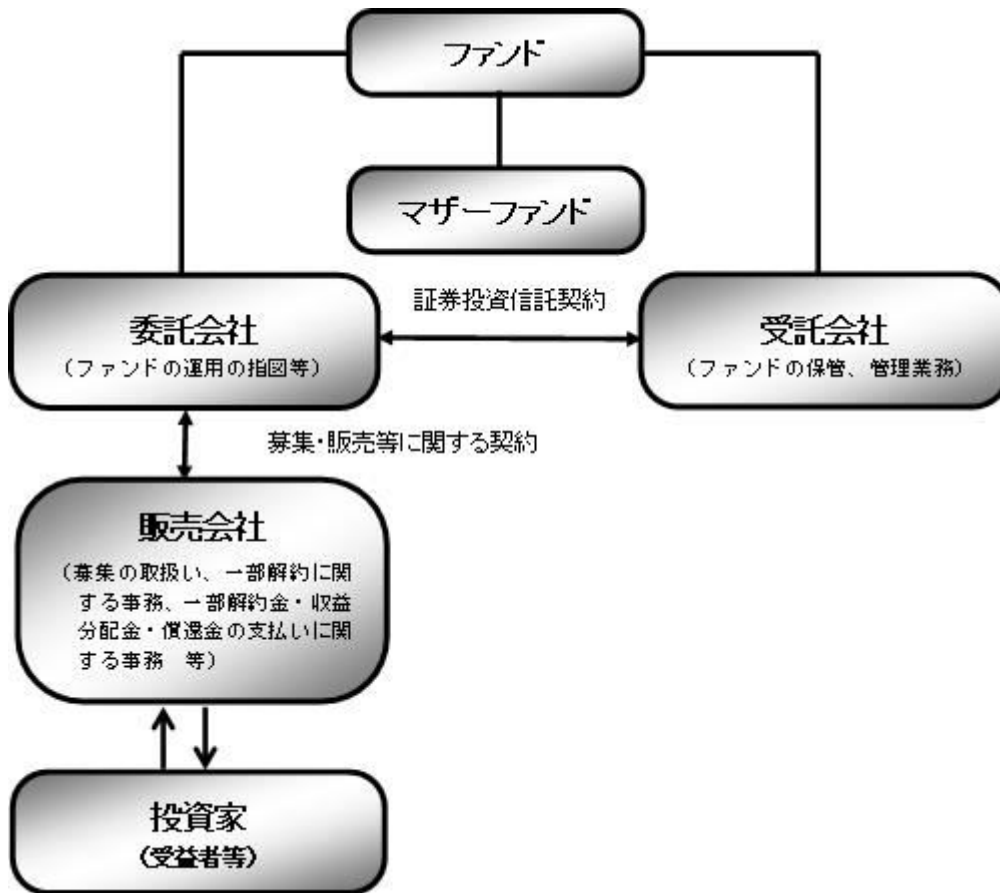
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定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

## ( 2 ) 【ファンドの沿革】

2017年8月31日	信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始
2019年10月1日	「野村資産設計ファンド(DC)2040」から「野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040」へ名称を変更

## ( 3 ) 【ファンドの仕組み】





ファンド	野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040
マザーファンド （親投資信託）	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド 外国債券マザーファンド 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド 国内株式マザーファンド 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド 新興国株式マザーファンド J-REITインデックス マザーファンド 海外REITインデックス マザーファンド
委託会社（委託者）	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社（受託者）	野村信託銀行株式会社

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



委託会社の概況(2022年8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】

2040年6月の決算日の翌日（第24計算期間開始日）をターゲットイヤー（安定運用開始時期）とし、ターゲットイヤーに近づくにしたがって、リスクを徐々に減らすことを基本とします。

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。

マザーファンドへの投資を通じて、金融指標の動きに連動する投資成果を目指すため、有価証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実質的に投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的または為替相場等の変動リスクを減じる目的で、ヘッジ目的外の利用も含め実質的に活用する場合があります。

当初設定時に投資するマザーファンドは、以下の通りです。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。

マザーファンド名	主要投資対象	対象指数
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
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） ・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。
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） ・MSCI-KOKUSAI 指数をもとに、委託会社が円換算したもので す。
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR （預託証券） <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） ・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。
J-REITインデックス マザーファンド	J-REIT <sup>*2</sup>	東証REIT指数（配当込み）
海外REITインデックス マザーファンド	日本を除く世界各国 のREIT <sup>*3</sup>	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベー ス） ・S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、ドルベース）を もとに、委託会社が円換算したものです。

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

\*3 世界の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投  
資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。なお、国によっては、「不動産投資信託証  
券」について、「REIT」という表記を用いていない場合もありますが、ファンドにおいては、こうした場合も含  
め、全て「REIT」といいます。

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。

当初設定以降、定期的 に各マザーファンドへの基本投資割合を変更し、安定運用開始時期に近づくにし  
たがって、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で、リスク  
を徐々に減らすことを基本とします。

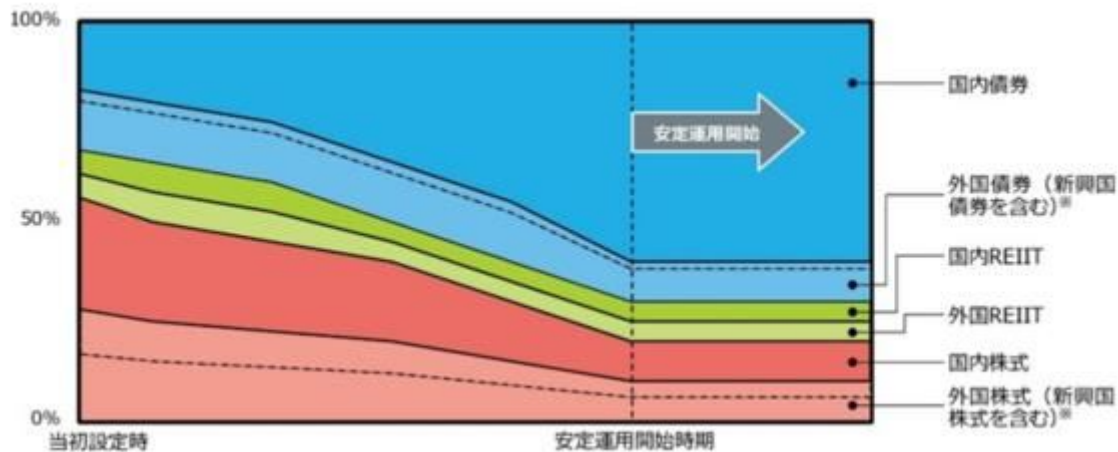
定期的な基本投資割合の変更は、家計や市場の構造変化等を考慮し、原則年1回行なうことを基本とします。

当初設定時および安定運用開始時期以降のマザーファンドを通じた各資産への基本投資割合はそれぞ  
れ以下を基本とします。

#### 基本投資割合

		当初設定時	安定運用 開始時期以降	2022年9月 現在
国内債券	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	17.0%	60%	22.0%
外国債券	外国債券マザーファンド	12.3%	10%	11.5%
	新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	2.7%		3.5%
国内株式	国内株式マザーファンド	28.0%	10%	24.0%
外国株式	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	16.8%	10%	14.0%
	新興国株式マザーファンド	11.2%		10.0%
国内REIT	J-REITインデックス マザーファンド	6.0%	5%	7.5%
外国REIT	海外REITインデックス マザーファンド	6.0%	5%	7.5%

#### 基本投資割合のイメージ図



新興国債券、新興国株式の割合は、各々外国債券、外国株式内に点線で示しています。

\* 上記の図表は現時点で決定している基本投資割合をもとにしたイメージ図です。

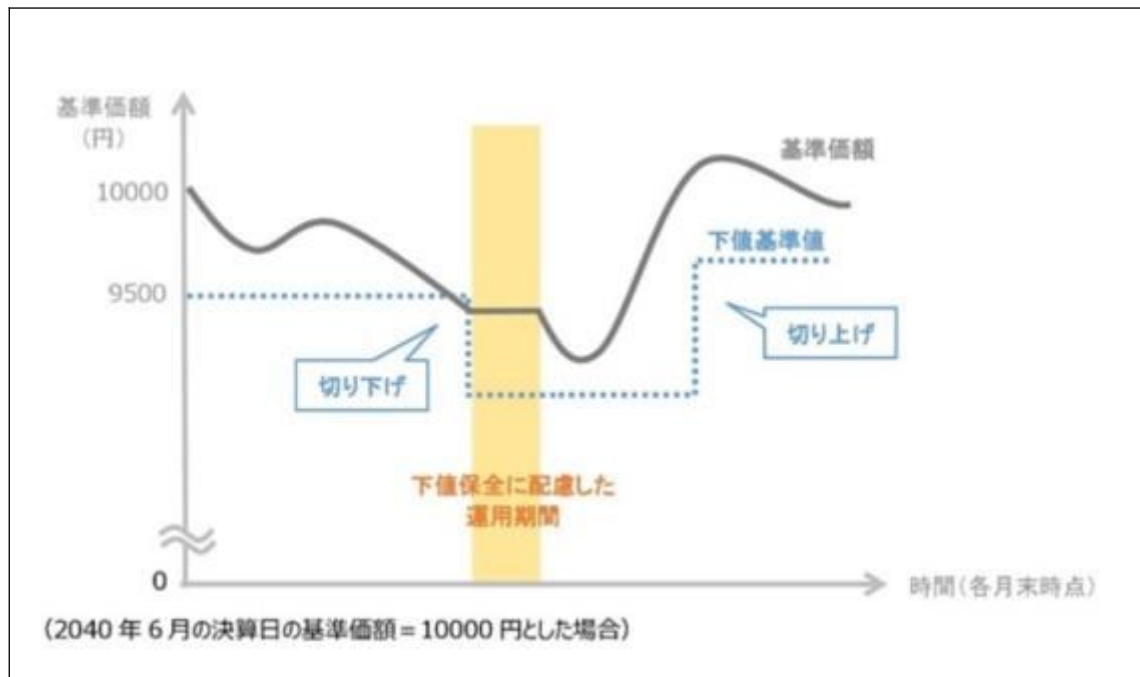
安定運用開始時期以降は、各月末時点において、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、マザーファンドを通じて投資する各資産への実質的なエクスポージャーを引き下げ、短期有価証券等へ投資する運用（「下値保全に配慮した運用」といいます。）を行いません。

各資産へ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。

下値保全に配慮した運用を行なうにあたっては、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的で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。

- ・ 委託会社の定める下値基準値は、当初、2040年6月の決算日の基準価額の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2040年6月の決算日）の基準価額を一定水準上回った場合には切り上げを行いません。
- ・ 下値保全に配慮した運用に切り替えた場合の、下値保全に配慮した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。
- ・ 下値保全に配慮した運用期間終了後は、安定運用期における基本投資割合となるよう、各資産へ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）



実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、2040年6月の決算日の翌日以降、下値保全に配慮した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

## NOMURA-BPI総合

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

## FTSE世界国債インデックス(除く日本、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」

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。

## 「東証株価指数（TOPIX）」、「東証REIT指数（配当込み）」

東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」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）、東証REIT指数（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）、東証REIT指数（配当込み）に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有する。

JPXは、東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）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）、東証REIT指数（配当込み）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）、東証REIT指数（配当込み）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。

JPXは、東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）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）、東証REIT

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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）の各債券、国内および外国（新興国を含む）の各株式、国内および外国の各不動産投資信託証券（REIT）に投資を行いません。なお、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。

各マザーファンドの主要投資対象

マザーファンド名	主要投資対象
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	わが国の公社債
外国債券マザーファンド	外国の公社債
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債
国内株式マザーファンド	わが国の株式
外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	外国の株式
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）
J-REITインデックス マザーファンド	J-REIT
海外REITインデックス マザーファンド	日本を除く世界各国のREIT

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。

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

イ．有価証券

- ロ．デリバティブ取引(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、下記「(5)投資制限、及び」に定めるものに限り、)に係る権利
  - ハ．約束手形(イに掲げるものに該当するものを除きます。)
  - ニ．金銭債権(イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。)
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
- イ．為替手形
  - ロ．次に掲げるものをすべてみだす資産
    - ・リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティ・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。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債券のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債券についての社債券であって当該社債券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、ならびに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券を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債券」といいます。 )
6. 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。 )
7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。 )
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。 )
9. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。 )
10. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。 )
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券および新株予約権証券
13. 外国の者の発行する証券または証書で、第1号もしくは第5号の証券または証書の性質を有するプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの
14. 前号以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第12号の証券または証書の性質を有するもの

15. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
16. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
17. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。)
19. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
20. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
23. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

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

#### 金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

## (2) 投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

## （外国債券マザーファンド）

### 運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1．基本方針

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

#### 2．運用方法

##### (1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

##### (3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

利用は行ないません。

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

## （新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド）

### 運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1．基本方針

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

#### 2．運用方法

##### (1) 投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

##### (3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一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。

## （国内株式マザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1. 基本方針

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

## 2. 運用方法

## (1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

## (2) 投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

## （外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1. 基本方針

この投資信託は、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える

投資成果を目指して運用を行ないます。

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

（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。

## （J-REITインデックス マザーファンド）

### 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

### (1) 投資対象

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

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

### (2) 投資態度

J-REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への直接投資は行ないません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

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

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

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

## （海外REITインデックス マザーファンド）

### 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1. 基本方針

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

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

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

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

海外の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券

（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。

## (2) 投資態度

REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

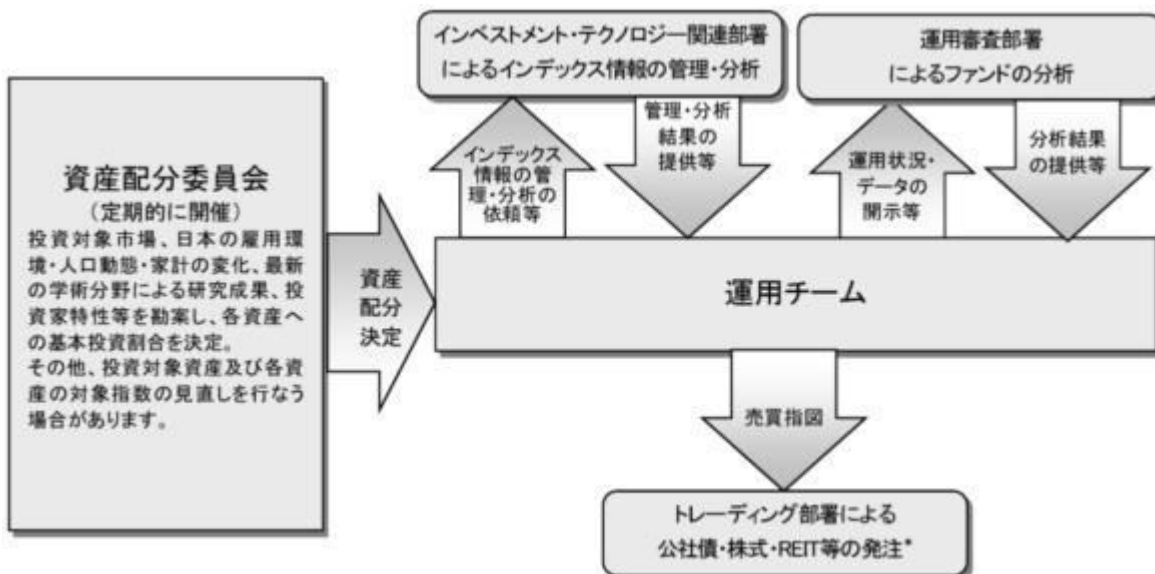
同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超えるREITがある場合には、当該REITをS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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

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

## (3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。

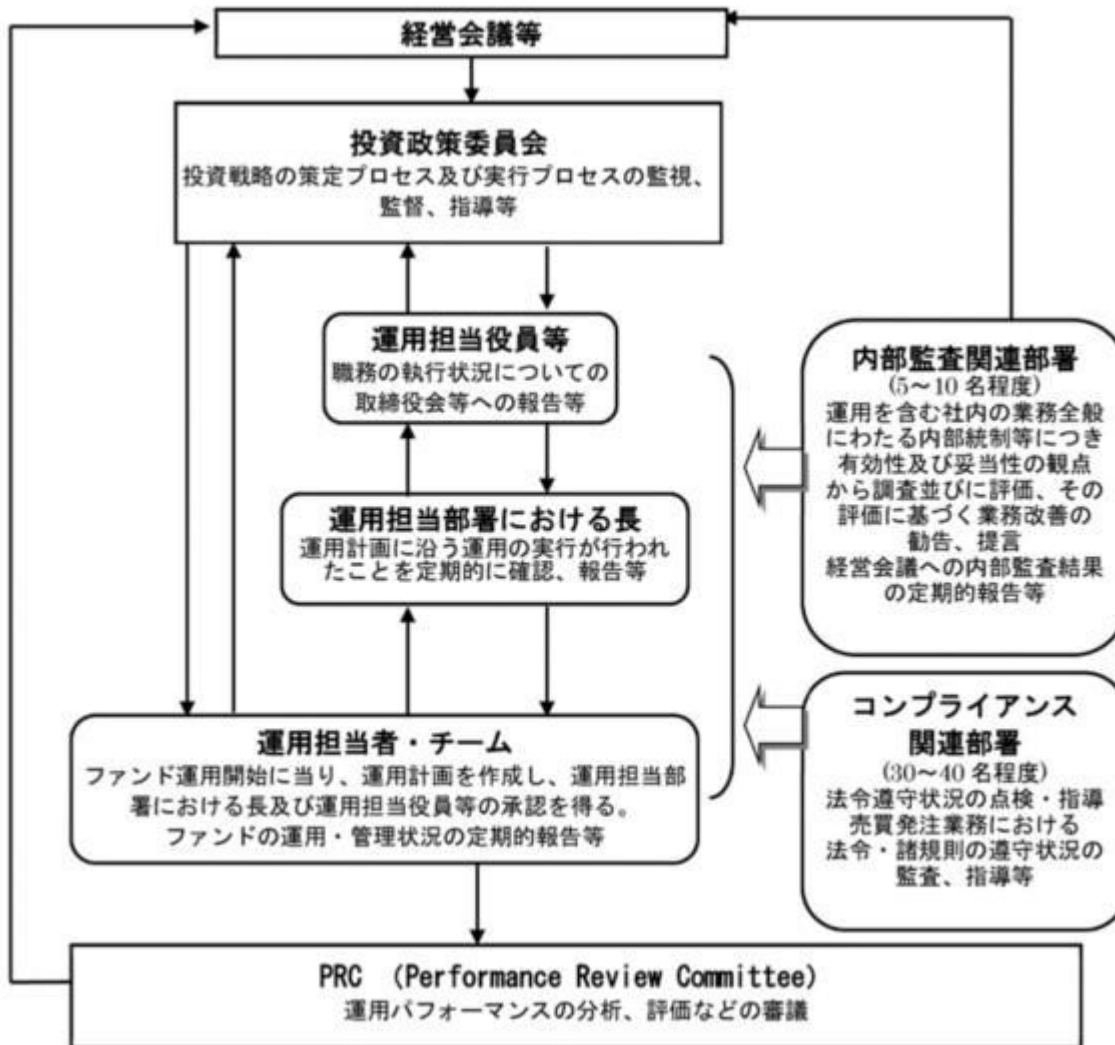


\* 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおける公社債等の発注業務（発注に伴う裁量権は付与しないものとします。）の一部をノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッドに代行させます。

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おります。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

#### (4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

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

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

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

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

#### ファンドの決算日

原則として**毎年6月22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
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ならびに有価証券店頭デリバティブ取引(金融商品取引法第28条第8項第4号イから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( )の店頭デリバティブ取引の評価は、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( )の店頭デリバティブ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たときは、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たときは、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たときは、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たとき

は、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 資金の借入れ(信託約款)

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

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

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

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

### 3【投資リスク】

#### 基準価額の変動要因

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

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

#### [株価変動リスク]

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

#### [REITの価格変動リスク]

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

#### [債券価格変動リスク]

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

#### [為替変動リスク]



ファンドは、実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行いませんので、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がある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、下値保全に配慮した運用期間中は、ファンドの基準価額は合成指数に連動しません。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。

安定運用開始時期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、下値保全に配慮した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。

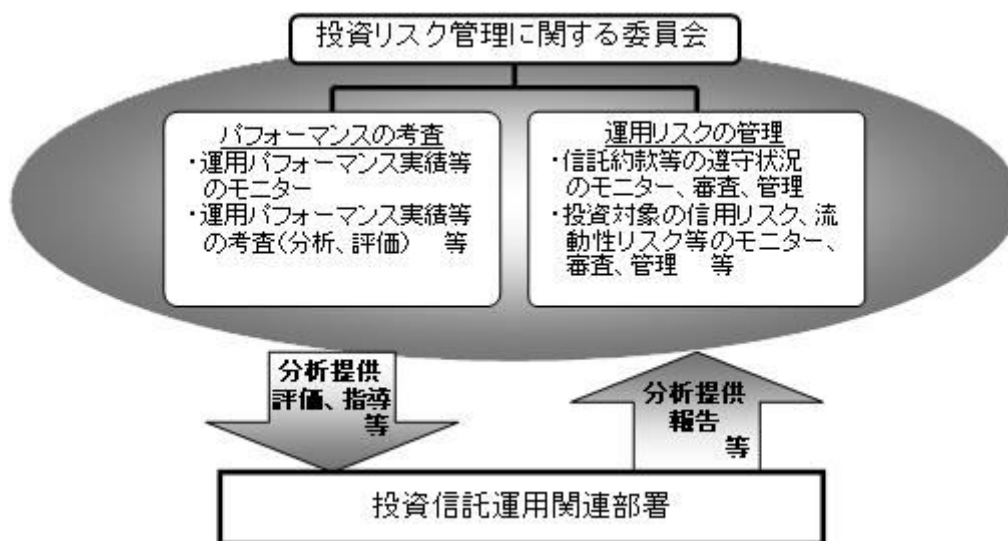
### 運用リスクの管理

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。



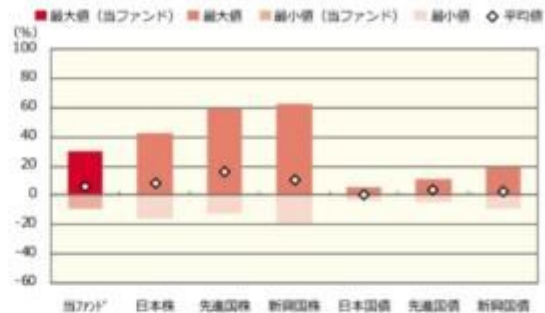
## 投資リスク

### ■ リスクの定量的比較（2017年8月末～2022年7月末：月次）

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド*	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	30.0	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 8.7	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 3.5	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	6.1	8.7	16.5	10.5	0.1	3.6	2.7

\* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を 10,000 とし指数化し、設定日の属する月末より表示しております。  
\* 年間騰落率は、2017 年 8 月から 2022 年 7 月の各月末における 1 年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載していません。

\* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。  
\* 2017 年 8 月から 2022 年 7 月の 5 年間（当ファンドは 2018 年 8 月から 2022 年 7 月）の各月末における 1 年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。  
\* 決算日に対応した数値とは異なります。  
\* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。  
\* 当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載していません。

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



## 投資リスク

### <代表的な資産クラスの指数>

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

### ■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

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

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

## 4 【手数料等及び税金】

### （1）【申込手数料】

申込手数料はありません。

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、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	1期～23期 (設定日～2040年決算日)	24期以降 (2040年決算日翌日以降)
信託報酬率	年0.462% (税抜年0.42%)	年0.418% (税抜年0.38%)
委託会社	年0.19%	年0.17%
販売会社	年0.19%	年0.17%
受託会社	年0.04%	年0.04%

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

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。

\* 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

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税、復興特別所得税および地方税がかかりません。

なお、上記以外の受益者(法人)の場合の課税の取扱いは下記の通りです。

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### 換金（解約）時および償還時の課税について

##### [ 個人の投資家の場合 ]

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

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

##### [ 法人の投資家の場合 ]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

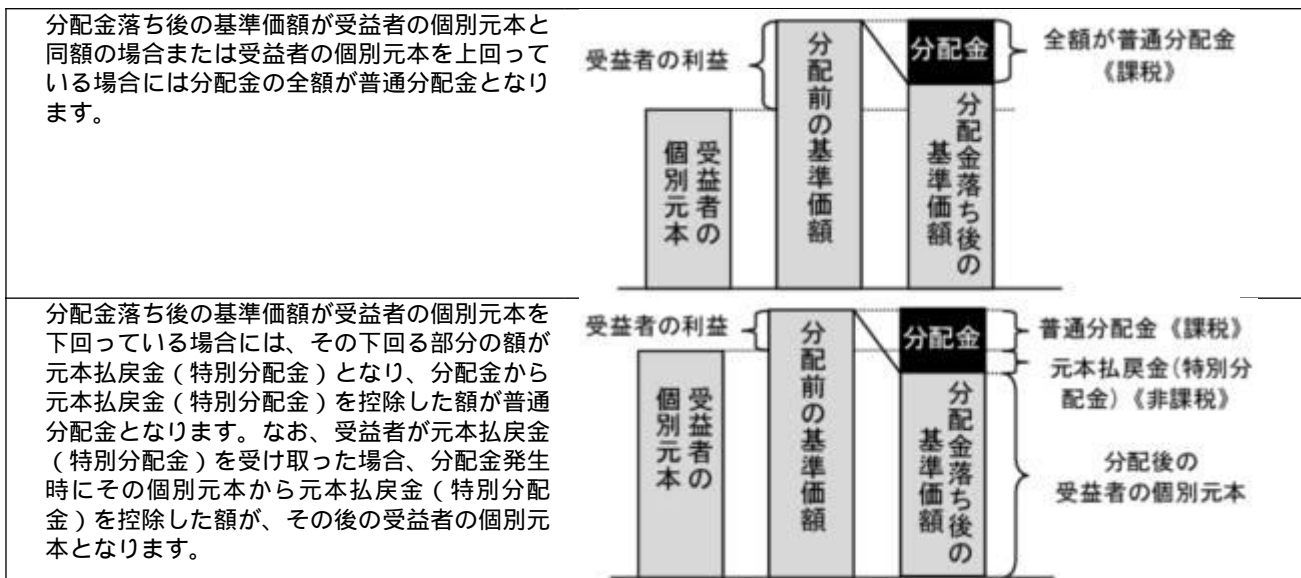
#### 個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

#### 分配金の課税について

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



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

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

\* 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容(2022年7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2022年7月29日現在の運用状況であります。

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

（１）【投資状況】

野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

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	257,979,128	99.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）		257,095	0.09
合計（純資産総額）		258,236,223	100.00

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	704,919,768,850	80.77
地方債証券	日本	56,755,126,875	6.50
特殊債券	日本	65,083,691,915	7.45
社債券	日本	41,347,816,800	4.73
現金・預金・その他資産（負債控除後）		4,548,521,791	0.52
合計（純資産総額）		872,654,926,231	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	341,431,096,304	50.25
	カナダ	14,177,720,271	2.08
	メキシコ	5,192,713,087	0.76
	ドイツ	38,527,023,249	5.67
	イタリア	58,317,028,825	8.58
	フランス	53,401,966,522	7.86
	オランダ	9,042,045,261	1.33
	スペイン	40,536,918,359	5.96
	ベルギー	13,440,687,777	1.97
	オーストリア	8,533,258,787	1.25
	フィンランド	2,596,582,914	0.38
	アイルランド	8,572,714,041	1.26
	イギリス	34,414,501,596	5.06
	スウェーデン	1,799,504,496	0.26
	ノルウェー	1,386,793,289	0.20
	デンマーク	2,515,892,358	0.37
ポーランド	2,782,968,660	0.40	



	オーストラリア	10,522,832,641	1.54
	シンガポール	3,052,332,152	0.44
	マレーシア	3,427,345,489	0.50
	中国	15,128,507,117	2.22
	イスラエル	2,686,647,574	0.39
	小計	671,487,080,769	98.84
現金・預金・その他資産（負債控除後）		7,849,856,425	1.15
合計（純資産総額）		679,336,937,194	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	687,119,652	9.95
	ブラジル	673,938,981	9.76
	チリ	140,319,463	2.03
	コロンビア	264,434,200	3.83
	ペルー	151,469,142	2.19
	ウルグアイ	11,609,920	0.16
	セルビア	20,602,706	0.29
	トルコ	62,266,477	0.90
	チェコ	340,872,840	4.94
	ハンガリー	183,309,205	2.65
	ポーランド	448,024,976	6.49
	ロシア	0	0.00
	ルーマニア	205,298,422	2.97
	マレーシア	684,194,011	9.91
	タイ	672,854,796	9.75
	インドネシア	673,793,622	9.76
	中国	676,603,359	9.80
	エジプト	102,010,015	1.47
	南アフリカ	666,299,248	9.65
		小計	6,665,021,035
現金・預金・その他資産（負債控除後）		234,708,258	3.40
合計（純資産総額）		6,899,729,293	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	442,155,927,500	98.23
現金・預金・その他資産（負債控除後）		7,923,170,587	1.76
合計（純資産総額）		450,079,098,087	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	7,323,750,000	1.62

## (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	955,363,199,538	70.84
	カナダ	49,341,110,170	3.65
	ドイツ	28,779,653,226	2.13
	イタリア	8,244,954,811	0.61
	フランス	41,781,771,752	3.09
	オランダ	17,324,533,158	1.28
	スペイン	8,891,606,131	0.65
	ベルギー	3,035,154,378	0.22
	オーストリア	646,288,291	0.04
	ルクセンブルグ	366,036,691	0.02
	フィンランド	3,761,027,437	0.27
	アイルランド	2,161,223,871	0.16
	ポルトガル	880,149,938	0.06
	イギリス	59,395,477,593	4.40
	スイス	40,150,380,879	2.97
	スウェーデン	13,514,252,537	1.00
	ノルウェー	3,168,825,746	0.23
	デンマーク	10,811,685,480	0.80
	オーストラリア	28,735,346,495	2.13
	ニュージーランド	699,206,384	0.05
香港	10,929,768,302	0.81	
シンガポール	4,255,054,034	0.31	
イスラエル	1,947,963,076	0.14	
	小計	1,294,184,669,918	95.96
投資証券	アメリカ	29,466,943,067	2.18
	カナダ	134,489,790	0.00
	フランス	492,330,573	0.03
	ベルギー	125,537,085	0.00
	イギリス	725,596,167	0.05
	オーストラリア	1,831,656,828	0.13
	香港	520,042,880	0.03

	シンガポール	633,131,217	0.04
	小計	33,929,727,607	2.51
現金・預金・その他資産（負債控除後）		20,429,863,223	1.51
合計（純資産総額）		1,348,544,260,748	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	15,106,597,136	1.12
	買建	カナダ	764,269,949	0.05
	買建	ドイツ	1,786,966,175	0.13
	買建	イギリス	920,552,360	0.06
	買建	スイス	610,967,110	0.04
	買建	オーストラリア	463,791,345	0.03

## （参考）新興国株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	2,662,738,511	3.51
	メキシコ	1,495,408,312	1.97
	ブラジル	3,743,722,218	4.93
	チリ	154,056,999	0.20
	コロンビア	39,910,490	0.05
	ギリシャ	191,131,640	0.25
	トルコ	190,808,047	0.25
	チェコ	112,896,820	0.14
	ハンガリー	119,087,191	0.15
	ポーランド	421,244,705	0.55
	香港	17,942,577,056	23.66
	マレーシア	1,095,612,353	1.44
	タイ	1,367,928,500	1.80
	フィリピン	535,280,079	0.70
	インドネシア	1,380,966,203	1.82
	韓国	8,706,065,329	11.48
	台湾	10,688,608,286	14.10
	インド	9,868,422,687	13.01
	カタール	803,936,441	1.06
	エジプト	41,263,405	0.05
南アフリカ	2,583,900,657	3.40	
アラブ首長国連邦	964,299,582	1.27	

	クウェート	621,117,078	0.81
	サウジアラビア	3,288,156,061	4.33
	小計	69,019,138,650	91.04
投資信託受益証券	アメリカ	3,196,920,195	4.21
投資証券	メキシコ	49,813,355	0.06
	南アフリカ	33,398,700	0.04
	小計	83,212,055	0.10
現金・預金・その他資産（負債控除後）		3,506,271,540	4.62
合計（純資産総額）		75,805,542,440	100.00

## その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,653,550,759	3.50
	買建	香港	780,425,681	1.02

## （参考）J-REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	45,087,338,000	96.80
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,489,700,264	3.19
合計（純資産総額）		46,577,038,264	100.00

## その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
REIT指数先物取引	買建	日本	1,334,640,000	2.86

## （参考）海外REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	45,217,293,057	76.54
	カナダ	1,056,700,741	1.78
	ドイツ	32,322,375	0.05
	イタリア	17,075,272	0.02

	フランス	903,421,086	1.52
	オランダ	98,866,050	0.16
	スペイン	217,721,734	0.36
	ベルギー	652,221,196	1.10
	アイルランド	25,199,100	0.04
	シンガポール	25,673,985	0.04
	イギリス	3,082,785,681	5.21
	オーストラリア	3,692,184,166	6.25
	ニュージーランド	204,773,784	0.34
	香港	861,801,974	1.45
	シンガポール	2,018,513,228	3.41
	韓国	126,670,850	0.21
	イスラエル	68,165,582	0.11
	小計	58,301,389,861	98.69
現金・預金・その他資産（負債控除後）		768,719,454	1.30
合計（純資産総額）		59,070,109,315	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	727,243,974	1.23

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

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	30,260,544	1.9865	60,113,440	2.0806	62,960,087	24.38
2	日本	親投資信託受益証券	国内債券NOMURA - BPI総合マザーファンド	43,075,409	1.2897	55,558,340	1.3002	56,006,646	21.68
3	日本	親投資信託受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	7,997,110	4.3703	34,950,471	4.6028	36,809,097	14.25
4	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	11,076,059	2.5951	28,743,624	2.6412	29,254,087	11.32
5	日本	親投資信託受益証券	新興国株式マザーファンド	15,724,108	1.6072	25,273,013	1.5713	24,707,290	9.56
6	日本	親投資信託受益証券	海外REITインデックスマザーファンド	5,877,021	3.1488	18,506,006	3.4038	20,004,204	7.74
7	日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックスマザーファンド	7,079,946	2.5870	18,316,147	2.7638	19,567,554	7.57
8	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	6,212,499	1.4243	8,849,044	1.3956	8,670,163	3.35

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

## (参考) 国内債券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	100.66	12,079,200,000	0.1	2027/6/20	1.38
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	99.62	11,955,480,000	0.1	2031/12/20	1.37
3	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第360回	10,900,000,000	99.45	10,840,704,000	100.00	10,900,000,000	0.1	2030/9/20	1.24
4	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第359回	10,600,000,000	99.55	10,552,618,000	100.07	10,608,268,000	0.1	2030/6/20	1.21
5	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第363回	10,450,000,000	99.13	10,360,025,500	99.73	10,422,412,000	0.1	2031/6/20	1.19
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	100.34	10,234,986,000	0.1	2024/3/20	1.17
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	100.61	10,212,828,500	0.1	2028/3/20	1.17
8	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第364回	10,150,000,000	99.00	10,049,361,000	99.68	10,117,926,000	0.1	2031/9/20	1.15
9	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	99.82	9,683,413,000	0.1	2031/3/20	1.10
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	100.42	9,641,088,000	0.1	2024/9/20	1.10
11	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第343回	9,500,000,000	100.40	9,538,000,000	100.70	9,566,595,000	0.1	2026/6/20	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	101.30	9,117,540,000	0.4	2025/3/20	1.04
13	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	100.69	8,659,856,000	0.1	2027/3/20	0.99
14	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第361回	8,400,000,000	99.30	8,341,640,000	99.91	8,392,944,000	0.1	2030/12/20	0.96
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	100.33	7,324,163,000	0.005	2026/6/20	0.83
16	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第138回	7,100,000,000	100.25	7,118,318,000	100.31	7,122,649,000	0.1	2023/12/20	0.81
17	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第149回	7,100,000,000	99.95	7,096,805,000	100.31	7,122,081,000	0.005	2026/9/20	0.81

18	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	101.43	7,100,170,000	0.4	2025/6/20	0.81
19	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	100.70	7,049,210,000	0.1	2026/12/20	0.80
20	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	101.32	6,687,186,000	0.6	2024/6/20	0.76
21	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第137回	6,600,000,000	100.23	6,615,510,000	100.28	6,618,744,000	0.1	2023/9/20	0.75
22	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	93.96	6,549,151,400	0.4	2040/9/20	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	100.70	6,445,120,000	0.1	2026/9/20	0.73
24	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	100.51	6,101,199,800	0.1	2025/3/20	0.69
25	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第351回	6,000,000,000	100.15	6,009,240,000	100.58	6,035,280,000	0.1	2028/6/20	0.69
26	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第332回	5,900,000,000	101.11	5,966,021,000	101.01	5,959,767,000	0.6	2023/12/20	0.68
27	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第348回	5,800,000,000	100.30	5,817,400,000	100.61	5,835,786,000	0.1	2027/9/20	0.66
28	日本	国債証券	国庫債券 利付(20年)第176回	6,020,000,000	96.97	5,837,895,000	94.98	5,717,856,200	0.5	2041/3/20	0.65
29	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	100.32	5,618,312,000	0.005	2026/3/20	0.64
30	日本	国債証券	国庫債券 利付(40年)第13回	7,020,000,000	86.24	6,054,048,000	78.49	5,510,278,800	0.5	2060/3/20	0.63

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	80.77
地方債証券	6.50
特殊債券	7.45
社債券	4.73
合計	99.47

## (参考)外国債券マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	151,500,000	15,834.92	23,989,916,428	16,203.67	24,548,573,307	5.375	2031/2/15	3.61
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	129,400,000	15,190.94	19,657,087,348	15,406.53	19,936,055,621	5.25	2028/11/15	2.93
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	81,000,000	12,693.30	10,281,574,354	12,849.47	10,408,071,355	1.625	2026/11/30	1.53

4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	66,600,000	14,941.71	9,951,178,860	14,897.54	9,921,761,920	6	2026/2/15	1.46
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	72,000,000	13,425.76	9,666,554,307	13,368.45	9,625,288,050	2.5	2024/5/15	1.41
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	67,500,000	13,069.78	8,822,108,039	13,238.57	8,936,039,587	2.375	2027/5/15	1.31
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,100,000	16,507.60	7,940,156,828	16,810.47	8,085,838,501	6.25	2030/5/15	1.19
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	57,850,000	13,278.01	7,681,331,017	13,281.16	7,683,156,334	2.25	2024/11/15	1.13
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	65,650,000	11,285.60	7,409,001,032	11,635.35	7,638,608,506	2.375	2051/5/15	1.12
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	56,700,000	13,352.66	7,570,962,750	13,322.18	7,553,678,009	2.375	2024/8/15	1.11
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	53,600,000	13,320.60	7,139,844,713	13,546.18	7,260,753,849	2.875	2028/5/15	1.06
12	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	36,200,000	18,447.29	6,677,921,973	18,789.93	6,801,957,104	4.75	2035/4/25	1.00
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,100,000	13,165.48	6,595,909,476	13,230.69	6,628,575,874	2.25	2025/11/15	0.97
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,800,000	13,458.65	6,567,823,522	13,466.25	6,571,533,839	2.875	2025/4/30	0.96
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,100,000	13,336.22	6,414,723,636	13,286.42	6,390,771,380	2.125	2024/3/31	0.94
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,900,000	13,393.69	6,147,706,005	13,332.69	6,119,708,919	2.25	2023/12/31	0.90
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,700,000	12,493.30	5,959,307,637	12,758.50	6,085,806,438	3	2044/11/15	0.89
18	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,000,000	17,627.28	5,993,276,194	17,807.88	6,054,681,087	5.5	2029/4/25	0.89
19	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	36,800,000	16,159.69	5,946,767,724	16,054.13	5,907,920,759	5.25	2029/11/1	0.86
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,700,000	11,375.59	5,653,671,363	11,684.77	5,807,334,653	2.5	2046/2/15	0.85
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,600,000	13,266.97	5,784,399,705	13,254.87	5,779,126,999	2.125	2024/9/30	0.85
22	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	32,300,000	17,502.60	5,653,342,213	17,746.69	5,732,183,938	6	2029/1/31	0.84
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	13,511.47	5,755,889,947	13,434.70	5,723,185,597	2.75	2023/11/15	0.84
24	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,650,000	16,350.33	5,665,389,943	16,401.58	5,683,147,775	5.9	2026/7/30	0.83
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,750,000	13,494.11	5,633,794,432	13,531.98	5,649,603,836	3	2025/9/30	0.83
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,300,000	13,177.05	5,573,894,840	13,272.22	5,614,153,149	2.375	2026/4/30	0.82
27	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	33,800,000	16,723.49	5,652,542,430	16,588.03	5,606,755,830	6.5	2027/11/1	0.82
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,350,000	12,666.31	5,364,185,364	12,803.72	5,422,376,944	1.5	2026/8/15	0.79
29	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	28,950,000	18,280.37	5,292,169,634	18,661.88	5,402,614,984	5.75	2032/7/30	0.79
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,500,000	14,113.04	5,433,522,536	13,944.75	5,368,730,554	6.25	2023/8/15	0.79

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------



国債証券	98.84
合計	98.84

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （%）	償還期限	投資 比率 （%）
1	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	9,300,000	2,003.66	186,340,722	2,006.53	186,607,560	2.47	2024/9/2	2.70
2	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,800,000	2,011.32	156,883,554	2,007.57	156,591,157	2.69	2026/8/12	2.26
3	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,200,000	2,014.51	145,045,295	2,017.21	145,239,828	2.91	2028/10/14	2.10
4	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	6,400,000	2,214.96	141,757,889	2,212.51	141,600,985		2023/7/1	2.05
5	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	6,300,000	2,130.47	134,220,206	2,112.50	133,087,643		2024/1/1	1.92
6	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000	2,025.03	121,502,174	2,024.24	121,454,917	3.02	2031/5/27	1.76
7	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	481,000	2,548.88	122,604,300	2,466.71	118,649,160	10	2025/1/1	1.71
8	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,500,000	2,459.47	110,676,545	2,365.19	106,433,622	2.75	2029/10/25	1.54
9	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,900,000	759.25	105,536,431	714.88	99,368,629	8	2030/1/31	1.44
10	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000	2,904.42	101,654,925	2,795.71	97,849,995	4	2023/10/25	1.41
11	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,100,000	700.66	98,794,250	673.80	95,006,405	10	2024/12/5	1.37
12	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,900,000	704.93	97,985,351	640.65	89,051,492	8.75	2048/2/28	1.29
13	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,500,000	616.60	89,407,523	599.34	86,905,574	5.75	2026/3/5	1.25
14	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,300,000	662.01	88,047,899	623.61	82,940,167	7.75	2031/5/29	1.20
15	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,100,000	2,690.83	83,415,981	2,627.38	81,448,834	2.25	2024/10/25	1.18
16	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000	3,048.70	76,217,632	3,001.11	75,027,889	3.733	2028/6/15	1.08
17	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,100,000	1,813.63	74,359,014	1,805.66	74,032,411		2025/7/1	1.07
18	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,500,000	909.86	77,338,610	860.71	73,160,531	10.5	2026/12/21	1.06
19	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000	3,102.56	74,461,503	3,043.39	73,041,554	3.9	2026/11/30	1.05
20	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	14,000,000	528.19	73,947,502	517.53	72,454,345	0.45	2023/10/25	1.05
21	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,800,000	692.17	74,754,737	654.98	70,738,710	8.5	2029/5/31	1.02
22	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	3,500,000	1,998.85	69,959,927	1,964.34	68,751,923		2024/7/1	0.99
23	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000	754.62	74,708,097	691.52	68,461,448	8.875	2035/2/28	0.99
24	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000	3,117.40	68,583,006	3,054.16	67,191,602	3.955	2025/9/15	0.97
25	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,600,000	646.52	68,532,155	603.11	63,930,688	8	2047/11/7	0.92
26	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,000,000	715.26	64,374,193	690.45	62,141,122	8.25	2032/3/31	0.90

27	メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,500,000	666.43	63,311,160	650.71	61,818,155	8	2023/12/7	0.89
28	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,000,000	2,897.63	57,952,617	2,927.92	58,558,571	3.582	2032/7/15	0.84
29	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,900,000	669.54	59,589,902	653.95	58,202,084	8.5	2037/1/31	0.84
30	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	13,200,000	476.13	62,849,229	434.47	57,350,896	0.95	2030/5/15	0.83

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.59
合計	96.59

## (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	8,123,900	2,175.21	17,671,231,913	2,137.00	17,360,774,300	3.85
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,116,400	10,591.42	11,824,266,857	11,695.00	13,056,298,000	2.90
3	日本	株式	キーエンス	電気機器	161,500	50,321.76	8,126,964,795	52,430.00	8,467,445,000	1.88
4	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,288,000	749.25	7,708,290,915	745.40	7,668,675,200	1.70
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,960,000	3,860.86	7,567,290,639	3,807.00	7,461,720,000	1.65
6	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,219,800	4,369.36	5,329,753,060	4,953.00	6,041,669,400	1.34
7	日本	株式	任天堂	その他製品	100,600	56,577.77	5,691,724,590	59,710.00	6,006,826,000	1.33
8	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,048,600	4,937.22	5,177,179,132	5,605.00	5,877,403,000	1.30
9	日本	株式	日立製作所	電気機器	857,100	6,460.52	5,537,317,847	6,704.00	5,745,998,400	1.27
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,400,700	3,775.52	5,288,384,429	3,925.00	5,497,747,500	1.22
11	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,274,800	4,349.48	5,544,722,189	4,292.00	5,471,441,600	1.21
12	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	113,100	53,218.12	6,018,969,539	46,010.00	5,203,731,000	1.15
13	日本	株式	信越化学工業	化学	276,600	17,787.95	4,920,148,135	16,960.00	4,691,136,000	1.04
14	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,140,600	3,927.12	4,479,279,312	4,107.00	4,684,444,200	1.04
15	日本	株式	HOYA	精密機器	344,000	12,507.49	4,302,578,777	13,270.00	4,564,880,000	1.01
16	日本	株式	第一三共	医薬品	1,292,700	3,294.98	4,259,429,809	3,523.00	4,554,182,100	1.01
17	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,150,800	4,126.26	4,748,509,290	3,948.00	4,543,358,400	1.00
18	日本	株式	ダイキン工業	機械	194,600	19,725.10	3,838,506,288	23,250.00	4,524,450,000	1.00
19	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,302,900	3,348.00	4,362,117,685	3,388.00	4,414,225,200	0.98
20	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,648,600	1,511.46	4,003,273,862	1,538.50	4,074,871,100	0.90
21	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,052,200	3,693.46	3,886,265,789	3,866.00	4,067,805,200	0.90
22	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	489,100	6,954.43	3,401,412,045	7,764.00	3,797,372,400	0.84
23	日本	株式	村田製作所	電気機器	486,100	8,232.10	4,001,626,548	7,747.00	3,765,816,700	0.83
24	日本	株式	三井物産	卸売業	1,272,100	3,142.02	3,996,965,806	2,925.50	3,721,528,550	0.82

25	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	181,100	17,269.76	3,127,553,618	20,150.00	3,649,165,000	0.81
26	日本	株式	日本電産	電気機器	395,900	8,330.38	3,297,997,801	9,198.00	3,641,488,200	0.80
27	日本	株式	ファナック	電気機器	156,400	19,632.39	3,070,506,466	22,825.00	3,569,830,000	0.79
28	日本	株式	S M C	機械	52,200	61,703.98	3,220,947,846	65,410.00	3,414,402,000	0.75
29	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,107,300	1,582.60	3,335,032,301	1,583.50	3,336,909,550	0.74
30	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	588,500	5,690.49	3,348,854,410	5,429.00	3,194,966,500	0.70

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.29
		建設業	2.16
		食料品	3.31
		繊維製品	0.44
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.11
		医薬品	5.24
		石油・石炭製品	0.52
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.69
		鉄鋼	0.75
		非鉄金属	0.69
		金属製品	0.60
		機械	5.21
		電気機器	17.37
		輸送用機器	7.71
		精密機器	2.73
		その他製品	2.45
		電気・ガス業	1.27
		陸運業	2.98
		海運業	0.67
		空運業	0.40
		倉庫・運輸関連業	0.15
		情報・通信業	9.07
		卸売業	5.32
小売業	4.29		
銀行業	5.22		
証券、商品先物取引業	0.71		
保険業	2.18		
その他金融業	1.15		
不動産業	1.96		

		サービス業	5.45
合 計			98.23

## (参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	3,277,200	23,643.63	77,484,922,473	21,180.88	69,413,991,406	5.14
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,430,200	41,806.46	59,791,609,306	37,207.55	53,214,238,153	3.94
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	1,839,300	21,904.80	40,289,501,446	16,460.11	30,275,081,794	2.24
4	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	176,410	143,086.02	25,241,805,573	113,435.84	20,011,217,769	1.48
5	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	1,208,000	18,857.37	22,779,712,039	15,375.15	18,573,186,274	1.37
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	1,141,000	18,951.53	21,623,705,318	15,424.95	17,599,879,246	1.30
7	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケ ア・プロ バイダー/ ヘルスケ ア・サー ビス	188,950	69,865.51	13,201,089,014	72,889.96	13,772,559,624	1.02
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	528,000	24,155.43	12,754,071,659	23,449.06	12,381,104,736	0.91
9	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	502,040	36,383.24	18,265,843,303	24,208.26	12,153,516,055	0.90
10	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	850,200	11,335.22	9,637,210,521	12,470.27	10,602,223,894	0.78
11	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	259,300	47,593.04	12,340,876,406	39,561.87	10,258,395,225	0.76
12	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	463,700	30,273.21	14,037,690,473	21,634.51	10,031,926,553	0.74
13	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	481,400	20,711.19	9,970,370,906	19,930.35	9,594,473,667	0.71
14	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	333,000	29,964.88	9,978,307,505	28,449.82	9,473,791,225	0.70
15	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	565,300	16,971.06	9,593,740,523	16,505.19	9,330,383,907	0.69
16	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	593,000	18,737.58	11,111,388,421	15,454.57	9,164,562,441	0.67
17	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売 り	209,700	41,369.95	8,675,279,405	40,333.19	8,457,870,845	0.62
18	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術 サービス	175,300	48,518.14	8,505,230,206	47,443.29	8,316,809,526	0.61
19	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	391,100	22,230.39	8,694,307,240	20,243.99	7,917,427,579	0.58
20	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	1,129,300	7,043.57	7,954,311,403	6,827.41	7,710,204,503	0.57

21	アメリカ	株式	ELI LILLY & CO.	医薬品	162,600	39,188.24	6,372,009,383	44,528.98	7,240,413,449	0.53
22	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	355,200	21,925.28	7,787,860,481	20,157.84	7,160,067,432	0.53
23	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	827,100	8,381.64	6,932,462,248	8,623.11	7,132,179,740	0.52
24	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,458,000	5,713.33	8,330,042,595	4,485.20	6,539,429,182	0.48
25	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	277,800	22,610.62	6,281,231,260	23,535.21	6,538,082,005	0.48
26	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	141,100	51,918.83	7,325,747,663	45,741.94	6,454,188,792	0.47
27	アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORPORATION	食品・生活必需品小売り	89,050	76,732.20	6,833,002,565	72,175.18	6,427,200,652	0.47
28	アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	ライフサイエンス・ツール/サービス	78,560	79,602.73	6,253,590,738	80,448.32	6,320,020,051	0.46
29	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	507,600	11,167.74	5,668,744,856	12,106.82	6,145,423,558	0.45
30	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	81,660	84,258.30	6,880,533,240	74,856.15	6,112,753,209	0.45

## 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	3.65
		メディア	0.80
		娯楽	1.12
		不動産管理・開発	0.35
		エネルギー設備・サービス	0.21
		石油・ガス・消耗燃料	4.79
		化学	1.99
		建設資材	0.23
		容器・包装	0.27
		金属・鉱業	1.40
		紙製品・林産品	0.10
		航空宇宙・防衛	1.54
		建設関連製品	0.50
		建設・土木	0.24
		電気設備	0.78
		コングロマリット	0.87
		機械	1.60
		商社・流通業	0.34
		商業サービス・用品	0.49
		航空貨物・物流サービス	0.59
旅客航空輸送業	0.04		
海運業	0.09		
陸運・鉄道	1.07		
運送インフラ	0.13		
自動車部品	0.19		

自動車	2.09
家庭用耐久財	0.28
レジャー用品	0.03
繊維・アパレル・贅沢品	1.30
ホテル・レストラン・レジャー	1.73
販売	0.10
インターネット販売・通信販売	2.58
複合小売り	0.48
専門小売り	1.58
食品・生活必需品小売り	1.54
飲料	1.86
食品	1.70
タバコ	0.71
家庭用品	1.19
パーソナル用品	0.60
ヘルスケア機器・用品	2.31
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.44
バイオテクノロジー	1.91
医薬品	5.45
銀行	5.59
各種金融サービス	1.00
保険	2.97
情報技術サービス	3.79
ソフトウェア	7.27
通信機器	0.65
コンピュータ・周辺機器	5.39
電子装置・機器・部品	0.55
半導体・半導体製造装置	4.57
各種電気通信サービス	1.20
無線通信サービス	0.30
電力	1.91
ガス	0.14
総合公益事業	0.88
水道	0.11
消費者金融	0.40
資本市場	3.17
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	0.07
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.57
専門サービス	0.71
投資証券	2.51

合 計	98.48
-----	-------

## (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	2,055,000	2,332.81	4,793,942,338	2,251.29	4,626,408,348	6.10
2	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF		4,460,000	632.66	2,821,694,820	716.79	3,196,920,195	4.21
3	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	520,700	5,982.27	3,114,971,520	5,501.72	2,864,745,604	3.77
4	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュ ータ・周辺機 器	398,240	6,838.55	2,723,387,366	6,431.40	2,561,244,718	3.37
5	香港	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	インター ネット販 売・通信販 売	1,266,180	1,559.56	1,974,690,784	1,700.42	2,153,040,961	2.84
6	香港	株式	MEITUAN-CLASS B	インター ネット販 売・通信販 売	341,500	2,724.15	930,298,219	3,224.20	1,101,064,300	1.45
7	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガ ス・消耗燃 料	253,900	4,295.41	1,090,604,806	4,177.07	1,060,558,073	1.39
8	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術 サービス	280,600	2,660.47	746,529,040	2,579.58	723,830,148	0.95
9	香港	株式	JD.COM, INC.	インター ネット販 売・通信販 売	167,267	3,899.15	652,200,751	4,201.74	702,814,117	0.92
10	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	8,021,000	94.17	755,340,952	85.92	689,176,352	0.90
11	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	333,652	1,977.69	659,863,206	1,834.27	612,008,251	0.80
12	インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	428,800	1,209.57	518,664,295	1,384.82	593,810,816	0.78
13	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵 当・不動産 金融	143,600	3,688.80	529,712,642	3,973.83	570,642,706	0.75

14	サウジア ラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	162,000	4,008.30	649,344,992	3,216.64	521,095,680	0.68
15	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・ 機器・部品	1,040,649	468.05	487,081,368	487.55	507,374,248	0.66
16	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	45,530	11,106.69	505,687,624	10,327.66	470,218,360	0.62
17	サウジア ラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	181,800	2,820.02	512,680,511	2,516.59	457,516,062	0.60
18	香港	株式	NETEASE, INC.	娯楽	172,950	2,427.26	419,795,048	2,589.64	447,879,967	0.59
19	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	186,360	1,823.01	339,736,687	2,376.98	442,975,856	0.58
20	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	528,000	834.39	440,563,089	820.62	433,291,320	0.57
21	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術 サービス	77,200	5,829.33	450,024,457	5,542.85	427,908,020	0.56
22	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュ ータ・周辺機 器	68,700	6,114.20	420,045,804	5,922.30	406,862,010	0.53
23	香港	株式	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	ライフサイ エンス・ ツール/ サービス	299,000	881.09	263,447,590	1,319.69	394,588,057	0.52
24	台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半 導体製造装 置	126,538	3,574.59	452,322,201	3,064.63	387,792,809	0.51
25	南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インター ネット販 売・通信販 売	18,160	12,024.32	218,361,706	20,040.93	363,943,316	0.48
26	香港	株式	BYD CO LTD-H	自動車	68,500	3,976.60	272,397,573	4,959.78	339,744,930	0.44
27	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,710,000	78.34	368,983,109	71.00	334,414,710	0.44
28	ブラジル	株式	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	石油・ガ ス・消耗燃 料	397,000	831.61	330,151,362	837.86	332,632,067	0.43
29	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	6,630,000	51.98	344,692,521	48.02	318,372,600	0.41
30	インドネ シア	株式	BANK CENTRAL ASIA	銀行	4,730,000	69.03	326,520,346	66.88	316,366,050	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	5.44
		メディア	0.17
		娯楽	1.03
		不動産管理・開発	1.65
		エネルギー設備・サービス	0.04
		石油・ガス・消耗燃料	4.63
		化学	2.91
		建設資材	0.90
		容器・包装	0.06
		金属・鉱業	3.37
		紙製品・林産品	0.17
		航空宇宙・防衛	0.13
		建設関連製品	0.02
		建設・土木	0.46
		電気設備	0.57
		コングロマリット	1.04
		機械	0.30
		商社・流通業	0.15
		商業サービス・用品	0.06
		航空貨物・物流サービス	0.27
		旅客航空輸送業	0.20
		海運業	0.47
		陸運・鉄道	0.24
		運送インフラ	0.67
		自動車部品	0.44
		自動車	3.03
		家庭用耐久財	0.29
		レジャー用品	0.07
		繊維・アパレル・贅沢品	1.06
		ホテル・レストラン・レジャー	1.00
		インターネット販売・通信販売	6.41
		複合小売り	0.24
専門小売り	0.60		
食品・生活必需品小売り	1.20		

	飲料	1.02
	食品	1.70
	タバコ	0.37
	家庭用品	0.06
	パーソナル用品	0.77
	ヘルスケア機器・用品	0.12
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.69
	バイオテクノロジー	0.61
	医薬品	1.05
	銀行	14.42
	各種金融サービス	0.78
	保険	2.40
	情報技術サービス	2.21
	ソフトウェア	0.20
	通信機器	0.11
	コンピュータ・周辺機器	5.06
	電子装置・機器・部品	2.44
	半導体・半導体製造装置	8.45
	各種電気通信サービス	1.45
	無線通信サービス	1.62
	電力	1.14
	ガス	0.64
	総合公益事業	0.03
	水道	0.11
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.75
	消費者金融	0.66
	資本市場	0.69
	各種消費者サービス	0.09
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.79
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.96
	その他の業種	0.00
投資信託受益証券		4.21
投資証券		0.10
合 計		95.37

(参考) J - R E I Tインデックス マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,683	716,804	3,356,797,758	706,000	3,306,198,000	7.09
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,014	646,236	2,593,991,999	643,000	2,581,002,000	5.54
3	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	6,577	350,941	2,308,142,319	346,000	2,275,642,000	4.88
4	日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	20,253	105,859	2,143,981,525	108,400	2,195,425,200	4.71
5	日本	投資証券	G L P 投資法人 投資証券	12,362	167,383	2,069,193,005	175,100	2,164,586,200	4.64
6	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,981	169,649	2,202,214,985	166,700	2,163,932,700	4.64
7	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	6,051	318,287	1,925,957,932	320,500	1,939,345,500	4.16
8	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	7,998	186,665	1,492,951,788	191,100	1,528,417,800	3.28
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	4,013	358,637	1,439,213,153	367,000	1,472,771,000	3.16
10	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,036	146,132	1,320,452,811	145,000	1,310,220,000	2.81
11	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,745	413,837	1,135,985,249	406,500	1,115,842,500	2.39
12	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	5,999	185,107	1,110,459,955	185,100	1,110,414,900	2.38
13	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	12,199	79,333	967,787,024	83,400	1,017,396,600	2.18
14	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,386	672,260	931,752,502	696,000	964,656,000	2.07
15	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	12,945	65,708	850,595,328	69,000	893,205,000	1.91
16	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,119	419,017	887,897,662	417,500	884,682,500	1.89
17	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,707	325,197	880,308,805	320,000	866,240,000	1.85
18	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,914	177,925	874,323,711	175,600	862,898,400	1.85
19	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,180	663,386	782,796,548	715,000	843,700,000	1.81
20	日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,586	550,580	873,221,105	523,000	829,478,000	1.78
21	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,489	531,566	791,502,893	543,000	808,527,000	1.73
22	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	17,668	41,336	730,330,129	41,850	739,405,800	1.58
23	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,720	151,754	716,280,279	153,000	722,160,000	1.55
24	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,443	153,211	680,720,884	156,100	693,552,300	1.48
25	日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	5,431	116,761	634,129,191	125,800	683,219,800	1.46
26	日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	2,879	214,403	617,268,354	223,700	644,032,300	1.38
27	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,867	335,104	625,639,358	336,500	628,245,500	1.34
28	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,756	161,163	605,331,743	166,700	626,125,200	1.34
29	日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,239	463,814	574,665,599	477,500	591,622,500	1.27
30	日本	投資証券	N T T 都市開発リート投資法人	3,859	150,001	578,855,512	152,500	588,497,500	1.26

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.80
合 計	96.80

## (参考) 海外REITインデックス マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	222,140	16,426.35	3,648,949,971	17,822.36	3,959,059,939	6.70
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	27,320	88,509.39	2,418,076,723	95,749.43	2,615,874,676	4.42
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	45,840	41,701.70	1,911,606,221	45,377.03	2,080,083,101	3.52
4	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	180,600	8,918.41	1,610,666,129	9,899.21	1,787,799,024	3.02
5	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	136,300	11,161.58	1,521,323,721	11,573.76	1,577,504,551	2.67
6	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	85,480	17,896.83	1,529,821,422	18,432.14	1,575,579,951	2.66
7	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	98,600	13,947.86	1,375,259,891	14,465.19	1,426,267,793	2.41
8	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	289,200	4,100.46	1,185,853,391	4,549.81	1,315,807,366	2.22
9	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	41,880	26,220.97	1,098,134,367	28,569.62	1,196,495,954	2.02
10	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	102,800	9,715.78	998,782,778	10,465.92	1,075,897,347	1.82
11	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	40,350	22,788.36	919,510,397	25,325.52	1,021,884,950	1.72
12	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	44,630	20,164.36	899,935,465	21,968.35	980,447,550	1.65
13	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	115,500	6,991.95	807,570,754	8,406.39	970,938,565	1.64
14	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	183,400	4,917.37	901,845,675	5,198.63	953,430,246	1.61
15	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	510,900	1,796.40	917,785,802	1,864.21	952,428,976	1.61
16	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	120,100	7,162.03	860,160,997	7,177.40	862,006,365	1.45
17	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	34,690	22,737.58	788,766,652	24,766.89	859,163,549	1.45
18	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	36,560	21,225.79	776,014,912	21,992.58	804,048,791	1.36
19	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,590	36,409.66	713,265,330	38,336.92	751,020,420	1.27
20	香港	投資証券	LINK REIT	633,000	1,192.92	755,121,646	1,117.32	707,265,142	1.19
21	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	57,800	11,006.21	636,159,187	11,418.96	660,016,252	1.11
22	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	360,600	1,698.48	612,475,424	1,737.73	626,627,349	1.06
23	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	32,040	18,106.66	580,137,426	19,024.43	609,542,779	1.03
24	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	162,300	3,492.22	566,787,385	3,700.42	600,579,610	1.01
25	アメリカ	投資証券	UDR INC	89,500	6,081.87	544,327,976	6,496.27	581,416,935	0.98
26	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	86,900	7,009.75	609,147,806	6,461.28	561,485,232	0.95
27	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	184,800	2,863.47	529,169,409	2,942.57	543,787,786	0.92
28	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	42,800	13,201.31	565,016,187	12,125.66	518,978,625	0.87
29	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	213,800	2,660.36	568,785,401	2,410.86	515,442,958	0.87
30	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	51,700	9,594.10	496,015,370	9,823.83	507,892,414	0.85

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.69
合 計	98.69

## 【投資不動産物件】

野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

該当事項はありません。

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）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）J - REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

該当事項はありません。

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）国内株式マザーファンド

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （%）
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2022年09月限)	買建	378	日本円	7,194,688,910	7,323,750,000	1.62

## （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 指指数先物(2022 年09月限)	買建	551	米ドル	106,850,175	14,383,102,054	112,224,925	15,106,597,136	1.12
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2022年09 月限)	買建	31	カナダド ル	7,130,080	749,228,804	7,273,220	764,269,949	0.05
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	ユーロ50株価指 数先物(2022年09 月限)	買建	357	ユーロ	12,522,480	1,718,710,378	13,019,790	1,786,966,175	0.13
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SP1200株価指 数先物(2022年09 月限)	買建	29	豪ドル	4,787,600	450,991,920	4,923,475	463,791,345	0.03
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FT100株価指 数先物(2022年09 月限)	買建	77	英ポンド	5,542,120	908,131,782	5,617,920	920,552,360	0.06
	スイス	ユーレック ス・チュー リッヒ取引 所	SMI株価指 数先物 (2022年09月限)	買建	39	スイスフ ラン	4,247,950	599,258,307	4,330,950	610,967,110	0.04

## （参考）新興国株式マザーファンド

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資 比率 （%）
株価指 数先物 取引	アメリカ	インターコ ンチネン タル取引 所	MSCIエマージ ング・マーケ ット指 数先物(2022年09 月限)	買建	393	米ドル	19,587,630	2,636,690,876	19,712,880	2,653,550,759	3.50

香港	香港先物取引所	MSCI China A 50 Connect 指数先物(2022年08月限)	買建	98	米ドル	5,942,365	799,901,748	5,797,680	780,425,681	1.02
----	---------	-----------------------------------------	----	----	-----	-----------	-------------	-----------	-------------	------

## (参考) J - R E I Tインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建 / 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
REIT指数先物取引	大阪取引所	REIT指数先物(2022年09月限)	買建	664	日本円	1,314,357,950	1,334,640,000	2.86

## (参考) 海外 R E I Tインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国 / 地域	取引所	名称	買建 / 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴボード オブトレード	ダウ・ジョーンズ米国内不動産指数先物(2022年09月限)	買建	140	米ドル	4,964,370	668,253,843	5,402,600	727,243,974	1.23

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040

2022年7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	(2018年 6月22日)	3	3	1.0433	1.0438
第2計算期間	(2019年 6月24日)	11	11	1.0457	1.0462
第3計算期間	(2020年 6月22日)	50	50	1.0454	1.0459
第4計算期間	(2021年 6月22日)	138	138	1.2825	1.2830
第5計算期間	(2022年 6月22日)	238	238	1.2726	1.2731
	2021年 7月末日	149		1.2774	
	8月末日	159		1.2928	
	9月末日	166		1.2931	
	10月末日	174		1.3191	

11月末日	179	1.2925
12月末日	193	1.3239
2022年 1月末日	195	1.2756
2月末日	199	1.2635
3月末日	219	1.3239
4月末日	224	1.3012
5月末日	233	1.2980
6月末日	244	1.2868
7月末日	258	1.3120

## 【分配の推移】

## 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 8月31日～2018年 6月22日	0.0005円
第2計算期間	2018年 6月23日～2019年 6月24日	0.0005円
第3計算期間	2019年 6月25日～2020年 6月22日	0.0005円
第4計算期間	2020年 6月23日～2021年 6月22日	0.0005円
第5計算期間	2021年 6月23日～2022年 6月22日	0.0005円

## 【収益率の推移】

## 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 8月31日～2018年 6月22日	4.4%
第2計算期間	2018年 6月23日～2019年 6月24日	0.3%
第3計算期間	2019年 6月25日～2020年 6月22日	0.0%
第4計算期間	2020年 6月23日～2021年 6月22日	22.7%
第5計算期間	2021年 6月23日～2022年 6月22日	0.7%

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】

## 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 8月31日～2018年 6月22日	3,834,123	59,096	3,775,027



第2計算期間	2018年 6月23日 ~ 2019年 6月24日	7,911,071	907,263	10,778,835
第3計算期間	2019年 6月25日 ~ 2020年 6月22日	39,475,833	2,269,171	47,985,497
第4計算期間	2020年 6月23日 ~ 2021年 6月22日	68,208,980	7,858,734	108,335,743
第5計算期間	2021年 6月23日 ~ 2022年 6月22日	89,521,406	10,483,937	187,373,212

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### 参考情報



## 運用実績（2022年7月29日現在）

### ■ 基準価額・純資産の推移（日次：設定来）



### ■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2022年6月	5 円
2021年6月	5 円
2020年6月	5 円
2019年6月	5 円
2018年6月	5 円
設定来累計	25 円

### ■ 主要な資産の状況

銘柄別投資比率

順位	銘柄	投資比率(%)
1	国内株式マザーファンド	24.4
2	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	21.7
3	外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	14.3
4	外国債券マザーファンド	11.3
5	新興国株式マザーファンド	9.6
6	海外REITインデックス マザーファンド	7.7
7	J-REITインデックス マザーファンド	7.6
8	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	3.4

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	国庫債券 利付（10年）第347回	国債証券	0.3
2	国庫債券 利付（10年）第365回	国債証券	0.3
3	国庫債券 利付（10年）第360回	国債証券	0.3
4	国庫債券 利付（10年）第359回	国債証券	0.3
5	国庫債券 利付（10年）第363回	国債証券	0.3

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

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



## 運用実績（2022年7月29日現在）

### ・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.9
2	ソニーグループ	電気機器	0.7
3	キーエンス	電気機器	0.5
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.4
5	日本電信電話	情報・通信業	0.4

### ・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.7
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.6
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.3
4	TESLA INC	自動車	0.2
5	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	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(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.6
2	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	—	0.4
3	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.4
4	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.3
5	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	インターネット販売・通信販売	0.3

### ・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.5
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	投資証券	0.4
3	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	投資証券	0.4
4	日本都市ファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.4
5	G L P 投資法人 投資証券	投資証券	0.4

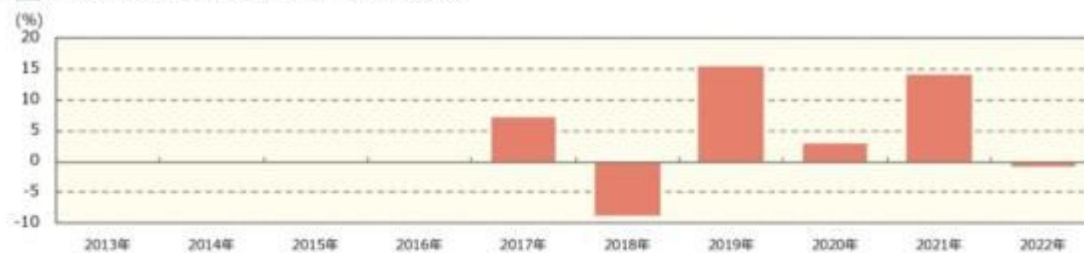
### ・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	0.5
2	EQUINIX INC	投資証券	0.3
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.3
4	REALTY INCOME CORP	投資証券	0.2
5	WELLTOWER INC	投資証券	0.2



## 運用実績（2022年7月29日現在）

### ■ 年間収益率の推移（暦年ベース）



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドは合成指数をベンチマークとしていますが、年1回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。
- ・2017年は設定日（2017年8月31日）から年末までの収益率。
- ・2022年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・ 販売の単位は、1円以上1円単位(当初元本1口 = 1円)とします。

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

- ・ 受益者は、委託者に1口単位で一部解約の実行を請求することができます。
- ・ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとしま  
す。
- ・ 一部解約の実行の請求の受付については、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解  
約請求のお申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込み分としま  
す。
- ・ 換金価額は、換金申込日の翌営業日の基準価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・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5営業日目から販売会社において支払います。
- ・金融商品取引所等における取引の停止、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従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
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
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。
REIT (不動産投資信託)	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。
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ないます。

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

2 残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法(アキュムレーションまたはアモチゼーション)によ

る評価を適用することができます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

## （２）【保管】

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

## （３）【信託期間】

2065年6月22日までとします(2017年8月31日設定)。

なお、委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、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6月23日から翌年6月22日までとします。

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

## （５）【その他】

### （a）ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託終了前に、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が30億口を下回った場合、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。）を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

（ ）上記（ ）の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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行使しないとき

は、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- ( ) 上記( )の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- ( ) 上記( )から( )までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記( )から( )までに規定するこの信託契約の解約の手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

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

#### (d) 信託約款の変更等

- ( ) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
- ( ) 委託者は、上記( )の事項（上記( )の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- ( ) 上記( )の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ( ) 上記( )の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- ( ) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ( ) 上記( )から( )までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ( ) 上記( )から( )の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、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

(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）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】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2021年6月23日から2022年6月22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】

## 【野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 (2021年 6月22日現在)	第5期 (2022年 6月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	539,930	827,474
親投資信託受益証券	138,802,040	238,212,727
流動資産合計	139,341,970	239,040,201
資産合計	139,341,970	239,040,201
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	54,167	93,686
未払解約金	79,301	9,509
未払受託者報酬	25,164	46,295
未払委託者報酬	239,024	439,695
その他未払費用	1,825	3,413
流動負債合計	399,481	592,598
負債合計	399,481	592,598
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	108,335,743	187,373,212
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	30,606,746	51,074,391
（分配準備積立金）	17,974,807	19,914,931
元本等合計	138,942,489	238,447,603
純資産合計	138,942,489	238,447,603
負債純資産合計	139,341,970	239,040,201

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2020年 6月23日	自	2021年 6月23日
	至	2021年 6月22日	至	2022年 6月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		19,258,015		1,709,413
営業収益合計		19,258,015		1,709,413
営業費用				
支払利息		3		4
受託者報酬		40,261		82,368
委託者報酬		382,422		782,299
その他費用		2,889		6,053
営業費用合計		425,575		870,724
営業利益又は営業損失（ ）		18,832,440		2,580,137
経常利益又は経常損失（ ）		18,832,440		2,580,137
当期純利益又は当期純損失（ ）		18,832,440		2,580,137
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（ ）		780,444		146,575
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,178,718		30,606,746
剰余金増加額又は欠損金減少額		11,013,515		26,281,178
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		11,013,515		26,281,178
剰余金減少額又は欠損金増加額		583,316		2,993,135
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		583,316		2,993,135
分配金		54,167		93,686
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		30,606,746		51,074,391

## (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6月23日から2022年6月22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4期 2021年6月22日現在	第5期 2022年6月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 108,335,743口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 187,373,212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 1.2825円 (10,000口当たり純資産額) (12,825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 1.2726円 (10,000口当たり純資産額) (12,726円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2020年6月23日 至 2021年6月22日	第5期 自 2021年6月23日 至 2022年6月22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>1,967,172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>15,473,565円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>12,631,939円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>588,237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>30,660,913円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>108,335,743口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>2,830円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>54,167円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,967,172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	15,473,565円	収益調整金額	C	12,631,939円	分配準備積立金額	D	588,237円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	30,660,913円	当ファンドの期末残存口数	F	108,335,743口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,830円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	54,167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>3,355,240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>31,159,460円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>16,653,377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>51,168,077円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>187,373,212口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>2,730円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>93,686円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	3,355,240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	31,159,460円	分配準備積立金額	D	16,653,377円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	51,168,077円	当ファンドの期末残存口数	F	187,373,212口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,730円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	93,686円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,967,172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	15,473,565円																																																											
収益調整金額	C	12,631,939円																																																											
分配準備積立金額	D	588,237円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	30,660,913円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	108,335,743口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,830円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	54,167円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	3,355,240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	31,159,460円																																																											
分配準備積立金額	D	16,653,377円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	51,168,077円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	187,373,212口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,730円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	93,686円																																																											

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日	第5期 自 2021年 6月23日 至 2022年 6月22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、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第4期 2021年 6月22日現在	第5期 2022年 6月22日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

第4期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日	第5期 自 2021年 6月23日 至 2022年 6月22日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般 の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていない ため、該当事項はございません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

第4期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日	第5期 自 2021年 6月23日 至 2022年 6月22日
期首元本額 47,985,497円	期首元本額 108,335,743円
期中追加設定元本額 68,208,980円	期中追加設定元本額 89,521,406円
期中一部解約元本額 7,858,734円	期中一部解約元本額 10,483,937円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第4期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日	第5期 自 2021年 6月23日 至 2022年 6月22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	18,067,617	2,500,379
合計	18,067,617	2,500,379

## 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6月22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6月22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	29,044,176	57,614,931	
		外国債券マザーファンド	9,188,632	23,781,098	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	7,549,619	32,957,106	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	39,109,691	50,431,946	
		J-REITインデックスマザーファンド	6,682,953	17,249,369	
		海外REITインデックスマザーファンド	5,501,279	17,285,018	
		新興国株式マザーファンド	16,040,875	25,809,767	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	9,176,890	13,083,492	
	小計	銘柄数:8 組入時価比率:99.9%	122,294,115	238,212,727 100.0%	
合計			238,212,727		

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「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」、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックスマザーファンド」および「海外REITインデックスマザーファンド」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。

## 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(2022年6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,229,060,671

(2022年 6月22日現在)

国債証券	677,484,554,600
地方債証券	56,505,469,800
特殊債券	64,300,340,204
社債券	41,608,470,800
未収利息	977,668,219
前払費用	20,331,083
流動資産合計	847,125,895,377
資産合計	847,125,895,377
負債の部	
流動負債	
未払解約金	501,343,354
未払利息	4,571
流動負債合計	501,347,925
負債合計	501,347,925
純資産の部	
元本等	
元本	656,553,222,302
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	190,071,325,150
元本等合計	846,624,547,452
純資産合計	846,624,547,452
負債純資産合計	847,125,895,377

## 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 6月22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	1.2895円
(10,000口当たり純資産額)	(12,895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 6月23日

至 2022年 6月22日

## 1. 金融商品に対する取組方針

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

## 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

## 市場リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

2022年 6月22日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 6月22日現在

	2021年 6月23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	589,810,715,161円
同期中における追加設定元本額	128,747,363,944円
同期中における一部解約元本額	62,004,856,803円
期末元本額	656,553,222,302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	398,155,382円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	42,483,065,146円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	18,295,683,927円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	3,849,421,967円

野村資産設計ファンド2015	340,065,995円
野村資産設計ファンド2020	360,612,461円
野村資産設計ファンド2025	363,687,817円
野村資産設計ファンド2030	310,320,918円
野村資産設計ファンド2035	165,655,857円
野村資産設計ファンド2040	219,550,375円
野村日本債券インデックスファンド	754,026,180円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	159,534,598,238円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	17,086,303,960円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	24,396,594,729円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	3,124,504,567円
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	10,003,669,622円
野村資産設計ファンド2045	28,883,626円
野村円債投資インデックスファンド	713,245,930円
野村インデックスファンド・国内債券 マイ・ロード	1,900,322,777円 36,377,553,216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	1,599,016,364円
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	19,043,005,292円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	2,066,316,237円
野村資産設計ファンド2050	25,993,922円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	31,720,404円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	9,421,147円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	4,629,793円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	3,108,969円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	1,594,657,138円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	636,477,170円
インデックス・ブレンド(タイプ )	64,757,954円
インデックス・ブレンド(タイプ )	25,796,075円
インデックス・ブレンド(タイプ )	123,779,600円
インデックス・ブレンド(タイプ )	18,985,456円
インデックス・ブレンド(タイプ )	11,447,148円
野村6資産均等バランス	4,802,484,284円
世界6資産分散ファンド	131,862,743円
野村資産設計ファンド2060	13,198,208円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合連動型上場投信 ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	41,555,671,772円 33,984,786,761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)	526,912,258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)	87,432,429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)	1,569,574,977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)	629,876,414円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	17,476,791円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	10,500,134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)	454,858円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,333,775,535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)	6,269,201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)	41,931,834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)	41,156,118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)	372,032,371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)	298,914,795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)	932,223,916円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	138,977,507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)	1,483,541,839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)	351,664,622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)	15,186,560円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	38,516,602,274円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	53,014,286,394円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	20,617,506,062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)	51,699,825,742円
マイバランスDC30	14,737,251,344円
マイバランスDC50	12,362,966,265円
マイバランスDC70	4,521,327,165円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	13,348,262,247円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	1,446,317,515円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	4,029,806,562円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,817,977,148円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	243,862,269円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	37,478,123円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	44,114,477円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	96,998,333円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	39,109,691円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	14,271,085円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	1,348,889,282円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	670,899,106円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	243,104,963円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	324,287,195円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	6,686,010円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	90,856,712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)	548,639,193円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	420,761,525円
野村DCバランスファンド(年金運用戦略タイプ)	194,334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6月22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6月22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426回	1,500,000,000	1,501,995,000
		国庫債券 利付(2年)第427回	6,800,000,000	6,809,384,000
		国庫債券 利付(2年)第428回	2,400,000,000	2,403,288,000
		国庫債券 利付(2年)第429回	1,500,000,000	1,502,100,000
		国庫債券 利付(2年)第431回	3,000,000,000	3,004,530,000
		国庫債券 利付(2年)第432回	1,500,000,000	1,502,280,000
		国庫債券 利付(2年)第433回	3,500,000,000	3,505,355,000
		国庫債券 利付(2年)第434回	3,000,000,000	3,004,800,000
		国庫債券 利付(5年)第137回	6,600,000,000	6,616,830,000
		国庫債券 利付(5年)第138回	7,100,000,000	7,120,661,000
		国庫債券 利付(5年)第139回	10,200,000,000	10,233,762,000
		国庫債券 利付(5年)第140回	5,100,000,000	5,118,819,000
		国庫債券 利付(5年)第141回	9,600,000,000	9,636,672,000
		国庫債券 利付(5年)第142回	1,200,000,000	1,204,788,000
		国庫債券 利付(5年)第143回	6,070,000,000	6,094,947,700
		国庫債券 利付(5年)第144回	4,400,000,000	4,418,436,000
		国庫債券 利付(5年)第145回	3,900,000,000	3,916,458,000
		国庫債券 利付(5年)第146回	2,100,000,000	2,108,799,000
		国庫債券 利付(5年)第147回	5,600,000,000	5,602,072,000
		国庫債券 利付(5年)第148回	7,300,000,000	7,298,540,000
		国庫債券 利付(5年)第149回	7,100,000,000	7,093,965,000
		国庫債券 利付(5年)第150回	4,000,000,000	3,993,720,000
		国庫債券 利付(5年)第151回	2,500,000,000	2,494,075,000
		国庫債券 利付(40年)第1回	2,860,000,000	3,664,632,400
		国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,111,437,000
		国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,119,933,000
		国庫債券 利付(40年)第4回	1,630,000,000	2,025,943,300
		国庫債券 利付(40年)第5回	1,200,000,000	1,433,976,000
		国庫債券 利付(40年)第6回	1,300,000,000	1,523,158,000
		国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,571,724,000
		国庫債券 利付(40年)第8回	1,500,000,000	1,566,825,000
		国庫債券 利付(40年)第9回	3,550,000,000	2,736,482,000
		国庫債券 利付(40年)第10回	2,010,000,000	1,819,753,500
		国庫債券 利付(40年)第11回	1,750,000,000	1,530,865,000
		国庫債券 利付(40年)第12回	2,070,000,000	1,619,982,000
		国庫債券 利付(40年)第13回	7,020,000,000	5,466,614,400
		国庫債券 利付(40年)第14回	3,960,000,000	3,301,056,000
		国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	3,842,826,000
		国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,916,682,000
		国庫債券 利付(10年)第332回	5,900,000,000	5,961,301,000
		3,600,000,000	3,643,272,000	

国庫債券 利付(10年)第333回			
国庫債券 利付(10年)第334回	6,600,000,000	6,690,156,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	4,600,000,000	4,658,880,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	2,750,000,000	2,788,445,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	3,000,000,000	3,026,940,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	9,000,000,000	9,111,060,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	5,000,000,000	5,065,850,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	2,700,000,000	2,737,692,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	4,900,000,000	4,954,782,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	4,550,000,000	4,567,836,000	
国庫債券 利付(10年)第343回	9,500,000,000	9,534,105,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	6,400,000,000	6,420,288,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	7,000,000,000	7,018,830,000	
国庫債券 利付(10年)第346回	7,600,000,000	7,616,112,000	
国庫債券 利付(10年)第347回	12,000,000,000	12,014,880,000	
国庫債券 利付(10年)第348回	5,800,000,000	5,801,508,000	
国庫債券 利付(10年)第349回	2,800,000,000	2,797,704,000	
国庫債券 利付(10年)第350回	10,150,000,000	10,129,700,000	
国庫債券 利付(10年)第351回	6,000,000,000	5,980,380,000	
国庫債券 利付(10年)第352回	6,400,000,000	6,372,288,000	
国庫債券 利付(10年)第353回	1,200,000,000	1,193,064,000	
国庫債券 利付(10年)第354回	1,850,000,000	1,837,068,500	
国庫債券 利付(10年)第355回	3,400,000,000	3,371,882,000	
国庫債券 利付(10年)第356回	4,800,000,000	4,752,144,000	
国庫債券 利付(10年)第357回	1,900,000,000	1,876,269,000	
国庫債券 利付(10年)第358回	5,470,000,000	5,397,413,100	
	10,600,000,000	10,459,020,000	

国庫債券 利付(10年)第359回			
国庫債券 利付(10年)第360回	10,900,000,000	10,750,561,000	
国庫債券 利付(10年)第361回	8,400,000,000	8,281,392,000	
国庫債券 利付(10年)第362回	9,700,000,000	9,559,156,000	
国庫債券 利付(10年)第363回	10,450,000,000	10,289,488,000	
国庫債券 利付(10年)第364回	10,150,000,000	10,016,933,500	
国庫債券 利付(10年)第365回	12,000,000,000	11,849,520,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	500,000,000	591,765,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	500,000,000	580,610,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	185,430,400	
国庫債券 利付(30年)第4回	1,400,000,000	1,706,320,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	175,485,000	
国庫債券 利付(30年)第6回	600,000,000	718,938,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	718,212,000	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	115,093,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	265,000,000	294,203,000	
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	269,825,000	
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	182,958,400	
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	261,507,400	
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	341,921,600	
国庫債券 利付(30年)第14回	800,000,000	981,056,000	
国庫債券 利付(30年)第15回	900,000,000	1,116,909,000	
国庫債券 利付(30年)第16回	915,000,000	1,137,280,950	
国庫債券 利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,480,272,000	
国庫債券 利付(30年)第18回	2,200,000,000	2,692,008,000	
国庫債券 利付(30年)第19回	2,050,000,000	2,512,398,000	
国庫債券 利付(30年)第20回	1,270,000,000	1,590,433,700	
国庫債券 利付(30年)第21回	300,000,000	368,724,000	
国庫債券 利付(30年)第22回	600,000,000	754,278,000	
国庫債券 利付(30年)第23回	1,840,000,000	2,316,670,400	
国庫債券 利付(30年)第24回	700,000,000	882,049,000	
国庫債券 利付(30年)第25回	500,000,000	617,035,000	
国庫債券 利付(30年)第26回	850,000,000	1,061,505,500	
国庫債券 利付(30年)第27回	3,550,000,000	4,495,152,000	
国庫債券 利付(30年)第28回	1,200,000,000	1,522,416,000	
国庫債券 利付(30年)第29回	1,500,000,000	1,884,285,000	
国庫債券 利付(30年)第30回	1,700,000,000	2,110,720,000	
国庫債券 利付(30年)第31回	1,200,000,000	1,470,168,000	



国庫債券	利付(30年)第32回	1,700,000,000	2,112,539,000
国庫債券	利付(30年)第33回	2,400,000,000	2,863,056,000
国庫債券	利付(30年)第34回	2,800,000,000	3,433,220,000
国庫債券	利付(30年)第35回	2,300,000,000	2,744,245,000
国庫債券	利付(30年)第36回	2,000,000,000	2,390,800,000
国庫債券	利付(30年)第37回	2,300,000,000	2,705,421,000
国庫債券	利付(30年)第38回	1,600,000,000	1,853,280,000
国庫債券	利付(30年)第39回	1,400,000,000	1,647,184,000
国庫債券	利付(30年)第40回	1,300,000,000	1,504,633,000
国庫債券	利付(30年)第41回	1,500,000,000	1,706,880,000
国庫債券	利付(30年)第42回	1,600,000,000	1,819,488,000
国庫債券	利付(30年)第43回	1,300,000,000	1,477,359,000
国庫債券	利付(30年)第44回	1,400,000,000	1,589,882,000
国庫債券	利付(30年)第45回	1,700,000,000	1,861,194,000
国庫債券	利付(30年)第46回	1,800,000,000	1,970,388,000
国庫債券	利付(30年)第47回	1,700,000,000	1,894,208,000
国庫債券	利付(30年)第48回	1,900,000,000	2,037,560,000
国庫債券	利付(30年)第49回	2,900,000,000	3,105,900,000
国庫債券	利付(30年)第50回	2,400,000,000	2,266,584,000
国庫債券	利付(30年)第51回	3,150,000,000	2,636,613,000
国庫債券	利付(30年)第52回	1,900,000,000	1,664,286,000
国庫債券	利付(30年)第53回	1,700,000,000	1,519,851,000
国庫債券	利付(30年)第54回	1,700,000,000	1,588,446,000
国庫債券	利付(30年)第55回	1,500,000,000	1,398,075,000
国庫債券	利付(30年)第56回	1,900,000,000	1,766,430,000
国庫債券	利付(30年)第57回	1,600,000,000	1,483,744,000
国庫債券	利付(30年)第58回	2,100,000,000	1,942,437,000
国庫債券	利付(30年)第59回	1,600,000,000	1,441,488,000
国庫債券	利付(30年)第60回	1,150,000,000	1,083,300,000
国庫債券	利付(30年)第61回	1,500,000,000	1,341,135,000
国庫債券	利付(30年)第62回	3,000,000,000	2,538,870,000
国庫債券	利付(30年)第63回	2,500,000,000	2,052,475,000
国庫債券	利付(30年)第64回	2,500,000,000	2,047,325,000
国庫債券	利付(30年)第65回	2,200,000,000	1,802,614,000
国庫債券	利付(30年)第66回	2,600,000,000	2,129,426,000
国庫債券	利付(30年)第67回	2,400,000,000	2,061,552,000
国庫債券	利付(30年)第68回	1,950,000,000	1,673,178,000
国庫債券	利付(30年)第69回	2,200,000,000	1,937,628,000
国庫債券	利付(30年)第70回	1,610,000,000	1,415,286,600
国庫債券	利付(30年)第71回	2,400,000,000	2,107,872,000
国庫債券	利付(30年)第72回	1,300,000,000	1,140,763,000
国庫債券	利付(30年)第73回	500,000,000	438,375,000
国庫債券	利付(30年)第74回	1,500,000,000	1,418,685,000

国庫債券	利付(20年)第64回	400,000,000	409,988,000
国庫債券	利付(20年)第65回	455,000,000	468,572,650
国庫債券	利付(20年)第66回	300,000,000	308,499,000
国庫債券	利付(20年)第67回	310,000,000	320,747,700
国庫債券	利付(20年)第68回	290,000,000	301,571,000
国庫債券	利付(20年)第69回	560,000,000	581,364,000
国庫債券	利付(20年)第70回	540,000,000	566,767,800
国庫債券	利付(20年)第71回	200,000,000	209,116,000
国庫債券	利付(20年)第72回	1,470,000,000	1,541,677,200
国庫債券	利付(20年)第73回	1,200,000,000	1,261,716,000
国庫債券	利付(20年)第74回	800,000,000	843,144,000
国庫債券	利付(20年)第75回	600,000,000	635,388,000
国庫債券	利付(20年)第76回	910,000,000	958,675,900
国庫債券	利付(20年)第77回	700,000,000	739,368,000
国庫債券	利付(20年)第78回	800,000,000	846,488,000
国庫債券	利付(20年)第79回	860,000,000	912,546,000
国庫債券	利付(20年)第80回	1,400,000,000	1,489,740,000
国庫債券	利付(20年)第81回	360,000,000	383,727,600
国庫債券	利付(20年)第82回	820,000,000	876,711,200
国庫債券	利付(20年)第83回	1,370,000,000	1,471,517,000
国庫債券	利付(20年)第84回	1,200,000,000	1,284,732,000
国庫債券	利付(20年)第85回	400,000,000	431,492,000
国庫債券	利付(20年)第86回	1,700,000,000	1,846,557,000
国庫債券	利付(20年)第87回	500,000,000	541,235,000
国庫債券	利付(20年)第88回	1,100,000,000	1,200,507,000
国庫債券	利付(20年)第89回	470,000,000	511,068,600
国庫債券	利付(20年)第90回	1,500,000,000	1,638,300,000
国庫債券	利付(20年)第91回	250,000,000	274,110,000
国庫債券	利付(20年)第92回	650,000,000	710,053,500
国庫債券	利付(20年)第93回	300,000,000	327,582,000
国庫債券	利付(20年)第94回	200,000,000	219,334,000
国庫債券	利付(20年)第95回	100,000,000	111,092,000
国庫債券	利付(20年)第96回	400,000,000	440,392,000
国庫債券	利付(20年)第97回	300,000,000	333,036,000
国庫債券	利付(20年)第98回	300,000,000	331,470,000
国庫債券	利付(20年)第99回	1,100,000,000	1,219,515,000
国庫債券	利付(20年)第100回	820,000,000	916,702,600
国庫債券	利付(20年)第101回	250,000,000	282,330,000
国庫債券	利付(20年)第102回	1,500,000,000	1,700,925,000
国庫債券	利付(20年)第103回	600,000,000	676,806,000

国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	446,452,000	
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,127,867,000	
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	450,444,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	336,966,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,776,624,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,002,078,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,239,392,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	910,008,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,035,116,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	2,000,000,000	2,264,860,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	1,700,000,000	1,931,319,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	1,000,000,000	1,143,420,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,262,382,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	1,400,000,000	1,596,042,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	568,335,000	
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	896,800,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	884,272,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	1,200,000,000	1,359,372,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	900,000,000	1,012,266,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	1,500,000,000	1,730,775,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,145,530,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	1,400,000,000	1,633,492,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	1,200,000,000	1,379,604,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	500,000,000	570,560,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	800,000,000	915,672,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	1,300,000,000	1,476,540,000	
	1,700,000,000	1,936,317,000	

国庫債券 利付(20年)第130回			
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	903,984,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,473,420,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,599,738,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	1,400,000,000	1,604,036,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	700,000,000	795,368,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	788,725,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,138,570,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	895,296,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	1,000,000,000	1,128,850,000	
国庫債券 利付(20年)第140回	2,300,000,000	2,622,621,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	2,600,000,000	2,967,250,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	950,000,000	1,093,849,000	
国庫債券 利付(20年)第143回	1,300,000,000	1,471,236,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,300,000,000	1,457,755,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,300,000,000	2,630,027,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	2,400,000,000	2,747,520,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	4,000,000,000	4,537,360,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	2,100,000,000	2,359,014,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	3,850,000,000	4,327,169,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	3,330,000,000	3,703,526,100	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,500,000,000	2,720,150,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	2,650,000,000	2,882,511,000	
国庫債券 利付(20年)第153回	1,600,000,000	1,759,360,000	
国庫債券 利付(20年)第154回	2,820,000,000	3,063,281,400	
国庫債券 利付(20年)第155回	3,850,000,000	4,080,422,500	
	4,650,000,000	4,555,047,000	

	国庫債券 利付（20年）第156回			
	国庫債券 利付（20年）第157回	5,540,000,000	5,264,108,000	
	国庫債券 利付（20年）第158回	3,470,000,000	3,426,694,400	
	国庫債券 利付（20年）第159回	4,810,000,000	4,803,554,600	
	国庫債券 利付（20年）第160回	3,000,000,000	3,030,360,000	
	国庫債券 利付（20年）第161回	3,100,000,000	3,080,904,000	
	国庫債券 利付（20年）第162回	1,700,000,000	1,684,700,000	
	国庫債券 利付（20年）第163回	2,600,000,000	2,569,034,000	
	国庫債券 利付（20年）第164回	2,600,000,000	2,524,470,000	
	国庫債券 利付（20年）第165回	2,200,000,000	2,129,050,000	
	国庫債券 利付（20年）第166回	2,300,000,000	2,289,972,000	
	国庫債券 利付（20年）第167回	2,600,000,000	2,500,914,000	
	国庫債券 利付（20年）第168回	2,700,000,000	2,546,181,000	
	国庫債券 利付（20年）第169回	3,030,000,000	2,799,174,600	
	国庫債券 利付（20年）第170回	2,800,000,000	2,576,140,000	
	国庫債券 利付（20年）第171回	2,500,000,000	2,292,350,000	
	国庫債券 利付（20年）第172回	3,840,000,000	3,570,854,400	
	国庫債券 利付（20年）第173回	3,250,000,000	3,012,360,000	
	国庫債券 利付（20年）第174回	6,970,000,000	6,433,937,300	
	国庫債券 利付（20年）第175回	5,500,000,000	5,151,190,000	
	国庫債券 利付（20年）第176回	6,020,000,000	5,620,332,200	
	国庫債券 利付（20年）第177回	5,070,000,000	4,636,261,500	
	国庫債券 利付（20年）第178回	3,750,000,000	3,483,937,500	
	国庫債券 利付（20年）第179回	3,000,000,000	2,780,220,000	
	メキシコ合衆国 第19回円貨社債（2014）	100,000,000	101,308,000	
小計	銘柄数：264	665,755,000,000	677,484,554,600	
	組入時価比率：80.0%		80.6%	
合計			677,484,554,600	

地方債証券	日本円	東京都 公募第731回	100,000,000	101,098,000	
		東京都 公募第736回	100,000,000	101,077,000	
		東京都 公募第745回	300,000,000	304,329,000	
		東京都 公募第760回	100,000,000	99,746,000	
		東京都 公募第761回	100,000,000	99,873,000	
		東京都 公募第769回	500,000,000	501,240,000	
		東京都 公募第778回	100,000,000	99,717,000	
		東京都 公募第784回	200,000,000	200,048,000	
		東京都 公募第813回	200,000,000	197,258,000	
		東京都 公募第822回	130,000,000	126,521,200	
		東京都 公募（30年）第7回	100,000,000	126,014,000	
		東京都 公募第10回	200,000,000	246,286,000	
		東京都 公募（20年）第3回	200,000,000	207,852,000	
		東京都 公募第7回	100,000,000	106,801,000	
		東京都 公募（20年）第13回	100,000,000	110,635,000	
		東京都 公募（20年）第16回	200,000,000	222,288,000	
		東京都 公募（20年）第17回	200,000,000	223,310,000	
		東京都 公募（20年）第20回	180,000,000	202,710,600	
		東京都 公募第23回	100,000,000	114,792,000	
		東京都 公募（20年）第26回	100,000,000	113,415,000	
		東京都 公募（20年）第29回	200,000,000	224,334,000	
		東京都 公募（5年）第31回	300,000,000	299,967,000	
		東京都 公募（5年）第32回	300,000,000	299,685,000	
		北海道 公募平成26年度第13回	100,000,000	101,056,000	
		北海道 公募平成27年度第7回	100,000,000	101,476,000	
		北海道 公募平成29年度第5回	200,000,000	200,198,000	
		北海道 公募平成29年度第7回	100,000,000	100,128,000	
		北海道 公募平成29年度第9回	100,000,000	100,055,000	
		北海道 公募平成30年度第15回	253,920,000	250,895,812	
		北海道 公募平成30年度第18回	200,000,000	198,044,000	
		北海道 公募令和2年度第4回	300,000,000	295,443,000	
		宮城県 公募第31回1号	300,000,000	304,413,000	
		宮城県 公募第32回2号	100,000,000	99,978,000	
		神奈川県 公募第200回	100,000,000	101,033,000	
		神奈川県 公募第205回	100,000,000	101,148,000	
		神奈川県 公募第206回	100,000,000	101,284,000	
		神奈川県 公募第208回	100,000,000	101,079,000	
		神奈川県 公募第210回	200,000,000	202,098,000	
		神奈川県 公募第212回	100,000,000	101,039,000	
		神奈川県 公募第231回	200,000,000	200,282,000	
神奈川県 公募第243回	200,000,000	195,980,000			
神奈川県 公募第247回	200,000,000	196,498,000			

神奈川県 公募(30年)第3回	100,000,000	126,722,000
神奈川県 公募第7回	300,000,000	329,451,000
神奈川県 公募(20年)第14回	100,000,000	112,889,000
神奈川県 公募(20年)第17回	200,000,000	228,816,000
神奈川県 公募(20年)第20回	100,000,000	113,033,000
神奈川県 公募(20年)第26回	100,000,000	111,253,000
大阪府 公募第378回	104,000,000	105,038,960
大阪府 公募第381回	100,000,000	101,135,000
大阪府 公募第382回	100,000,000	101,164,000
大阪府 公募第383回	100,000,000	101,254,000
大阪府 公募第384回	100,000,000	101,266,000
大阪府 公募第387回	300,000,000	303,222,000
大阪府 公募第389回	100,000,000	101,165,000
大阪府 公募第396回	200,000,000	202,920,000
大阪府 公募第417回	102,000,000	102,488,580
大阪府 公募第423回	100,000,000	100,000,000
大阪府 公募第429回	179,000,000	178,733,290
大阪府 公募第452回	100,000,000	97,756,000
大阪府 公募第467回	140,000,000	137,586,400
大阪府 公募第469回	150,000,000	146,896,500
大阪府 公募第5回	100,000,000	114,045,000
大阪府 公募第8回	100,000,000	113,453,000
大阪府 公募(5年)第173回	200,000,000	199,636,000
大阪府 公募(5年)第174回	200,000,000	199,598,000
大阪府 公募(5年)第178回	400,000,000	398,880,000
大阪府 公募(5年)第184回	400,000,000	398,412,000
大阪府 公募(5年)第190回	200,000,000	198,798,000
京都府 公募平成25年度第15回	200,000,000	202,282,000
京都府 公募平成26年度第5回	100,000,000	110,998,000
京都府 公募平成26年度第7回	200,000,000	202,416,000
京都府 公募(20年)平成27年度第5回	200,000,000	216,292,000
京都府 公募(15年)平成27年度第8回	100,000,000	103,511,000
京都府 公募(15年)平成28年度第2回	200,000,000	197,600,000
京都府 公募(20年)平成28年度第5回	100,000,000	95,628,000
京都府 公募平成29年度第4回	100,000,000	100,123,000
兵庫県 公募平成26年度第17回	100,000,000	101,125,000
兵庫県 公募平成29年度第22回	100,000,000	99,910,000
兵庫県 公募(30年)第2回	200,000,000	248,268,000
兵庫県 公募(15年)第1回	300,000,000	319,176,000
兵庫県 公募(15年)第3回	200,000,000	211,904,000

兵庫県	公募(12年)第3回	300,000,000	304,344,000
兵庫県	公募(15年)第8回	100,000,000	105,347,000
兵庫県	公募(15年)第11回	100,000,000	102,884,000
兵庫県	公募第2回	100,000,000	111,392,000
兵庫県	公募第9回	100,000,000	113,932,000
兵庫県	公募(20年)第11回	200,000,000	223,880,000
兵庫県	公募(20年)第14回	100,000,000	113,026,000
兵庫県	公募(20年)第21回	100,000,000	111,951,000
兵庫県	公募(20年)第22回	100,000,000	110,369,000
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	102,027,170
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	167,130,150
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	101,206,000
静岡県	公募平成26年度第9回	200,000,000	202,448,000
静岡県	公募平成27年度第11回	115,400,000	115,524,632
静岡県	公募平成28年度第2回	300,000,000	299,988,000
静岡県	公募平成29年度第3回	100,000,000	100,141,000
静岡県	公募(31年)第1回	174,000,000	171,755,400
静岡県	公募(5年)令和3年度第2回	100,000,000	99,716,000
静岡県	公募(5年)令和3年度第5回	300,000,000	298,866,000
静岡県	公募(15年)第2回	200,000,000	212,380,000
静岡県	公募(15年)第5回	200,000,000	210,390,000
静岡県	公募(15年)第9回	100,000,000	103,159,000
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	112,194,000
静岡県	公募(20年)第14回	200,000,000	226,644,000
静岡県	公募(20年)第18回	100,000,000	111,193,000
静岡県	公募(20年)第30回	200,000,000	184,688,000
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	111,336,000
愛知県	公募(20年)平成22年度第8回	200,000,000	224,916,000
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	112,825,000
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	424,272,000
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	114,633,000
愛知県	公募(30年)平成25年度第8回	120,000,000	142,306,800
愛知県	公募(20年)平成25年度第17回	100,000,000	112,594,000
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	114,363,000
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	109,885,000
愛知県	公募平成26年度第17回	300,000,000	303,399,000
愛知県	公募(15年)平成27年度第2回	300,000,000	309,096,000
愛知県	公募平成27年度第15回	100,000,000	101,371,000



愛知県	公募平成29年度第8回	100,000,000	100,128,000	
愛知県	公募平成29年度第9回	100,000,000	99,870,000	
愛知県	公募平成30年度第7回	200,000,000	199,216,000	
愛知県	公募令和3年度第10回	200,000,000	199,020,000	
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	202,028,000	
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	110,489,919	
広島県	公募平成26年度第7回	200,000,000	202,284,000	
広島県	公募平成29年度第3回	100,000,000	99,843,000	
広島県	公募平成29年度第4回	211,300,000	211,648,645	
広島県	公募平成30年度第6回	300,000,000	300,078,000	
広島県	公募令和2年度第2回	100,000,000	98,584,000	
広島県	公募令和2年度第7回	300,000,000	296,664,000	
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	101,009,000	
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	149,519,960	
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	101,121,000	
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	101,136,000	
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	101,260,000	
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	202,368,000	
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	404,420,000	
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	101,041,000	
埼玉県	公募平成27年度第9回	100,000,000	100,564,000	
埼玉県	公募平成28年度第5回	100,000,000	99,795,000	
埼玉県	公募平成30年度第4回	200,000,000	199,584,000	
埼玉県	公募平成30年度第7回	200,000,000	200,068,000	
埼玉県	公募令和元年度第4回	100,000,000	98,320,000	
埼玉県	公募令和2年度第4回	300,000,000	295,332,000	
埼玉県	公募（15年）第1回	100,000,000	104,370,000	
埼玉県	公募（15年）第2回	200,000,000	208,208,000	
埼玉県	公募（15年）第3回	100,000,000	100,510,000	
埼玉県	公募（25年）第2回	200,000,000	191,800,000	
埼玉県	公募（30年）第9回	200,000,000	183,478,000	
埼玉県	公募（20年）第6回	100,000,000	112,402,000	
埼玉県	公募（20年）第16回	100,000,000	107,970,000	
埼玉県	公募（20年）第20回	100,000,000	98,931,000	
福岡県	公募平成26年度第1回	100,000,000	101,283,000	
福岡県	公募平成27年度第1回	300,000,000	304,716,000	
福岡県	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,173,000	
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	106,044,000	
福岡県	公募（15年）平成27年度第1回	200,000,000	207,190,000	
福岡県	公募（15年）令和元年度第1回	100,000,000	97,067,000	
福岡県	公募（30年）平成19年度第1回	100,000,000	127,021,000	

福岡県 公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	114,597,000	
福岡県 公募(30年・定時償還)平成29年度第2回	100,000,000	94,045,000	
福岡県 公募(30年・定時償還)令和元年度第3回	100,000,000	81,056,000	
福岡県 公募(20年)平成20年度第1回	300,000,000	336,762,000	
福岡県 公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	111,400,000	
福岡県 公募(20年)平成22年度第1回	300,000,000	334,188,000	
福岡県 公募(20年)平成22年度第2回	300,000,000	345,009,000	
福岡県 公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	112,706,000	
千葉県 公募平成25年度第4回	100,000,000	101,011,000	
千葉県 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,233,000	
千葉県 公募平成26年度第3回	200,000,000	202,482,000	
千葉県 公募平成26年度第6回	120,000,000	120,931,200	
千葉県 公募平成27年度第6回	200,000,000	202,750,000	
千葉県 公募平成28年度第4回	200,000,000	199,788,000	
千葉県 公募平成29年度第4回	100,000,000	99,844,000	
千葉県 公募平成29年度第8回	100,000,000	99,886,000	
千葉県 公募令和元年度第6回	300,000,000	295,224,000	
千葉県 公募(20年)第1回	400,000,000	427,720,000	
千葉県 公募(20年)第8回	100,000,000	114,039,000	
千葉県 公募(20年)第13回	200,000,000	226,448,000	
千葉県 公募(20年)第16回	200,000,000	224,066,000	
千葉県 公募(20年)第17回	100,000,000	110,414,000	
新潟県 公募平成30年度第2回	200,000,000	199,936,000	
新潟県 公募令和2年度第2回	120,000,000	117,933,600	
長野県 公募令和3年度第1回	300,000,000	295,893,000	
茨城県 公募令和3年度第3回	200,000,000	199,168,000	
群馬県 公募第12回	100,000,000	101,443,000	
群馬県 公募(5年)第13回	300,000,000	298,818,000	
群馬県 公募(20年)第3回	100,000,000	112,873,000	
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	188,891,373	
共同発行市場地方債 公募第124回	300,000,000	302,997,000	
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	101,026,000	
共同発行市場地方債 公募第128回	700,000,000	706,629,000	
共同発行市場地方債 公募第129回	100,000,000	101,080,000	
	100,000,000	101,208,000	

共同発行市場地方債 公募第130回			
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	101,142,000	
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	202,482,000	
共同発行市場地方債 公募第137回	500,000,000	505,880,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	156,864,650	
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	545,896,800	
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,010,240,000	
共同発行市場地方債 公募第152回	400,000,000	405,816,000	
共同発行市場地方債 公募第154回	300,000,000	303,531,000	
共同発行市場地方債 公募第156回	200,000,000	200,104,000	
共同発行市場地方債 公募第157回	300,000,000	299,877,000	
共同発行市場地方債 公募第161回	300,000,000	299,439,000	
共同発行市場地方債 公募第172回	600,000,000	601,812,000	
共同発行市場地方債 公募第184回	100,000,000	99,579,000	
共同発行市場地方債 公募第186回	400,000,000	399,868,000	
共同発行市場地方債 公募第188回	300,000,000	299,910,000	
共同発行市場地方債 公募第190回	610,000,000	605,254,200	
共同発行市場地方債 公募第191回	100,000,000	99,050,000	
共同発行市場地方債 公募第194回	200,000,000	197,420,000	
共同発行市場地方債 公募第196回	400,000,000	393,192,000	
共同発行市場地方債 公募第197回	300,000,000	294,630,000	
共同発行市場地方債 公募第200回	100,000,000	98,045,000	
共同発行市場地方債 公募第206回	300,000,000	295,014,000	
共同発行市場地方債 公募第213回	300,000,000	294,543,000	
共同発行市場地方債 公募第215回	400,000,000	393,256,000	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	113,328,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	111,169,000	
長崎県 公募令和元年度第3回	100,000,000	98,286,000	

島根県 公募（30年）平成29年度第1回	100,000,000	94,040,000	
佐賀県 公募平成28年度第1回	100,000,000	99,801,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	202,262,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	100,942,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	143,606,020	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	100,942,000	
熊本県 公募平成28年度第2回	132,000,000	131,685,840	
熊本市 公募平成29年度第1回	100,000,000	99,977,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	235,758,204	
新潟市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,058,000	
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	100,775,000	
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	100,992,000	
大阪市 公募平成26年度第5回	100,000,000	101,274,000	
大阪市 公募平成27年度第6回	100,000,000	101,369,000	
大阪市 公募令和2年度第2回	300,000,000	295,014,000	
大阪市 公募令和3年度第2回	300,000,000	295,071,000	
大阪市 公募（15年）第1回	100,000,000	106,718,000	
大阪市 公募（20年）第1回	300,000,000	333,930,000	
大阪市 公募（20年）第5回	100,000,000	113,694,000	
大阪市 公募（20年）第6回	100,000,000	112,422,000	
大阪市 公募（20年）第17回	100,000,000	113,481,000	
大阪市 公募（20年）第26回	100,000,000	98,619,000	
名古屋市 公募第488回	300,000,000	303,858,000	
名古屋市 公募第489回	100,000,000	101,074,000	
名古屋市 公募第501回	200,000,000	199,948,000	
名古屋市 公募第503回	100,000,000	99,914,000	
名古屋市 公募第504回	200,000,000	199,586,000	
名古屋市 公募第511回	200,000,000	195,774,000	
名古屋市 公募第512回	300,000,000	295,446,000	
名古屋市 公募（12年）第1回	200,000,000	205,876,000	
名古屋市 公募（15年）第2回	100,000,000	104,080,000	
京都市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,205,000	
京都市 公募平成29年度第4回	101,280,000	101,437,996	
京都市 公募（20年）第2回	100,000,000	106,654,000	
京都市 公募（20年）第5回	200,000,000	220,004,000	
京都市 公募（20年）第6回	100,000,000	111,444,000	
京都市 公募（20年）第13回	100,000,000	109,857,000	
京都市 公募（20年）第15回	200,000,000	194,940,000	
神戸市 公募平成26年度第17回	300,000,000	301,908,000	
神戸市 公募平成28年度第1回	200,000,000	199,956,000	
神戸市 公募平成30年度第2回	200,000,000	183,478,000	
横浜市 公募公債平成25年度5回	200,000,000	201,854,000	

横浜市	公募公債平成26年度5回	200,000,000	202,182,000	
横浜市	公募平成28年度第5回	300,000,000	301,248,000	
横浜市	公募平成29年度第3回	100,000,000	100,254,000	
横浜市	公募2019年度第3回	200,000,000	195,996,000	
横浜市	公募(30年)第2回	200,000,000	247,066,000	
横浜市	公募(20年)第11回	100,000,000	109,263,000	
横浜市	公募(20年)第18回	100,000,000	113,071,000	
横浜市	公募(20年)第26回	100,000,000	114,111,000	
横浜市	公募(20年)第30回	100,000,000	110,051,000	
札幌市	公募(15年)平成23年度第9回	200,000,000	212,530,000	
札幌市	公募(20年)平成24年度第1回	100,000,000	113,583,000	
札幌市	公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	114,346,000	
札幌市	公募平成26年度第4回	100,000,000	101,056,000	
札幌市	公募平成26年度第9回	200,000,000	201,994,000	
川崎市	公募(20年)第14回	100,000,000	113,509,000	
川崎市	公募(20年)第17回	100,000,000	111,575,000	
川崎市	公募(20年)第19回	100,000,000	109,957,000	
川崎市	公募(30年)第11回	100,000,000	91,107,000	
北九州市	公募(10年)令和2年度第2回	200,000,000	196,120,000	
北九州市	公募(20年)第3回	200,000,000	222,300,000	
北九州市	公募(20年)第14回	100,000,000	113,459,000	
福岡市	公募(20年)平成21年度第3回	200,000,000	225,924,000	
福岡市	公募(20年)平成23年度第4回	100,000,000	113,314,000	
福岡市	公募平成26年度第2回	100,000,000	111,401,000	
福岡市	公募平成26年度第5回	100,000,000	101,195,000	
福岡市	公募平成26年度第8回	160,000,000	161,848,000	
福岡市	公募(5年)2020年度第9回	300,000,000	299,304,000	
広島市	公募平成26年度第2回	100,000,000	101,055,000	
広島市	公募平成27年度第2回	500,000,000	506,785,000	
広島市	公募(10年)平成30年度第6回	241,000,000	238,804,490	
千葉市	公募平成26年度第2回	200,000,000	202,308,000	
三重県	公募平成28年度第1回	155,000,000	155,241,800	
福井県	公募平成27年度第4回	200,000,000	199,956,000	
福井県	公募令和元年度第3回	200,000,000	195,978,000	
徳島県	公募平成29年度第2回	200,000,000	199,954,000	
徳島県	公募平成30年度第2回	300,000,000	299,907,000	
山梨県	公募令和元年度第1回	100,000,000	97,953,000	

小計	岡山県 公募平成28年度第2回	168,900,000	169,374,609	
	岡山県 公募令和2年度第3回	300,000,000	296,781,000	
	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	111,859,000	
	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	338,976,000	
	福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	111,424,000	
	福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	102,404,000	
	銘柄数：308	54,948,320,000	56,505,469,800	
	組入時価比率：6.7%		6.7%	
合計			56,505,469,800	
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	100,874,000
		新関西国際空港債券 政府保証第5回	117,000,000	117,135,720
		新関西国際空港社債 財投機関債第6回	300,000,000	321,015,000
		新関西国際空港社債 財投機関債第9回	100,000,000	105,865,000
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	104,993,000
		新関西国際空港社債 財投機関債第22回	200,000,000	200,106,000
		原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券 政府保証第16回	700,000,000	700,266,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	104,673,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第66回	400,000,000	399,836,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第78回	200,000,000	200,560,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第82回	100,000,000	100,425,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000	300,396,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第96回	200,000,000	198,986,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第101回	300,000,000	300,237,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第137回	400,000,000	399,016,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第138回	400,000,000	392,200,000
		日本政策投資銀行社債 政府保証第37回	400,000,000	399,732,000
		日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	300,000,000	299,688,000
		日本政策投資銀行社債 政府保証第52回	410,000,000	409,954,900

日本政策投資銀行社債 政府保証第55回	300,000,000	296,721,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第1回	300,000,000	408,003,000	
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	124,991,000	
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	217,540,000	
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	109,385,000	
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	333,348,000	
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	271,270,000	
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	338,490,000	
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	114,080,000	
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	113,190,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第103回	350,000,000	394,852,500	
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	114,487,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第116回	400,000,000	403,576,000	
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	101,191,000	
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	101,166,000	
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	202,132,000	
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	202,008,000	
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	202,436,000	
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	321,765,000	
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	108,588,000	
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	103,781,000	
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	106,541,000	
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	80,273,000	
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	97,937,000	
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	168,650,000	
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	112,846,000	
	200,000,000	225,842,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第9 2 回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第9 7 回	200,000,000	226,138,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第9 9 回	200,000,000	227,940,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第1 0 6 回	200,000,000	227,318,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第1 1 4 回	200,000,000	225,058,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第1 2 3 回	100,000,000	119,944,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第1 4 6 回	100,000,000	113,381,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第1 6 5 回	100,000,000	115,342,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第1 6 9 回	100,000,000	112,971,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第1 7 1 回	100,000,000	112,072,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第1 7 2 回	300,000,000	350,430,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第1 8 3 回	100,000,000	113,728,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第1 8 5 回	200,000,000	228,166,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第1 9 6 回	300,000,000	343,680,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第1 9 7 回	272,000,000	274,790,720	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 0 7 回	300,000,000	303,273,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 1 1 回	137,000,000	138,585,090	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 1 3 回	745,000,000	753,828,250	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 1 6 回	100,000,000	111,399,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 1 7 回	100,000,000	112,546,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 1 9 回	100,000,000	111,389,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 2 0 回	300,000,000	304,014,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 2 4 回	100,000,000	112,460,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 2 5 回	190,000,000	192,337,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 2 9 回	630,000,000	638,007,300	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 3 3 回	100,000,000	109,482,000	
	100,000,000	101,159,000	



日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回			
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	537,765,000	
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	202,410,000	
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	319,440,000	
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	107,726,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第258回	400,000,000	404,708,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第261回	401,000,000	405,679,670	
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	150,794,640	
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	196,118,000	
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	99,910,000	
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	403,463,450	
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	99,950,000	
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	600,000,000	
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	99,634,000	
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	92,161,000	
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	500,035,000	
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	130,588,660	
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	99,554,000	
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	198,854,000	
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	99,871,000	
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	502,936,000	
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	127,273,000	
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	1,049,820,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	127,620,000	
地方公営企業等金融機構債券（20年）第1回	100,000,000	111,314,000	
地方公共団体金融機構債券（20年）第1回	300,000,000	340,416,000	
	100,000,000	112,801,000	

地方公共団体金融機構債券 20年 第4回			
地方公共団体金融機構債券 F16 回	100,000,000	108,613,000	
地方公共団体金融機構債券 20年 第6回	300,000,000	342,273,000	
地方公共団体金融機構債券 20年 第7回	300,000,000	342,078,000	
地方公共団体金融機構債券(20 年) 第10回	300,000,000	333,195,000	
地方公共団体金融機構債券 F10 4回	100,000,000	103,416,000	
地方公共団体金融機構債券 F10 6回	100,000,000	102,165,000	
地方公共団体金融機構債券 F12 2回	100,000,000	106,144,000	
地方公共団体金融機構債券 F12 4回	100,000,000	106,156,000	
地方公共団体金融機構債券 F13 2回	500,000,000	515,880,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 2回	100,000,000	102,374,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 5回	200,000,000	205,520,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 7回	100,000,000	105,368,000	
地方公共団体金融機構債券 F16 0回	100,000,000	104,591,000	
地方公共団体金融機構債券(20 年) 第29回	100,000,000	113,447,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第50回	100,000,000	100,995,000	
地方公共団体金融機構債券 第51 回	600,000,000	605,952,000	
地方公共団体金融機構債券 第52 回	300,000,000	303,057,000	
地方公共団体金融機構債券(15 年) 第2回	200,000,000	211,008,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第56回	591,000,000	598,210,200	
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回	116,000,000	117,454,640	
地方公共団体金融機構債券(20 年) 第38回	100,000,000	111,016,000	
地方公共団体金融機構債券 F24 0回	300,000,000	315,792,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	101,207,000	
地方公共団体金融機構債券 第64 回	100,000,000	101,208,000	
地方公共団体金融機構債券(20 年) 第39回	100,000,000	110,319,000	
	400,000,000	404,996,000	

政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 5 回			
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 9 回	420,000,000	424,506,600	
地方公共団体金融機構債券（20 年）第 4 3 回	100,000,000	107,071,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 2 回	189,000,000	191,693,250	
地方公共団体金融機構債券 第 7 4 回	300,000,000	304,215,000	
地方公共団体金融機構債券 第 7 7 回	100,000,000	101,390,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 8 回	509,000,000	514,899,310	
地方公共団体金融機構債券 第 7 9 回	400,000,000	405,644,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 8 0 回	300,000,000	302,934,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 （8年）第 5 回	500,000,000	501,595,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 8 3 回	116,000,000	115,841,080	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 9 1 回	300,000,000	299,799,000	
地方公共団体金融機構債券 第 9 5 回	200,000,000	200,364,000	
地方公共団体金融機構債券 第 1 0 1 回	400,000,000	400,644,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 0 8 回	157,000,000	156,403,400	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 0 回	100,000,000	99,430,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 3 回	110,000,000	109,880,100	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 9 回	116,000,000	114,176,480	
政保 地方公共団体金融機構債券 1 1 回	500,000,000	500,075,000	
公営企業債券（20年）第 5 回財 投機関債	200,000,000	205,250,000	
公営企業債券（20年）第 1 9 回 財投機関債	100,000,000	109,998,000	
公営企業債券（20年）第 2 0 回 財投機関債	100,000,000	109,934,000	
公営企業債券（20年）第 2 3 回 財投機関債	200,000,000	221,860,000	
公営企業債券（20年）第 2 4 回 財投機関債	100,000,000	111,712,000	
公営企業債券（20年）第 2 5 回 財投機関債	100,000,000	113,188,000	
首都高速道路 第 2 8 回	200,000,000	198,946,000	
阪神高速道路 第 2 5 回	100,000,000	99,624,000	
	110,000,000	107,957,300	

日本政策金融公庫債券 政府保証第 6 3 回			
都市再生債券 財投機関債第 9 6 回	200,000,000	202,508,000	
都市再生債券 財投機関債第 9 7 回	100,000,000	104,603,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 0 1 回	100,000,000	104,114,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 0 9 回	100,000,000	104,255,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 1 3 回	300,000,000	311,547,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 2 1 回	200,000,000	201,710,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 2 7 回	100,000,000	99,768,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第 7 回	100,000,000	106,495,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第 1 6 回	360,000,000	363,466,800	
民間都市開発推進機構 政府保証第 1 7 回	400,000,000	401,380,000	
東京交通債券 第 3 4 7 回	157,000,000	162,323,870	
関西国際空港債券 政府保証第 5 4 回	300,000,000	338,946,000	
中部国際空港債券 政府保証第 2 2 回	300,000,000	300,135,000	
預金保険機構債券 政府保証第 2 3 0 回	600,000,000	601,368,000	
預金保険機構債券 政府保証第 2 3 1 回	300,000,000	300,684,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 3 回	400,000,000	439,608,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 6 回	200,000,000	222,600,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 1 8 回	100,000,000	102,677,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 4 2 回	100,000,000	105,156,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 4 9 回	100,000,000	113,633,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 5 9 回	100,000,000	112,911,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 7 5 回	100,000,000	114,683,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 7 7 回	300,000,000	319,560,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 7 8 回	100,000,000	114,767,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 8 1 回	100,000,000	113,930,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 8 5 回	200,000,000	226,710,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 9 0 回	200,000,000	212,934,000	

住宅金融支援機構債券 財投機関債 第115回	100,000,000	113,923,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第120回	100,000,000	114,156,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第123回	200,000,000	227,558,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	121,637,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第132回	200,000,000	209,522,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第137回	100,000,000	106,103,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第143回	100,000,000	105,562,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回	450,000,000	456,232,500	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第188回	300,000,000	299,760,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第198回	300,000,000	300,132,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第208回	200,000,000	200,404,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第223回	100,000,000	99,681,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第244回	130,000,000	129,912,900	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第277回	100,000,000	82,445,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第301回	300,000,000	299,466,000	
成田国際空港 第17回	400,000,000	404,404,000	
成田国際空港 第19回	100,000,000	100,561,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第6回	200,000,000	211,802,000	
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	100,150,000	
商工債券 利付第819回い号	300,000,000	300,534,000	
商工債券 利付第829回い号	200,000,000	200,258,000	
商工債券 利付第831回い号	200,000,000	200,026,000	
商工債券 利付第833回い号	100,000,000	99,906,000	
商工債券 利付第845回い号	300,000,000	299,652,000	
商工債券 利付第852回い号	100,000,000	99,589,000	
商工債券 利付第854回い号	400,000,000	397,808,000	
商工債券 利付第856回い号	200,000,000	198,860,000	
しんきん中金債券 利付第374回	300,000,000	299,181,000	
しんきん中金債券 利付第377回	100,000,000	99,596,000	
しんきん中金債券 利付第379回	400,000,000	398,084,000	
しんきん中金債券 利付第380回	100,000,000	99,450,000	
商工債券 利付(3年)第258回	100,000,000	99,943,000	
商工債券 利付(10年)第15回	200,000,000	202,136,000	

国際協力機構債券 第6回財投機関債	200,000,000	228,686,000	
国際協力機構債券 第23回財投機関債	100,000,000	101,109,000	
国際協力機構債券 第35回財投機関債	100,000,000	99,860,000	
東日本高速道路 第57回	100,000,000	99,861,000	
東日本高速道路 第61回	200,000,000	197,016,000	
東日本高速道路 第83回	200,000,000	199,246,000	
東日本高速道路 第86回	400,000,000	397,416,000	
中日本高速道路 第63回	100,000,000	101,557,000	
中日本高速道路 第79回	300,000,000	299,913,000	
中日本高速道路 第86回	100,000,000	99,782,000	
中日本高速道路 第89回	100,000,000	99,646,000	
中日本高速道路 第90回	300,000,000	298,779,000	
中日本高速道路 第91回	200,000,000	198,948,000	
西日本高速道路 第20回	200,000,000	201,868,000	
西日本高速道路 第22回	400,000,000	405,040,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	101,150,000	
西日本高速道路 第30回	300,000,000	300,345,000	
西日本高速道路 第50回	200,000,000	200,058,000	
西日本高速道路 第64回	200,000,000	198,946,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第62回	100,000,000	101,054,000	
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	202,344,000	
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	110,257,000	
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	505,830,000	
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	295,458,000	
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	293,727,000	
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	30,642,000	30,825,852	
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	21,106,000	21,324,024	
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	24,188,000	24,769,963	
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	43,676,000	44,088,738	
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	41,576,000	42,171,784	
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	66,060,000	66,967,664	
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	11,628,000	11,858,350	
	17,831,000	18,855,569	

貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	58,974,000	62,040,058	
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	53,478,000	55,742,258	
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	63,432,000	66,602,331	
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	47,096,000	49,103,231	
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	31,786,000	33,414,396	
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	58,797,000	61,679,816	
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	68,265,000	70,811,967	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	105,510,000	109,332,627	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	93,738,000	97,499,705	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	63,600,000	65,967,192	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	22,014,000	22,989,000	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	52,760,000	55,385,865	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	35,196,000	36,282,852	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	77,040,000	79,458,285	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	34,033,000	35,088,363	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	104,154,000	108,177,469	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	22,084,000	23,249,593	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	23,072,000	24,305,659	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	21,300,000	22,469,370	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	20,809,000	21,883,784	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	58,360,000	60,837,382	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	83,979,000	87,493,521	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	28,172,000	29,372,972	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	67,068,000	69,520,006	
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	63,212,000	66,264,507	
	63,306,000	66,464,969	

貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	112,265,000	117,042,998	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	62,648,000	65,329,334	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	113,754,000	117,762,690	
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	99,381,000	102,403,176	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	79,168,000	82,576,182	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	65,712,000	68,264,254	
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	163,372,000	168,305,834	
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	281,561,000	289,664,325	
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	43,421,000	44,497,406	
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	44,565,000	45,717,005	
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	46,032,000	47,032,735	
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	96,796,000	98,199,542	
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	102,562,000	103,203,012	
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	54,000,000	54,937,980	
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	57,772,000	58,579,074	
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	171,345,000	174,593,701	
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	177,258,000	181,248,077	
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	119,616,000	122,126,739	
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	57,916,000	59,019,878	
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	59,112,000	60,402,414	
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	223,980,000	221,890,266	
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	150,262,000	149,489,653	
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券	151,224,000	150,166,944	
貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券	75,354,000	74,923,728	
貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券	150,908,000	149,925,588	
	75,932,000	75,166,605	



貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券	76,520,000	75,867,284	
貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券	77,855,000	77,296,001	
貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券	311,080,000	307,944,313	
貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券	235,395,000	233,085,775	
貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券	157,332,000	155,678,440	
貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券	160,672,000	159,296,647	
貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券	162,812,000	160,674,278	
貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券	81,909,000	80,812,238	
貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券	82,457,000	81,622,535	
貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券	82,657,000	81,432,023	
貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券	255,471,000	250,507,198	
貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券	254,238,000	249,349,003	
貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券	443,350,000	430,452,948	
貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券	179,446,000	175,761,973	
貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券	180,864,000	176,686,041	
貸付債権担保第164回住宅金融支援機構債券	284,181,000	278,517,272	
貸付債権担保第165回住宅金融支援機構債券	188,478,000	185,206,021	
貸付債権担保第166回住宅金融支援機構債券	284,481,000	280,666,109	
貸付債権担保第167回住宅金融支援機構債券	190,802,000	188,165,116	
貸付債権担保第168回住宅金融支援機構債券	191,124,000	188,293,453	
貸付債権担保第169回住宅金融支援機構債券	288,204,000	283,612,910	
貸付債権担保第170回住宅金融支援機構債券	482,705,000	473,755,649	
貸付債権担保第174回住宅金融支援機構債券	293,667,000	288,765,697	
貸付債権担保第175回住宅金融支援機構債券	295,029,000	289,514,907	
貸付債権担保第176回住宅金融支援機構債券	295,641,000	288,932,905	
	197,744,000	194,580,096	

		貸付債権担保第177回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第178回住宅金融支援機構債券	297,240,000	294,618,343	
		貸付債権担保第179回住宅金融支援機構債券	298,098,000	294,759,302	
		貸付債権担保第180回住宅金融支援機構債券	199,736,000	198,120,135	
	小計	銘柄数：325 組入時価比率：7.6%	62,311,046,000	64,300,340,204 7.7%	
	合計			64,300,340,204	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行(BFCM)第29回円貨社債	200,000,000	198,828,000	
		フランス相互信用連合銀行(BFCM)第31回円貨社債	100,000,000	96,661,000	
		ピー・ピー・シー・イー・エス・エー第14回円貨社債	100,000,000	98,802,000	
		ピー・ピー・シー・イー・エス・エー第6回非上位円貨社債	200,000,000	202,168,000	
		ピー・ピー・シー・イー・エス・エー第4回非上位円貨社債	200,000,000	202,344,000	
		ピー・ピー・シー・イー・エス・エー第25回非上位円貨社債	200,000,000	195,808,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー第6回円貨社債(2014)	100,000,000	100,435,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー第16回円貨社債(2018)	100,000,000	97,295,000	
		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	99,615,000	
		スタンダード・チャータード第3回円貨社債(2015)	100,000,000	99,781,000	
		エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー第2回円	100,000,000	100,169,000	
		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	100,166,000	
		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	97,749,000	
		サンタンデル銀行第1回円貨社債	100,000,000	99,577,000	
		フランス電力第4回円貨社債(2017)	100,000,000	96,095,000	
		現代キャピタル・サービス・インク第15回円貨社債	200,000,000	199,006,000	
		ピー・エヌ・ピー・パリパ第1回円貨社債(2017)	100,000,000	100,297,000	
		ウエストパック・バンキング・コーポレーション第12回円貨社	200,000,000	200,006,000	
		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	199,902,000	
		INPEX第1回社債間限定同順位特約付	500,000,000	498,370,000	

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	197,096,000	
五洋建設 第7回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	99,441,000	
大和ハウス工業 第9回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	96,982,000	
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	294,363,000	
日揮ホールディングス 第6回特定 社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,796,000	
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	198,458,000	
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	298,251,000	
キリンホールディングス 第10回 社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,139,000	
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	99,612,000	
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	98,009,000	
味の素 第24回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,189,000	
日本たばこ産業 第13回	100,000,000	99,245,000	
三越伊勢丹ホールディングス 第6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,136,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,681,000	
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	199,238,000	
森ビル 第23回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	95,828,000	
セブン&アイ・ホールディングス 第13回社債間限定同順位特約	100,000,000	99,944,000	
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	599,112,000	
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	198,698,000	
東レ 第30回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	99,801,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	99,146,000	
旭化成 第11回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	99,880,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	196,758,000	
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	99,804,000	
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	596,916,000	
日本製紙 第15回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	97,953,000	
住友化学 第56回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,636,000	

イビデン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,766,000	
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,530,000	
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	98,886,000	
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	195,940,000	
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	94,887,000	
ダイセル 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,357,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,406,000	
電通 第6回社債間限定同順位特約付	300,000,000	297,471,000	
武田薬品工業 第16回社債間限定同順位特約付	200,000,000	194,350,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,930,000	
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	99,830,000	
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	196,214,000	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,922,000	
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,212,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,082,000	
楽天 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,598,000	
出光興産 第14回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,898,000	
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,659,000	
日本碍子 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,166,000	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	300,000,000	297,462,000	
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	99,659,000	
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	99,977,000	
三菱マテリアル 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,752,000	
住友金属鉱山 第33回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,596,000	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,648,000	
LIXILグループ 第11回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,676,000	
	100,000,000	97,974,000	

日立建機 第20回社債間限定同順位特約付			
荏原製作所 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,611,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	211,464,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,400,000	
パナソニック 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,906,000	
パナソニック 第21回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,799,000	
パナソニック 第22回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,002,000	
パナソニック 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,868,000	
ソニー 第32回	100,000,000	100,237,000	
T D K 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,613,000	
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	98,859,000	
三菱重工業 第35回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,518,000	
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	297,513,000	
J A 三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,140,000	
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	99,616,000	
トヨタ自動車 第26回社債間限定同順位特約付	700,000,000	697,886,000	
トヨタ自動車 第27回社債間限定同順位特約付	300,000,000	295,290,000	
楽天カード 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,842,000	
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	100,353,000	
ニコン 第22回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,547,000	
丸紅 第113回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,667,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,625,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	205,290,000	
三井物産 第64回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,767,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,612,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,919,000	
住友商事 第53回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,618,000	

クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,342,000	
クレディセゾン 第65回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,445,000	
クレディセゾン 第76回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,582,000	
イオン 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,263,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付	100,000,000	101,185,000	
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	100,068,000	
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	200,000,000	202,284,000	
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	110,901,000	
三菱東京UFJ銀行 第23回劣後特約付	100,000,000	115,105,000	
三菱東京UFJ銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	111,440,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	300,000,000	303,060,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	100,000,000	101,191,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付	100,000,000	103,668,000	
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	199,372,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,980,000	
セブン銀行 第12回社債間限定同順位特約付	300,000,000	301,062,000	
みずほフィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	200,000,000	202,000,000	
みずほ銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	109,364,000	
芙蓉総合リース 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,676,000	
みずほリース 第3回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,385,000	
みずほリース 第7回社債間限定同順位特約付	200,000,000	197,500,000	
NTTファイナンス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,901,000	
NTTファイナンス 第16回日本電信電話保証付	100,000,000	99,903,000	
NTTファイナンス 第17回日本電信電話保証付	200,000,000	199,018,000	
NTTファイナンス 第18回日本電信電話保証付	300,000,000	297,507,000	
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	98,299,000	
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	198,868,000	

トヨタファイナンス 第81回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	99,530,000	
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	797,392,000	
リコーリース 第28回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	99,250,000	
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	99,997,000	
アコム 第77回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,062,000	
アコム 第78回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,640,000	
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	96,969,000	
日立キャピタル 第61回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	99,811,000	
日立キャピタル 第80回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	97,305,000	
オリックス 第202回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	97,134,000	
三井住友ファイナンス&リース 第 27回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,246,000	
三菱UFJリース 第52回社債間 限定同順位特約付	300,000,000	298,644,000	
三菱UFJリース 第56回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	99,615,000	
三菱UFJリース 第76回社債間 限定同順位特約付	300,000,000	293,280,000	
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	101,680,000	
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	99,540,000	
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	99,555,000	
三井不動産 第68回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,830,000	
三井不動産 第71回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	196,768,000	
三菱地所 第93回担保提供制限等 財務上特約無	200,000,000	225,786,000	
三菱地所 第120回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	99,575,000	
三菱地所 第129回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	99,642,000	
三菱地所 第135回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	97,940,000	
東京建物 第25回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,921,000	
ダイビル 第19回特定社債間限定 同順位特約付	100,000,000	92,160,000	
住友不動産 第109回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	97,890,000	
	100,000,000	104,984,000	

エヌ・ティ・ティ都市開発 第15 回社債間限定同順位特約付			
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	112,434,000	
森トラスト総合リート投資法人 第 13回	100,000,000	99,880,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投 資法人 第5回特定投資法人債	100,000,000	101,205,000	
東武鉄道 第124回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,791,000	
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	201,670,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	106,708,000	
東京急行電鉄 第83回社債間限定 同順位特約付	200,000,000	198,394,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	208,610,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	97,312,000	
京成電鉄 第58回社債間限定同順 位特約付	200,000,000	199,322,000	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限 定同順位特約付	200,000,000	225,232,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	111,639,000	
東日本旅客鉄道 第106回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	103,617,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	103,834,000	
東日本旅客鉄道 第119回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	99,772,000	
東日本旅客鉄道 第133回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	92,514,000	
東日本旅客鉄道 第145回社債間 限定同順位特約付	200,000,000	155,978,000	
東日本旅客鉄道 第147回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	98,352,000	
東日本旅客鉄道 第153回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	98,094,000	
東日本旅客鉄道 第164回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	98,137,000	
東日本旅客鉄道 第165回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	91,785,000	
東日本旅客鉄道 第167回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	82,618,000	
西日本旅客鉄道 第13回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	109,682,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限 定同順位特約付	300,000,000	331,716,000	
西日本旅客鉄道 第60回社債間限 定同順位特約付	200,000,000	196,618,000	
	200,000,000	196,376,000	



西日本旅客鉄道 第65回社債間限定同順位特約付			
西日本旅客鉄道 第66回社債間限定同順位特約付	200,000,000	186,426,000	
西日本旅客鉄道 第77回社債間限定同順位特約付	100,000,000	82,121,000	
東海旅客鉄道 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	209,294,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	226,534,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,852,000	
東海旅客鉄道 第73回社債間限定同順位特約付	300,000,000	311,631,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,959,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	99,704,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	97,616,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	94,274,000	
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	197,754,000	
西日本鉄道 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,971,000	
阪急阪神ホールディングス 第47回	400,000,000	419,004,000	
阪急阪神ホールディングス 第49回	100,000,000	98,469,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,216,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,547,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,982,000	
日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,537,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,059,000	
九州旅客鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	177,750,000	
九州旅客鉄道 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	91,158,000	
A N Aホールディングス 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	91,815,000	
K D D I 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,054,000	
K D D I 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,621,000	
ソフトバンク 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,214,000	
ソフトバンク 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	196,236,000	
ソフトバンク 第14回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,708,000	

ソフトバンク 第16回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	96,293,000	
東京電力 第548回	100,000,000	108,393,000	
東京電力 第560回	100,000,000	107,294,000	
中部電力 第500回	200,000,000	202,700,000	
中部電力 第524回	100,000,000	99,646,000	
中部電力 第530回	200,000,000	195,612,000	
関西電力 第509回	100,000,000	99,838,000	
関西電力 第511回	300,000,000	298,317,000	
関西電力 第527回	200,000,000	200,258,000	
関西電力 第535回	200,000,000	198,888,000	
中国電力 第377回	100,000,000	101,170,000	
中国電力 第400回	100,000,000	99,333,000	
中国電力 第402回	100,000,000	100,116,000	
中国電力 第416回	100,000,000	98,436,000	
中国電力 第422回	600,000,000	586,650,000	
中国電力 第425回	100,000,000	97,831,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	102,806,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	101,291,000	
北陸電力 第326回	100,000,000	95,360,000	
北陸電力 第330回	100,000,000	98,336,000	
東北電力 第475回	100,000,000	101,358,000	
東北電力 第481回	200,000,000	203,238,000	
東北電力 第484回	100,000,000	97,579,000	
東北電力 第491回	100,000,000	99,794,000	
東北電力 第508回	100,000,000	99,014,000	
東北電力 第521回	300,000,000	295,002,000	
東北電力 第529回	200,000,000	197,762,000	
四国電力 第281回	100,000,000	101,260,000	
九州電力 第424回	100,000,000	101,511,000	
九州電力 第428回	105,000,000	106,570,800	
九州電力 第449回	200,000,000	199,462,000	
九州電力 第451回	100,000,000	99,790,000	
九州電力 第476回	100,000,000	98,672,000	
九州電力 第478回	100,000,000	94,065,000	
九州電力 第481回	300,000,000	293,466,000	
九州電力 第484回	200,000,000	195,688,000	
九州電力 第493回	300,000,000	296,748,000	
北海道電力 第321回	100,000,000	101,611,000	
北海道電力 第323回	100,000,000	104,919,000	
北海道電力 第338回	100,000,000	98,178,000	
北海道電力 第345回	300,000,000	300,201,000	
	100,000,000	101,356,000	

	電源開発 第40回社債間限定同順位特約付			
	電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,195,000	
	電源開発 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,621,000	
	電源開発 第59回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,025,000	
	電源開発 第73回社債間限定同順位特約付	200,000,000	193,550,000	
	東京電力パワーグリッド 第6回	100,000,000	100,317,000	
	東京電力パワーグリッド 第11回	300,000,000	299,103,000	
	東京電力パワーグリッド 第14回	100,000,000	100,102,000	
	東京電力パワーグリッド 第15回	300,000,000	297,201,000	
	東京電力パワーグリッド 第28回	100,000,000	100,356,000	
	東京電力パワーグリッド 第35回	100,000,000	101,415,000	
	東京電力パワーグリッド 第38回	400,000,000	400,392,000	
	東京電力パワーグリッド 第40回	400,000,000	404,596,000	
	東京電力パワーグリッド 第45回	300,000,000	294,666,000	
	J E R A 第3回無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,644,000	
	東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,261,000	
	東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付	100,000,000	88,827,000	
	大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	83,642,000	
	大阪瓦斯 第43回社債間限定同順位特約付	200,000,000	174,330,000	
	北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,065,000	
	北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,120,000	
	広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,795,000	
	東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,952,000	
	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	99,851,000	
	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	97,263,000	
	ソフトバンクグループ 第54回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,062,000	
小計	銘柄数：274 組入時価比率：4.9%	41,705,000,000	41,608,470,800	5.0%
合計			41,608,470,800	
合計			839,898,835,404	

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

（2022年 6月22日現在）

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	320,721,385
コール・ローン	771,586,629
国債証券	655,728,813,006
派生商品評価勘定	7,483,393
未収利息	5,996,596,311
前払費用	377,836,860
その他未収収益	17,255,039
流動資産合計	663,220,292,623
<b>資産合計</b>	<b>663,220,292,623</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	777,488,736
未払解約金	59,250,924
未払利息	566
その他未払費用	6,715,399
流動負債合計	843,455,625
<b>負債合計</b>	<b>843,455,625</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	255,932,987,186
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	406,443,849,812
元本等合計	662,376,836,998
純資産合計	662,376,836,998
<b>負債純資産合計</b>	<b>663,220,292,623</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</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	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 6月22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	2.5881円
(10,000口当たり純資産額)	(25,881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	250,009,771,206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	263,867,871,756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 6月23日 至 2022年 6月22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 6月22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 6月22日現在

	2021年 6月23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	232,190,413,709円
同期中における追加設定元本額	46,476,201,452円
同期中における一部解約元本額	22,733,627,975円
期末元本額	255,932,987,186円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	80,479,591円
バランスセレクト50	81,588,482円
バランスセレクト70	80,238,349円
野村外国債券インデックスファンド	267,083,236円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,601,465,242円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	23,265,012,664円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,957,987,105円
野村資産設計ファンド2015	18,452,828円
野村資産設計ファンド2020	19,565,219円
野村資産設計ファンド2025	34,685,370円
野村資産設計ファンド2030	41,381,585円
野村資産設計ファンド2035	30,271,727円
野村資産設計ファンド2040	51,583,553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）	74,682,743,350円
のむらップ・ファンド（保守型）	6,554,573,831円
のむらップ・ファンド（普通型）	22,232,064,520円
のむらップ・ファンド（積極型）	6,053,537,528円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	516,833,698円
野村資産設計ファンド2045	8,906,987円
野村インデックスファンド・外国債券	930,265,313円
マイ・ロード	8,798,780,326円
ネクストコア	113,946,958円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	298,883,287円

野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	8,603,798,799円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,431,020,032円
野村資産設計ファンド2050	8,544,755円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,121,343円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,336,249円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,503,098円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,198,602円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	857,013,952円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	953,187,690円
インデックス・ブレンド(タイプ )	4,364,424円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,582,877円
インデックス・ブレンド(タイプ )	12,822,108円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,751,755円
インデックス・ブレンド(タイプ )	13,104,121円
野村6資産均等バランス	2,442,757,098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)	6,974,739,473円
世界6資産分散ファンド	67,106,430円
野村資産設計ファンド2060	4,296,446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	10,416,120,045円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	6,808,817,644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)	6,252,646円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,072,313,540円
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	177,921,654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)	1,117,698,803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)	535,672,938円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	2,421,632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)	8,013,517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)	231,310円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,826,705,017円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	7,176,401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)	31,992,535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)	7,848,950円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	165,534,961円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	151,925,410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)	1,897,074,596円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	70,763,905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)	828,285,476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)	759,415,507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)	5,795,842円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,462,137円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,735,937円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	6,167,354円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	598,980,601円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,318,819,006円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	6,721,171,987円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	5,217,401,933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)	21,061,809,791円
マイバランスDC30	2,032,013,301円
マイバランスDC50	1,568,524,144円
マイバランスDC70	1,137,280,154円
野村DC外国債券インデックスファンド	8,434,005,719円
野村DC運用戦略ファンド	3,635,940,865円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	447,168,641円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	283,838,013円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	544,329,192円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	258,057,072円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	20,675,428円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	47,676,905円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	22,438,581円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	12,934,469円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	9,188,632円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	4,690,371円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	172,823,056円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	110,706,307円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	59,164,671円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	82,473,477円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	2,176,513円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	23,106,852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)	55,812,734円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	26,752,282円
野村DCバランスファンド(年金運用戦略タイプ)	98,731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6月22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6月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	36,400,000.00	37,770,685.68	
		US TREASURY BOND	56,700,000.00	55,678,952.07	
		US TREASURY BOND	66,600,000.00	72,505,541.88	
		US TREASURY BOND	15,000,000.00	16,980,468.00	
		US TREASURY BOND	129,400,000.00	143,168,962.28	



US TREASURY BOND	100,000.00	112,636.71	
US TREASURY BOND	2,300,000.00	2,028,132.64	
US TREASURY BOND	1,200,000.00	1,215,562.44	
US TREASURY N/B	21,200,000.00	20,942,451.80	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,880,663.32	
US TREASURY N/B	200,000.00	194,765.62	
US TREASURY N/B	800,000.00	787,156.24	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,636.71	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,132.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,984.37	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,216,351.24	
US TREASURY N/B	38,000,000.00	37,881,250.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,882.81	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,461,406.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,726.56	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,687,960.12	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	996,953.10	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,449,140.55	
US TREASURY N/B	200,000.00	192,914.06	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	34,447,874.56	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	997,265.60	
US TREASURY N/B	300,000.00	289,429.68	
US TREASURY N/B	200,000.00	192,312.50	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,390,483.58	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	996,679.60	
US TREASURY N/B	300,000.00	289,136.70	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	42,390,327.06	
US TREASURY N/B	300,000.00	288,421.86	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,069,905.56	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	29,196,989.99	
US TREASURY N/B	200,000.00	192,585.92	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,679.68	
US TREASURY N/B	45,900,000.00	45,277,839.27	
US TREASURY N/B	800,000.00	793,812.48	
US TREASURY N/B	200,000.00	192,921.86	

US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,431,445.20	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,888,124.80	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,276,968.44	
US TREASURY N/B	200,000.00	192,859.36	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,788,117.12	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,617,855.32	
US TREASURY N/B	500,000.00	491,542.95	
US TREASURY N/B	400,000.00	394,890.60	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,269.53	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,082.03	
US TREASURY N/B	44,800,000.00	43,988,000.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,355.46	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,050.78	
US TREASURY N/B	500,000.00	489,375.00	
US TREASURY N/B	700,000.00	688,187.50	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,678,550.76	
US TREASURY N/B	72,000,000.00	71,055,000.00	
US TREASURY N/B	13,900,000.00	13,146,902.17	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,362,327.86	
US TREASURY N/B	300,000.00	296,097.63	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,320.31	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,285,156.25	
US TREASURY N/B	500,000.00	485,546.85	
US TREASURY N/B	300,000.00	282,984.36	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,715,984.28	
US TREASURY N/B	500,000.00	484,843.75	
US TREASURY N/B	200,000.00	188,179.68	
US TREASURY N/B	300,000.00	291,492.18	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,053,937.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,828.12	
US TREASURY N/B	43,600,000.00	42,588,340.48	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,057,460.91	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,179.68	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,347,312.32	
US TREASURY N/B	500,000.00	479,960.90	

US TREASURY N/B	57,850,000.00	56,448,942.42	
US TREASURY N/B	200,000.00	188,281.24	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,239,804.63	
US TREASURY N/B	500,000.00	479,023.40	
US TREASURY N/B	200,000.00	189,031.24	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,853,242.14	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,210.93	
US TREASURY N/B	200,000.00	189,281.24	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	979,843.70	
US TREASURY N/B	300,000.00	285,515.61	
US TREASURY N/B	25,100,000.00	24,250,912.18	
US TREASURY N/B	200,000.00	190,625.00	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,872,687.50	
US TREASURY N/B	17,300,000.00	16,322,819.88	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,882.81	
US TREASURY N/B	27,700,000.00	27,195,771.36	
US TREASURY N/B	100,000.00	92,445.31	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,042.96	
US TREASURY N/B	46,700,000.00	46,065,169.54	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,898.43	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	7,775,796.87	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	986,640.60	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,593.74	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,947,031.10	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,125.00	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,124,437.24	
US TREASURY N/B	200,000.00	181,562.50	
US TREASURY N/B	33,450,000.00	32,078,024.83	
US TREASURY N/B	700,000.00	686,929.67	
US TREASURY N/B	200,000.00	181,046.86	
US TREASURY N/B	35,700,000.00	35,290,006.92	
US TREASURY N/B	200,000.00	180,531.24	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,796.87	
US TREASURY N/B	200,000.00	180,015.62	
US TREASURY N/B	50,100,000.00	48,254,516.40	

US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,832,031.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	180,343.74	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,745,703.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	179,953.12	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	16,166,193.86	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,742.18	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,877,578.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	968,593.70	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,929.68	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,796,484.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	181,210.92	
US TREASURY N/B	42,300,000.00	40,741,837.20	
US TREASURY N/B	300,000.00	271,253.88	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,681,171.74	
US TREASURY N/B	300,000.00	285,843.75	
US TREASURY N/B	300,000.00	270,609.36	
US TREASURY N/B	800,000.00	754,218.72	
US TREASURY N/B	300,000.00	271,464.84	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	6,779,530.80	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,363.28	
US TREASURY N/B	41,900,000.00	38,786,959.89	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,044,687.20	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,667.96	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	13,475,937.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	269,824.20	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,194,218.40	
US TREASURY N/B	300,000.00	272,343.75	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	13,473,281.25	
US TREASURY N/B	81,000,000.00	75,086,360.10	
US TREASURY N/B	500,000.00	455,820.30	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,136.71	
US TREASURY N/B	200,000.00	181,992.18	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,843.74	
US TREASURY N/B	36,950,000.00	35,095,279.97	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,262,953.02	

US TREASURY N/B	100,000.00	93,449.21	
US TREASURY N/B	300,000.00	263,496.09	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,085.93	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	14,800,625.00	
US TREASURY N/B	35,000,000.00	33,996,483.50	
US TREASURY N/B	67,500,000.00	64,333,298.25	
US TREASURY N/B	700,000.00	607,988.22	
US TREASURY N/B	300,000.00	260,027.34	
US TREASURY N/B	100,000.00	85,929.68	
US TREASURY N/B	12,600,000.00	11,908,968.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	86,246.09	
US TREASURY N/B	100,000.00	85,496.09	
US TREASURY N/B	300,000.00	257,472.63	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	942,656.20	
US TREASURY N/B	300,000.00	258,445.29	
US TREASURY N/B	500,000.00	429,960.90	
US TREASURY N/B	500,000.00	432,109.35	
US TREASURY N/B	27,700,000.00	26,756,468.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,296.87	
US TREASURY N/B	500,000.00	443,945.30	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,601.56	
US TREASURY N/B	53,600,000.00	52,071,558.48	
US TREASURY N/B	500,000.00	442,265.60	
US TREASURY N/B	500,000.00	441,523.40	
US TREASURY N/B	100,000.00	86,812.50	
US TREASURY N/B	12,200,000.00	11,829,233.46	
US TREASURY N/B	100,000.00	87,296.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	87,859.37	
US TREASURY N/B	300,000.00	265,289.04	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,179,843.72	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,007.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,328.12	
US TREASURY N/B	200,000.00	180,703.12	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,049,554.66	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,105,468.00	

US TREASURY N/B	100,000.00	93,828.12	
US TREASURY N/B	21,700,000.00	20,350,531.25	
US TREASURY N/B	300,000.00	267,093.75	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,884,585.78	
US TREASURY N/B	600,000.00	493,500.00	
US TREASURY N/B	11,700,000.00	10,264,007.52	
US TREASURY N/B	48,100,000.00	57,768,850.36	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	13,499,171.46	
US TREASURY N/B	100,000.00	80,812.50	
US TREASURY N/B	150,900,000.00	173,959,406.25	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	837,343.70	
US TREASURY N/B	100,000.00	87,062.50	
US TREASURY N/B	16,300,000.00	13,666,531.25	
US TREASURY N/B	28,900,000.00	24,395,663.34	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	882,148.40	
US TREASURY N/B	20,350,000.00	23,241,924.25	
US TREASURY N/B	8,650,000.00	10,364,456.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	114,062.50	
US TREASURY N/B	500,000.00	504,843.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	110,492.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	113,820.31	
US TREASURY N/B	100,000.00	111,781.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	115,242.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	111,632.81	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,275,226.42	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,273.43	
US TREASURY N/B	100,000.00	66,578.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	109,425.78	
US TREASURY N/B	100,000.00	69,460.93	
US TREASURY N/B	300,000.00	349,664.04	
US TREASURY N/B	200,000.00	151,640.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	110,804.68	
US TREASURY N/B	200,000.00	161,218.74	
US TREASURY N/B	100,000.00	101,781.25	
US TREASURY N/B	200,000.00	146,953.12	

US TREASURY N/B	100,000.00	92,867.18	
US TREASURY N/B	200,000.00	153,546.86	
US TREASURY N/B	100,000.00	92,679.68	
US TREASURY N/B	200,000.00	163,921.86	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,730.46	
US TREASURY N/B	500,000.00	472,578.10	
US TREASURY N/B	200,000.00	173,500.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	86,554.68	
US TREASURY N/B	290,000.00	266,686.69	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,296.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,304.68	
US TREASURY N/B	20,500,000.00	19,572,694.80	
US TREASURY N/B	39,950,000.00	36,544,885.72	
US TREASURY N/B	45,700,000.00	40,901,500.00	
US TREASURY N/B	43,700,000.00	35,731,575.94	
US TREASURY N/B	24,400,000.00	21,841,811.28	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	15,328,906.25	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	2,870,249.92	
US TREASURY N/B	49,700,000.00	40,559,856.89	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	23,011,639.92	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	26,761,756.95	
US TREASURY N/B	14,200,000.00	12,470,484.02	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,799,062.40	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,529,468.75	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	9,794,202.84	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	8,005,265.16	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	8,604,179.45	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	4,743,000.00	
US TREASURY N/B	10,500,000.00	9,533,671.35	
US TREASURY N/B	6,100,000.00	5,965,132.66	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,259,856.84	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,468.75	
US TREASURY N/B	11,250,000.00	8,828,613.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	242,296.86	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	739,218.70	

小計	US TREASURY N/B	10,200,000.00	6,165,421.62	
	US TREASURY N/B	9,100,000.00	5,692,475.88	
	US TREASURY N/B	7,900,000.00	5,291,148.24	
	US TREASURY N/B	20,300,000.00	14,506,568.79	
	US TREASURY N/B	60,050,000.00	48,387,161.06	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	737,656.20	
	US TREASURY N/B	100,000.00	71,562.50	
	US TREASURY N/B	100,000.00	78,589.84	
	US TREASURY N/B	100,000.00	90,398.43	
	銘柄数：259	2,535,210,000.00	2,451,059,425.10 (334,545,100,931)	
組入時価比率：50.5%		51.0%		
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	2,280,000.00	2,244,986.04	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,070,000.00	3,025,736.74	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	491,603.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,075,589.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	34,400,000.00	32,563,659.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,588,193.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	312,347.35	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	279,525.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	11,600,000.00	10,520,608.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	178,367.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	739,112.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	14,730,000.00	16,805,457.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	926,098.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,800,000.00	4,062,859.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	84,019.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	87,446.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	16,900,000.00	20,270,164.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	2,221,242.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,174,998.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	9,989,302.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,147,018.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,600,000.00	7,857,472.60	
CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	769,608.00		



小計	銘柄数：23  組入時価比率：2.0%	128,780,000.00	127,415,415.23  (13,430,858,919)  2.0%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	114,500,000.00	110,834,855.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	65,000,000.00	65,507,357.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	110,000,000.00	96,951,305.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	110,800,000.00	102,723,821.24	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	77,300,000.00	74,387,583.36	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	85,600,000.00	78,142,956.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	400,000.00	357,564.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	56,801,820.66	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	38,800,000.00	36,505,705.56	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,200,000.00	59,191,462.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	38,019,228.30	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	64,800,000.00	63,382,940.64	
	小計	銘柄数：12  組入時価比率：0.8%	831,700,000.00	782,806,599.26  (5,295,451,802)  0.8%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,800,000.00	1,829,514.24	
	BELGIUM KINGDOM	1,900,000.00	1,885,180.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,109,600.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	981,652.50	
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,664,505.70	
	BELGIUM KINGDOM	7,800,000.00	8,633,601.60	
	BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,216,013.02	
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	1,904,222.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	937,876.00	
	BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	6,026,098.00	
	BELGIUM KINGDOM	11,400,000.00	10,262,736.00	
	BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,102,556.50	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	89,610.00	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	425,633.00	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	90,042.20	
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,221,679.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,600,476.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	4,018,835.60	

BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	2,085,345.00	
BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	2,674,153.00	
BELGIUM KINGDOM	2,200,000.00	1,797,978.60	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	13,819,435.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	10,500,000.00	13,331,959.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	198,960.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	5,533,230.74	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	16,050,000.00	16,946,585.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,600,000.00	14,184,528.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,700,000.00	5,864,513.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,100,000.00	2,090,970.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	19,100,000.00	20,725,601.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,600,000.00	6,663,300.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	2,995,320.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,650,000.00	39,958,068.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	775,326.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	97,015.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	93,170.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,800,000.00	9,415,350.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,800,000.00	2,663,459.68	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	4,733,250.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,500,000.00	16,846,825.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	93,941.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	89,010.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	2,865,531.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	5,157,000.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	873,680.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,900,000.00	2,367,006.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	5,133,167.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,000,000.00	14,409,505.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	3,004,544.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,500,000.00	9,397,809.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,200,000.00	5,077,176.00	
BUNDESobligation	2,600,000.00	2,527,304.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,625,985.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,723,307.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,100,000.00	6,152,460.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000.00	7,673,897.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,646,945.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	8,112,096.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,400,000.00	19,749,648.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	941,660.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	660,996.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	24,995,076.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	189,508.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,300,000.00	23,422,287.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	564,786.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,700,000.00	12,636,379.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,300,000.00	22,911,774.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	22,950,000.00	29,856,802.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,800,000.00	23,369,299.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,250,000.00	19,188,846.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,700,000.00	4,910,447.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,800,000.00	3,966,796.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,130,000.00	1,372,310.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,730,961.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,700,000.00	13,016,484.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	22,700,000.00	19,517,914.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	520,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,013,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	99,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,700,000.00	21,721,811.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	25,000,000.00	26,207,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	300,579.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,196,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,600,000.00	6,854,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,630,910.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,009,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	95,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	32,600,000.00	35,031,960.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	781,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,379,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	394,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	96,140.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,750,000.00	15,798,825.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,955,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	93,046.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,600,000.00	19,929,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	96,430.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	1,962,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	26,600,000.00	31,688,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	94,170.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	92,020.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	194,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	192,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	33,800,000.00	39,944,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	190,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,300,000.00	15,628,470.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	98,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	98,590.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	36,200,000.00	41,079,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	867,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,600,000.00	23,329,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	758,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	77,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	13,763,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,240,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	22,300,000.00	25,002,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,000,000.00	13,414,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,800,000.00	7,010,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	451,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	5,180,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	181,820.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	13,170,420.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	10,019,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,023,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	2,638,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	7,757,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,900,000.00	6,009,530.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,100,000.00	3,160,870.40	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	396,755.20	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	712,558.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	3,871,800.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	97,978.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	1,916,304.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	3,457,627.80	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,154,211.20	
FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,156,755.60	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	174,402.00	
FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	2,922,928.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	403,963.60	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	399,875.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,968,997.20	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	98,205.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,200,000.00	6,327,949.40	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,728,291.60	
FRANCE (GOVT OF)	13,000,000.00	12,626,484.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,719,019.80	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	12,443,626.30	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	7,690,192.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,900,000.00	6,450,492.60	
FRANCE (GOVT OF)	15,100,000.00	13,980,766.86	
FRANCE (GOVT OF)	3,300,000.00	2,983,061.40	
FRANCE (GOVT OF)	11,400,000.00	11,777,860.98	
FRANCE (GOVT OF)	15,000,000.00	13,110,735.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	84,870.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	88,839.30	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	9,222,000.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,517,032.00	

FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	295,190.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,100,000.00	1,151,381.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,700,000.00	5,754,443.55	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	10,874,997.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	5,878,800.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	282,561.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,400,000.00	36,763,280.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,700,000.00	7,000,830.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	32,200,000.00	39,606,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,100,000.00	12,539,320.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,650,000.00	32,390,445.10	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,800,000.00	42,496,740.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	356,817.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,850,000.00	8,629,915.64	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,450,000.00	26,565,169.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,850,000.00	8,529,962.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,040,000.00	17,743,035.96	
IRISH GOVERNMENT	6,130,000.00	6,786,817.24	
IRISH GOVERNMENT	6,900,000.00	6,492,306.60	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	563,472.00	
IRISH TSY 1.3% 2033	5,100,000.00	4,541,856.00	
IRISH TSY 1.35% 2031	3,300,000.00	3,075,778.20	
IRISH TSY 1.5% 2050	2,600,000.00	1,957,238.40	
IRISH TSY 1.7% 2037	3,100,000.00	2,781,776.94	
IRISH TSY 1% 2026	9,800,000.00	9,581,616.80	
IRISH TSY 2.4% 2030	7,500,000.00	7,689,637.50	
IRISH TSY 2% 2045	1,600,000.00	1,412,755.20	
IRISH TSY 3.4% 2024	12,800,000.00	13,317,230.08	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	404,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	98,464.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,300,000.00	3,353,895.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,446,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	1,818,585.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,382,500.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	14,703,420.00	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	939,400.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	715,680.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	11,750,000.00	12,202,375.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,700,000.00	5,751,864.70	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	373,293.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3,600,000.00	4,418,859.60	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	9,600,000.00	10,594,752.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	622,416.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	496,215.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	152,004.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,268,280.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	707,461.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,900,000.00	1,881,866.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6,900,000.00	7,703,850.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,919,778.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	9,258,646.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	11,600,000.00	10,485,820.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	8,600,000.00	8,642,389.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	481,908.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	4,862,532.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,000,000.00	5,677,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,271,418.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	1,207,427.10	
	SPANISH GOVERNMENT	29,800,000.00	36,464,770.00	
	SPANISH GOVERNMENT	27,900,000.00	35,215,380.00	
	SPANISH GOVERNMENT	6,800,000.00	7,725,730.24	
小計	銘柄数：219	1,465,800,000.00	1,594,849,748.68 (228,797,144,945)	
	組入時価比率：34.5%		34.9%	
英ポンド	UK TREASURY	1,350,000.00	1,328,504.62	
	UK TREASURY	2,800,000.00	2,796,662.40	
	UK TREASURY	300,000.00	289,425.00	
	UK TREASURY	2,200,000.00	2,149,410.12	
	UK TREASURY	4,550,000.00	4,585,490.00	
	UK TREASURY	15,070,000.00	16,092,472.37	

	UK TREASURY	200,000.00	190,550.00
	UK TREASURY	600,000.00	593,556.00
	UK TREASURY	6,910,000.00	6,689,904.06
	UK TREASURY	500,000.00	458,888.50
	UK TREASURY	400,000.00	379,680.00
	UK TREASURY	14,150,000.00	15,489,634.27
	UK TREASURY	200,000.00	191,457.36
	UK TREASURY	6,650,000.00	8,071,543.90
	UK TREASURY	200,000.00	176,117.78
	UK TREASURY	200,000.00	179,154.00
	UK TREASURY	6,650,000.00	7,800,817.08
	UK TREASURY	9,610,000.00	10,964,529.50
	UK TREASURY	17,350,000.00	20,438,702.52
	UK TREASURY	750,000.00	567,967.50
	UK TREASURY	4,330,000.00	5,018,296.80
	UK TREASURY	100,000.00	124,613.38
	UK TREASURY	350,000.00	414,456.00
	UK TREASURY	500,000.00	595,821.60
	UK TREASURY	320,000.00	398,016.44
	UK TREASURY	18,440,000.00	20,198,080.66
	UK TREASURY	5,900,000.00	7,282,667.36
	UK TREASURY	8,200,000.00	6,178,652.44
	UK TREASURY	16,100,000.00	12,764,627.40
	UK TREASURY	5,350,000.00	6,725,406.89
	UK TREASURY	1,100,000.00	754,248.00
	UK TREASURY	6,750,000.00	7,984,035.00
	UK TREASURY	1,300,000.00	973,556.48
	UK TREASURY	700,000.00	537,474.00
	UK TREASURY	8,950,000.00	11,532,522.50
	UK TREASURY	100,000.00	94,622.80
	UK TREASURY	200,000.00	240,767.00
	UK TSY 3 1/4% 2044	6,800,000.00	7,155,319.04
	UNITED KINGDOM(GOVERNMEN	6,400,000.00	8,385,408.00
小計	銘柄数：39	182,530,000.00	196,793,058.77 (32,888,055,981)



		組入時価比率：5.0%		5.0%
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT		9,200,000.00	9,156,909.04
	SWEDISH GOVERNMENT		36,350,000.00	36,608,085.00
	SWEDISH GOVERNMENT		16,000,000.00	15,246,672.00
	SWEDISH GOVERNMENT		17,300,000.00	16,033,951.40
	SWEDISH GOVERNMENT		18,900,000.00	17,299,600.92
	SWEDISH GOVERNMENT		13,100,000.00	11,203,395.10
	SWEDISH GOVERNMENT		21,300,000.00	26,124,343.50
小計	銘柄数：7		132,150,000.00	131,672,956.96 (1,769,684,541)
		組入時価比率：0.3%		0.3%
ノルウェークロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT		22,800,000.00	22,854,382.56
	NORWEGIAN GOVERNMENT		12,500,000.00	12,052,100.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT		7,100,000.00	6,689,137.20
	NORWEGIAN GOVERNMENT		10,200,000.00	9,594,630.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT		9,400,000.00	8,832,240.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT		28,000,000.00	25,248,916.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT		7,400,000.00	6,387,643.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT		7,000,000.00	6,285,300.00
小計	銘柄数：8		104,400,000.00	97,944,348.76 (1,352,611,456)
		組入時価比率：0.2%		0.2%
デンマーククロー ネ	KINGDOM OF DENMARK		870,000.00	876,494.55
	KINGDOM OF DENMARK		22,200,000.00	22,271,040.00
	KINGDOM OF DENMARK		18,400,000.00	17,091,921.92
	KINGDOM OF DENMARK		37,250,000.00	33,372,275.00
	KINGDOM OF DENMARK		40,200,000.00	52,640,111.10
	KINGDOM OF DENMARK		3,500,000.00	1,952,982.50
	小計	銘柄数：6		122,420,000.00
		組入時価比率：0.4%		0.4%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND		38,800,000.00	34,326,360.00
	POLAND GOVERNMENT BOND		4,000,000.00	3,313,200.00
	POLAND GOVERNMENT BOND		60,000,000.00	46,233,000.00
	POLAND GOVERNMENT BOND		2,600,000.00	1,903,200.00
	POLAND GOVERNMENT BOND		3,100,000.00	1,915,180.00

小計	銘柄数：5	108,500,000.00	87,690,940.00 (2,713,929,363)
	組入時価比率：0.4%		0.4%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,480,075.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	7,637,545.30
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,080,000.00	17,414,433.23
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,526,574.47
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,137,225.96
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	280,619.91
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,687,656.16
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	9,310,180.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	22,200,000.00	19,965,823.08
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	4,467,181.20
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	2,670,974.79
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	228,690.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	463,494.42
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,526,885.79
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,500,000.00	10,875,930.45
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,450,000.00	2,103,086.37
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,250,000.00	7,845,945.52
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	614,880.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,208,886.60
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,900,000.00	3,938,130.00
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	1,756,800.00	
小計	銘柄数：21	112,280,000.00	104,141,018.25 (9,863,195,838)
	組入時価比率：1.5%		1.5%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,308,287.13
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,438,378.25
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,312,880.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,086,030.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,358,700.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	465,650.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	5,850,000.00	5,983,438.50
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	489,900.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	296,100.00

小計	SINGAPORE GOVERNMENT	3,850,000.00	3,782,625.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,980,000.00	3,044,070.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,920,000.00	1,722,316.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,750,000.00	2,586,058.75	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	1,774,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	1,638,000.00	
	銘柄数：15	31,200,000.00	30,287,034.43	(2,979,941,317)
組入時価比率：0.4%			0.5%	
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	405,070.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,610,915.32	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,700,000.00	2,485,447.74	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	401,747.36	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,225,816.34	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,896,571.74	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,416,929.12	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	16,600,000.00	16,904,160.14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,573,375.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,826,700.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,140,257.24	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	272,735.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,400,000.00	15,580,977.72	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,344,226.64	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	9,221,110.08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	11,100,000.00	10,684,693.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	9,758,416.31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,500,000.00	10,211,362.35	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	297,683.70	
	小計	銘柄数：19	109,380,000.00	108,258,196.00
組入時価比率：0.5%			0.5%	
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	141,900,000.00	142,417,977.57	
	CHINA GOVERNMENT BOND	100,100,000.00	99,834,234.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	89,500,000.00	89,881,717.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	32,682,375.00	

	CHINA GOVERNMENT BOND	40,000,000.00	39,801,400.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	70,000,000.00	70,892,864.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	40,000,000.00	40,027,600.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	33,419,595.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,077,002.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	19,868,600.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	9,979,450.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	16,048,800.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	36,000,000.00	37,400,220.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,000,000.00	18,191,520.00	
小計	銘柄数：14	666,500,000.00	670,523,355.57 (13,679,883,395)	
	組入時価比率：2.1%		2.1%	
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	4,968,582.00	
	ISRAEL FIXED BOND	6,200,000.00	6,346,770.12	
	ISRAEL FIXED BOND	11,900,000.00	11,548,428.78	
	ISRAEL FIXED BOND	6,500,000.00	7,403,054.75	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	4,813,260.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	4,814,822.00	
	ISRAEL FIXED BOND	8,500,000.00	7,344,221.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,900,000.00	4,620,855.81	
	ISRAEL FIXED BOND	6,000,000.00	7,690,816.20	
	ISRAEL FIXED BOND	5,700,000.00	5,793,323.82	
小計	銘柄数：10	65,700,000.00	65,344,134.98 (2,581,367,777)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
合計			655,728,813,006 (655,728,813,006)	

(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 6月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	170,000	

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	5,500,000
US TREASURY N/B	19,000,000
US TREASURY N/B	10,700,000
US TREASURY N/B	19,000,000
US TREASURY N/B	33,000,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	4,575,000
US TREASURY N/B	12,000,000
US TREASURY N/B	4,200,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY BOND	1,020,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	16,071,000
US TREASURY BOND	43,000,000
US TREASURY BOND	50,000,000
US TREASURY BOND	13,000,000
US TREASURY N/B	18,300,000
US TREASURY N/B	15,000,000
US TREASURY N/B	26,000,000
US TREASURY N/B	27,000,000
US TREASURY N/B	35,500,000
US TREASURY BOND	50,000,000
US TREASURY BOND	5,000,000
US TREASURY BOND	11,000,000
US TREASURY BOND	30,000,000
US TREASURY N/B	11,000,000
US TREASURY N/B	23,000,000
US TREASURY N/B	255,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	255,000
US TREASURY N/B	13,298,000
US TREASURY N/B	255,000
US TREASURY N/B	170,000
US TREASURY N/B	655,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	425,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	935,000
US TREASURY N/B	29,000,000
US TREASURY N/B	9,000,000
US TREASURY N/B	8,400,000
US TREASURY N/B	19,000,000

US TREASURY N/B	425,000	
US TREASURY N/B	5,000,000	
US TREASURY N/B	50,000,000	
US TREASURY N/B	12,000,000	
US TREASURY N/B	18,000,000	
US TREASURY N/B	85,000	
US TREASURY N/B	19,000,000	
US TREASURY N/B	12,750,000	
US TREASURY N/B	11,050,000	
US TREASURY N/B	5,000,000	
US TREASURY N/B	5,950,000	
US TREASURY N/B	5,000,000	
US TREASURY N/B	37,000,000	
US TREASURY N/B	30,000,000	
US TREASURY N/B	1,445,000	
US TREASURY N/B	7,395,000	
US TREASURY N/B	24,500,000	
US TREASURY N/B	5,000,000	
US TREASURY N/B	5,821,000	
US TREASURY N/B	37,000,000	
US TREASURY N/B	41,000,000	
US TREASURY N/B	35,000,000	
US TREASURY N/B	2,000,000	
US TREASURY N/B	1,000,000	
US TREASURY BOND	17,000,000	
US TREASURY BOND	30,618,000	
US TREASURY N/B	22,500,000	
US TREASURY N/B	30,000,000	
US TREASURY N/B	17,000,000	
US TREASURY N/B	340,000	
US TREASURY N/B	25,000,000	
US TREASURY N/B	7,500,000	
US TREASURY N/B	24,000,000	
US TREASURY N/B	37,000,000	
US TREASURY N/B	12,750,000	
US TREASURY N/B	22,000,000	
US TREASURY N/B	578,000	
US TREASURY N/B	23,000,000	
US TREASURY N/B	36,000,000	
US TREASURY N/B	850,000	
US TREASURY N/B	31,000,000	
US TREASURY N/B	7,735,000	
US TREASURY N/B	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	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,600,000

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,900,000
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,000,000
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,500,000
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	500,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	102,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	351,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	176,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	759,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	153,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	529,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	579,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	500,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	151,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	179,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	794,000
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	550,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	365,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	219,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	250,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	407,000
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	7,200,000
	ISRAEL FIXED BOND	800,000
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	3,400,000
ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,295,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,100,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,240,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000
	BUNDESREBLIGATION	1,700,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	595,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,450,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,160,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,930,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,375,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,410,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,900,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,235,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,000,000
	FRANCE (GOVT OF)	1,700,000
	FRANCE (GOVT OF)	8,058,000

	FRANCE (GOVT OF)	5,800,000
	FRANCE (GOVT OF)	2,000,000
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000
	BELGIUM KINGDOM	850,000
	BELGIUM KINGDOM GOVT	9,770,000
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,610,000
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,500,000
	SPANISH GOVERNMENT	1,845,000
	SPANISH GOVERNMENT	20,000,000
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,310,000
	FINNISH GOVERNMENT	1,700,000
	IRISH TSY 1% 2026	6,375,000
	IRISH TSY 2.4% 2030	6,000,000
	BUONI POLIENNALI DEL TES	15,800,000

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年 6月22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	646,539,907	-	654,023,300	7,483,393
米ドル	296,705,602	-	300,255,600	3,549,998
ユーロ	283,906,665	-	286,922,500	3,015,835
英ポンド	65,927,640	-	66,845,200	917,560
合計	646,539,907	-	654,023,300	7,483,393

## (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 6月22日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	70,083,772
コール・ローン	6,464,759
国債証券	6,947,386,521
未収利息	91,191,530
前払費用	14,240,685
流動資産合計	7,129,367,267
<b>資産合計</b>	<b>7,129,367,267</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受収益	4,777
未払解約金	1,626,842
未払利息	4
その他未払費用	517,800
流動負債合計	2,149,423
<b>負債合計</b>	<b>2,149,423</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	4,999,082,708
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,128,135,136
元本等合計	7,127,217,844
純資産合計	7,127,217,844
<b>負債純資産合計</b>	<b>7,129,367,267</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	国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価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 6月22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	1.4257円
(10,000口当たり純資産額)	(14,257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 6月23日 至 2022年 6月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>    市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>    信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>    流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 6月22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     （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 6月22日現在	
期首	2021年 6月23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	6,612,609,282円
同期中における追加設定元本額	1,336,890,871円
同期中における一部解約元本額	2,950,417,445円
期末元本額	4,999,082,708円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	18,971,562円
野村資産設計ファンド2020	20,116,267円
野村資産設計ファンド2025	35,222,037円
野村資産設計ファンド2030	41,329,171円
野村資産設計ファンド2035	30,233,242円
野村資産設計ファンド2040	51,518,124円
野村資産設計ファンド2045	8,896,343円
野村インデックスファンド・新興国債券	730,432,765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	546,005,859円
野村資産設計ファンド2050	8,553,771円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	4,183,026円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	2,332,746円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,500,845円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,196,805円
世界6資産分散ファンド	122,591,485円
野村資産設計ファンド2060	4,417,454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)	2,719,330,451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)	882,905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)	70,358,373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	425,973,436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(D C・つみたてN I S A)2030	12,917,930円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2040	9,176,890円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2050	4,694,896円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2060	2,237,815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6月22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6月22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	6,400,000.00	6,293,760.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,800,000.00	5,614,342.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,100,000.00	14,210,057.55	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	17,500,000.00	15,424,071.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	4,258,100.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	1,650,000.00	1,529,731.99	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,800,000.00	10,393,090.56	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	13,300,000.00	12,141,370.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,200,000.00	3,754,422.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	2,877,390.54	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	1,600,000.00	1,505,389.92	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,700,000.00	7,550,817.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,600,000.00	9,372,181.86	
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,500,000.00	9,292,252.10	
	小計	銘柄数：14	111,850,000.00	104,216,977.27 (704,996,586)	10.1%
	組入時価比率：9.9%				
レアル	レアル	LETRA TESOURO NACIONAL	6,400,000.00	5,612,988.16	
		LETRA TESOURO NACIONAL	2,300,000.00	1,903,672.28	
		LETRA TESOURO NACIONAL	3,500,000.00	2,737,591.50	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	480,000.00	4,935,359.04	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	481,000.00	4,769,141.45	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	190,000.00	1,827,803.61	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	250,000.00	2,340,478.50	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	160,000.00	1,459,411.04	
	小計	銘柄数：8	13,761,000.00	25,586,445.58 (680,955,104)	9.8%
	組入時価比率：9.6%				
チリペソ	チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	100,000,000.00	97,755,000.00	
		BONOS TESORERIA PESOS	150,000,000.00	136,882,500.00	
		BONOS TESORERIA PESOS	190,000,000.00	180,661,500.00	
		BONOS TESORERIA PESOS	295,000,000.00	267,786,250.00	
		BONOS TESORERIA PESOS	240,000,000.00	214,485,864.00	
		BONOS TESORERIA PESOS	65,000,000.00	63,586,250.00	
	小計	銘柄数：6	1,040,000,000.00	961,157,364.00 (150,030,897)	2.2%
	組入時価比率：2.1%				
コロンビアペソ	コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,790,000,000.00	1,772,475,900.00	
		TITULOS DE TESORERIA	950,000,000.00	937,025,185.00	
		TITULOS DE TESORERIA	490,000,000.00	421,403,479.00	
		TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	698,390,820.00	

小計	TITULOS DE TESORERIA	1,460,000,000.00	1,117,364,718.00
	TITULOS DE TESORERIA	850,000,000.00	666,900,820.00
	TITULOS DE TESORERIA	800,000,000.00	607,487,920.00
	TITULOS DE TESORERIA	400,000,000.00	285,193,760.00
	TITULOS DE TESORERIA	1,850,000,000.00	1,276,666,870.00
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	533,864,880.00
	TITULOS DE TESORERIA	560,000,000.00	342,090,504.00
	銘柄数：11	10,950,000,000.00	8,658,864,856.00 (294,055,050) 4.2%
組入時価比率：4.1%			
ソル	BONOS DE TESORERIA	200,000.00	199,033.64
	BONOS DE TESORERIA	200,000.00	182,971.14
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	530,103.18
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	563,739.61
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	522,061.68
	PERU BONO SOBERANO	700,000.00	733,446.91
	PERU BONO SOBERANO	500,000.00	474,557.50
	PERU BONO SOBERANO	320,000.00	288,990.27
	REPUBLIC OF PERU	1,100,000.00	1,037,787.63
	銘柄数：9	5,020,000.00	4,532,691.56 (166,164,393) 2.4%
組入時価比率：2.3%			
ウルグアイペソ	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	3,638,000.00
	銘柄数：1	4,000,000.00	3,638,000.00 (12,456,512) 0.2%
組入時価比率：0.2%			
セルビアディナール	SERBIA TREASURY BONDS	22,000,000.00	17,596,788.00
	銘柄数：1	22,000,000.00	17,596,788.00 (21,494,036) 0.3%
組入時価比率：0.3%			
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	200,000.00	191,400.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	770,000.00	697,235.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	600,000.00	568,200.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	426,660.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,110,000.00	859,695.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	718,080.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,395,000.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	400,000.00	291,000.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	500,000.00	367,250.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	700,000.00	522,900.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,425,600.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,095,000.00

小計	銘柄数：12 組入時価比率：0.9%	10,920,000.00	8,558,020.00 (67,344,770) 1.0%
チェココルナ	CZECH REPUBLIC	14,000,000.00	12,866,980.00
	CZECH REPUBLIC	6,400,000.00	5,257,568.00
	CZECH REPUBLIC	11,500,000.00	8,856,955.00
	CZECH REPUBLIC	13,200,000.00	9,285,408.00
	CZECH REPUBLIC	5,800,000.00	4,041,962.00
	CZECH REPUBLIC	11,300,000.00	7,952,940.00
	CZECH REPUBLIC	5,200,000.00	4,489,108.00
小計	銘柄数：7 組入時価比率：4.3%	67,400,000.00	52,750,921.00 (306,567,252) 4.4%
フォリント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	62,000,000.00	57,849,100.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	27,000,000.00	26,276,400.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	68,000,000.00	61,572,300.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	58,325,400.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	66,000,000.00	51,895,800.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	82,000,000.00	62,992,400.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	57,000,000.00	52,013,070.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	102,000,000.00	70,115,004.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	130,000,000.00	87,659,000.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	44,000,000.00	23,104,400.00
小計	銘柄数：10 組入時価比率：2.8%	701,000,000.00	551,802,874.00 (200,686,290) 2.9%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,347,575.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,100,000.00	2,742,570.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,400,000.00	1,955,520.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,500,000.00	1,813,500.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,950,000.00	2,301,000.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	3,294,000.00
小計	銘柄数：6 組入時価比率：6.7%	18,950,000.00	15,454,165.00 (478,287,861) 6.9%
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

小計	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	550,000.00	537,663.50
	ROMANIA	400,000.00	379,796.00
	ROMANIA	500,000.00	470,864.70
	ROMANIA	1,000,000.00	906,160.00
	ROMANIA	800,000.00	711,190.16
	ROMANIA	920,000.00	828,611.80
	ROMANIA	500,000.00	427,150.00
	ROMANIA	500,000.00	432,627.50
	ROMANIA	700,000.00	566,724.90
	ROMANIA	760,000.00	657,882.60
	ROMANIA	350,000.00	278,236.00
	ROMANIA	1,400,000.00	922,551.00
	銘柄数：12	8,380,000.00	7,119,458.16
	組入時価比率：2.9%		(206,529,073) 3.0%
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	810,140.00
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,000,000.00	1,978,347.60
	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	736,428.96
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,400,000.00	1,406,115.76
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	401,532.48
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,009,784.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT	700,000.00	708,214.29
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,201,537.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	609,990.18
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,215,518.36
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,398,576.34
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,391,245.04
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,432,110.50
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,012,959.54
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,879,739.00

小計	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	701,425.84	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,458,480.66	
	銘柄数：17	24,200,000.00	23,352,147.15 (724,458,331)	
	組入時価比率：10.2%		10.4%	
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	11,700,000.00	11,993,022.99	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,200,000.00	12,387,284.64	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	14,717,100.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,177,356.72	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	12,103,673.75	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,900,000.00	14,656,884.19	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,300,000.00	13,136,581.57	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,300,000.00	4,344,315.37	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	11,549,889.42	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,500,000.00	14,271,370.80	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,800,000.00	13,585,793.28	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,100,000.00	11,230,968.32	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,145,751.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	2,946,110.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,100,000.00	8,246,604.55	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	12,430,542.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,900,000.00	5,720,991.05	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,700,000.00	13,068,502.59	
	小計	銘柄数：18	185,500,000.00	180,712,743.54 (695,744,062)
		組入時価比率：9.8%		10.0%
ルピア	INDONESIA GOVERNMENT	3,500,000,000.00	3,547,635,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,730,000,000.00	4,971,230,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,800,000,000.00	3,990,950,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,300,000,000.00	4,371,681,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,580,000,000.00	1,801,057,800.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,800,000,000.00	2,616,348,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,250,000,000.00	6,350,000,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	4,782,500,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,230,000,000.00	3,519,085,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,298,422,389.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,600,000,000.00	4,494,200,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,500,000,000.00	4,230,990,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,745,984,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,600,000,000.00	1,649,978,400.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,200,000,000.00	3,190,400,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	4,596,200,000.00	



小計	INDONESIA GOVERNMENT	1,180,000,000.00	1,238,410,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	4,955,000,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,192,500,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	3,400,000,000.00	3,384,700,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	2,300,000,000.00	2,263,223,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	1,800,000,000.00	1,740,204,000.00
	銘柄数：22	76,180,000,000.00	76,930,698,589.00 (707,762,427)
	組入時価比率：9.9%		10.2%
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	9,300,000.00	9,333,947.79
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,800,000.00	7,833,267.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,114,796.80
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,200,828.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,076,290.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,139,840.00
	銘柄数：6	35,300,000.00	35,698,969.59 (728,323,237)
	組入時価比率：10.2%		10.4%
エジプトポンド	EGYPT GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,776,477.80
	EGYPT GOVERNMENT BOND	6,300,000.00	6,113,286.90
	EGYPT GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,098,567.36
	銘柄数：3	15,500,000.00	14,988,332.06 (109,122,551)
	組入時価比率：1.5%		1.6%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,600,000.00	3,648,913.92
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,500,000.00	9,099,341.80
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	16,200,000.00	14,374,953.36
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,660,000.00	6,154,810.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,000,000.00	7,722,089.10
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000.00	8,486,162.19
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000.00	3,198,094.08
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,300,000.00	3,475,260.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000.00	5,866,572.38
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,450,000.00	2,799,253.81
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,300,000.00	5,002,812.36
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,900,000.00	10,966,146.46
銘柄数：12	95,710,000.00	80,794,409.46 (692,408,089)	
	組入時価比率：9.7%		10.0%
合計			6,947,386,521 (6,947,386,521)

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### 国内株式マザーファンド

#### 貸借対照表

(単位：円)	
(2022年 6月22日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	13,578,585,282
株式	410,014,931,210
派生商品評価勘定	23,191,880
未収配当金	3,040,931,756
未収利息	338,658
その他未収収益	21,548,838
差入委託証拠金	894,011,005
流動資産合計	427,573,538,629
<b>資産合計</b>	<b>427,573,538,629</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	386,364,240
未払解約金	32,046,890
未払利息	9,966
有価証券貸借取引受入金	5,476,296,958
流動負債合計	5,894,718,054
<b>負債合計</b>	<b>5,894,718,054</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	212,571,556,894
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	209,107,263,681
元本等合計	421,678,820,575
純資産合計	421,678,820,575
<b>負債純資産合計</b>	<b>427,573,538,629</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	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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<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 約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>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 6月22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	1.9837円
(10,000口当たり純資産額)	(19,837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	5,309,481,860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 6月23日 至 2022年 6月22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>

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 6月22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。	
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 6月22日現在	
期首	2021年 6月23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	192,305,473,973円
同期中における追加設定元本額	42,320,792,693円
同期中における一部解約元本額	22,054,709,772円
期末元本額	212,571,556,894円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	135,072,976円
バランスセレクト50	310,638,812円
バランスセレクト70	453,368,618円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,253,527,673円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,911,501,111円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	8,576,135,808円
野村資産設計ファンド2015	36,086,210円
野村資産設計ファンド2020	38,258,715円
野村資産設計ファンド2025	67,525,321円
野村資産設計ファンド2030	101,440,897円
野村資産設計ファンド2035	85,922,860円
野村資産設計ファンド2040	163,052,826円

野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	13,193,497,523円
のむらップ・ファンド（保守型）	2,571,419,761円
のむらップ・ファンド（普通型）	14,017,457,779円
のむらップ・ファンド（積極型）	4,931,272,846円
野村資産設計ファンド2045	33,330,302円
野村インデックスファンド・TOPIX	2,231,816,922円
マイ・ロード	3,392,205,218円
ネクストコア	7,016,698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	1,526,765,976円
野村TOPIXインデックス（野村SMA・EW向け）	2,709,100,319円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	550,372,019円
野村資産設計ファンド2050	40,743,252円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	11,602,966円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	6,812,768円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	5,294,760円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	4,593,329円
のむらップ・ファンド（やや保守型）	456,126,684円
のむらップ・ファンド（やや積極型）	745,189,539円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,535,192円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,644,019円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	24,025,157円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	7,279,540円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	31,417,012円
野村6資産均等バランス	3,056,990,255円
世界6資産分散ファンド	83,962,084円
野村資産設計ファンド2060	29,404,317円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	1,823,141,885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）	279,631,004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）	139,200,324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）	399,641,327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）	268,146,843円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	3,031,813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）	7,522,240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）	723,843円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	2,122,839,735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）	4,990,222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）	40,037,108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）	58,476,915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）	13,100,696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）	88,802,023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）	190,206,306円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	4,154,614,168円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	44,201,728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）	192,751,526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）	4,439,941,311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）	12,093,052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）	23,304,500円

野村F O F s用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格 機関投資家専用)	2,418,146円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	5,891,633円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	29,312,312円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	34,987,522円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	119,484,073円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	8,857,886,252円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	25,250,165,246円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	29,404,750,093円
野村国内株式インデックスファンド・T O P I X(確定拠出年金向け)	35,961,402,138円
マイバランスD C 3 0	3,383,373,313円
マイバランスD C 5 0	5,872,534,319円
マイバランスD C 7 0	6,402,313,987円
野村D C国内株式インデックスファンド・T O P I X	11,428,759,241円
野村D C運用戦略ファンド	220,795,736円
野村D C運用戦略ファンド(マイルド)	16,768,345円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	1,486,079,463円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,309,183,362円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,150,493,932円
野村世界6資産分散投信(D C)安定コース	12,939,274円
野村世界6資産分散投信(D C)インカムコース	5,965,959円
野村世界6資産分散投信(D C)成長コース	98,282,731円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2030	31,706,204円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2040	29,044,176円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2050	22,361,024円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	657,495,111円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	537,034,450円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	328,004,465円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	464,451,673円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2060	14,895,772円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	130,126,953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)	167,632,256円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金D C向け)	20,087,491円
野村D Cバランスファンド(年金運用戦略タイプ)	123,609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6月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	

株式	日本円	極洋	7,600	3,435.00	26,106,000	
		日本水産	218,000	563.00	122,734,000	
		マルハニチロ	32,200	2,591.00	83,430,200	
		雪国まいたけ	16,700	869.00	14,512,300	
		カネコ種苗	6,500	1,641.00	10,666,500	
		サカタのタネ	25,600	4,470.00	114,432,000	貸付有価証券 100株
		ホクト	18,000	1,923.00	34,614,000	貸付有価証券 2,000株
		ホクリヨウ	3,100	629.00	1,949,900	
		住石ホールディングス	40,100	177.00	7,097,700	貸付有価証券 2,300株
		日鉄鉱業	4,700	5,160.00	24,252,000	
		三井松島ホールディングス	9,600	2,749.00	26,390,400	貸付有価証券 4,200株(2,600株)
		I N P E X	822,600	1,486.00	1,222,383,600	
		石油資源開発	26,900	3,090.00	83,121,000	
		K & O エナジーグループ	9,400	1,537.00	14,447,800	
		ショーボンドホールディングス	28,700	5,900.00	169,330,000	貸付有価証券 6,500株
		ミライト・ホールディングス	73,700	1,605.00	118,288,500	
		タマホーム	13,900	2,346.00	32,609,400	貸付有価証券 6,500株(100株)
		サンヨーホームズ	2,600	729.00	1,895,400	
		日本アクア	9,100	589.00	5,359,900	
		ファーストコーポレーション	5,600	726.00	4,065,600	貸付有価証券 200株
		ベステラ	4,600	1,119.00	5,147,400	貸付有価証券 200株(100株)
		Robot Home	38,200	176.00	6,723,200	貸付有価証券 11,900株(11,400株)
		キャンディル	3,600	528.00	1,900,800	貸付有価証券 1,500株
		ダイセキ環境ソリューション	4,400	907.00	3,990,800	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
		第一カッター興業	5,200	1,292.00	6,718,400	
安藤・間	107,400	826.00	88,712,400	貸付有価証券 400株		
東急建設	63,300	615.00	38,929,500			

コムシスホールディングス	73,800	2,515.00	185,607,000	
ビーアールホールディングス	29,600	317.00	9,383,200	貸付有価証券 100株
高松コンストラクショングループ	14,000	2,022.00	28,308,000	
東建コーポレーション	6,300	7,020.00	44,226,000	
ソネック	2,400	1,042.00	2,500,800	貸付有価証券 900株
ヤマウラ	10,300	929.00	9,568,700	貸付有価証券 4,600株
オリエンタル白石	77,000	235.00	18,095,000	貸付有価証券 100株
大成建設	143,600	4,055.00	582,298,000	
大林組	503,500	962.00	484,367,000	
清水建設	467,800	731.00	341,961,800	貸付有価証券 900株
飛島建設	14,100	1,004.00	14,156,400	
長谷工コーポレーション	146,900	1,582.00	232,395,800	貸付有価証券 100株
松井建設	18,700	664.00	12,416,800	
銭高組	2,100	3,370.00	7,077,000	
鹿島建設	368,900	1,488.00	548,923,200	
不動テトラ	11,200	1,542.00	17,270,400	
大末建設	5,600	1,529.00	8,562,400	
鉄建建設	10,900	1,780.00	19,402,000	
西松建設	32,000	4,000.00	128,000,000	貸付有価証券 500株
三井住友建設	119,200	451.00	53,759,200	
大豊建設	7,700	4,190.00	32,263,000	貸付有価証券 3,600株(3,400株)
佐田建設	11,400	448.00	5,107,200	
ナカノフドー建設	12,600	300.00	3,780,000	
奥村組	27,700	2,913.00	80,690,100	
東鉄工業	22,000	2,298.00	50,556,000	
イチケン	3,800	1,820.00	6,916,000	
富士ピー・エス	6,800	452.00	3,073,600	貸付有価証券 2,800株
浅沼組	5,900	5,250.00	30,975,000	
戸田建設	208,300	699.00	145,601,700	



熊谷組	26,100	2,687.00	70,130,700	
北野建設	3,200	2,162.00	6,918,400	
植木組	4,400	1,407.00	6,190,800	貸付有価証券 1,400株
矢作建設工業	21,800	760.00	16,568,000	
ピーエス三菱	17,400	594.00	10,335,600	
日本ハウスホールディングス	35,800	388.00	13,890,400	貸付有価証券 400株
大東建託	54,100	11,170.00	604,297,000	
新日本建設	22,500	707.00	15,907,500	
東亜道路工業	2,700	5,520.00	14,904,000	貸付有価証券 100株
日本道路	4,600	6,240.00	28,704,000	貸付有価証券 100株
東亜建設工業	12,200	2,422.00	29,548,400	
日本国土開発	44,600	511.00	22,790,600	
若築建設	8,400	2,149.00	18,051,600	
東洋建設	59,300	806.00	47,795,800	貸付有価証券 27,800株(24,700株)
五洋建設	199,600	655.00	130,738,000	
世紀東急工業	25,400	802.00	20,370,800	
福田組	5,600	4,600.00	25,760,000	貸付有価証券 2,300株
住友林業	122,300	1,922.00	235,060,600	貸付有価証券 27,800株
日本基礎技術	13,500	562.00	7,587,000	
巴コーポレーション	20,600	422.00	8,693,200	
大和ハウス工業	441,700	3,056.00	1,349,835,200	
ライト工業	30,000	1,829.00	54,870,000	
積水ハウス	525,600	2,309.00	1,213,610,400	
日特建設	10,900	787.00	8,578,300	
北陸電気工事	9,900	746.00	7,385,400	
ユアテック	30,200	708.00	21,381,600	
日本リーテック	10,400	973.00	10,119,200	
四電工	5,300	1,689.00	8,951,700	
中電工	22,300	2,076.00	46,294,800	貸付有価証券 1,300株
関電工	86,000	806.00	69,316,000	

きんでん	111,000	1,508.00	167,388,000	貸付有価証券 10,100株
東京エネシス	16,300	915.00	14,914,500	
トーエネック	5,300	3,315.00	17,569,500	
住友電設	13,100	2,506.00	32,828,600	
日本電設工業	24,700	1,614.00	39,865,800	
エクシオグループ	75,400	2,074.00	156,379,600	
新日本空調	12,300	1,768.00	21,746,400	
九電工	35,900	2,695.00	96,750,500	
三機工業	34,300	1,470.00	50,421,000	
日揮ホールディングス	153,800	1,758.00	270,380,400	貸付有価証券 100株
中外炉工業	5,000	1,660.00	8,300,000	
ヤマト	13,600	760.00	10,336,000	
太平電業	10,300	2,778.00	28,613,400	
高砂熱学工業	42,900	1,574.00	67,524,600	
三晃金属工業	2,100	2,593.00	5,445,300	
朝日工業社	6,600	1,642.00	10,837,200	
明星工業	28,500	703.00	20,035,500	
大気社	23,300	3,135.00	73,045,500	
ダイダン	10,500	2,054.00	21,567,000	
日比谷総合設備	15,300	1,898.00	29,039,400	貸付有価証券 100株
フィル・カンパニー	2,800	1,106.00	3,096,800	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
テスホールディングス	14,700	1,078.00	15,846,600	貸付有価証券 6,000株（3,200株）
インフロニア・ホールディングス	205,100	926.00	189,922,600	貸付有価証券 2,500株
レイズネクスト	23,600	1,120.00	26,432,000	
ニッポン	44,000	1,593.00	70,092,000	
日清製粉グループ本社	169,900	1,541.00	261,815,900	貸付有価証券 200株
日東富士製粉	2,500	4,520.00	11,300,000	
昭和産業	14,200	2,463.00	34,974,600	
鳥越製粉	13,200	638.00	8,421,600	貸付有価証券 400株（400株）
中部飼料	18,000	1,018.00	18,324,000	

フィード・ワン	20,800	657.00	13,665,600	
東洋精糖	2,900	946.00	2,743,400	
日本甜菜製糖	8,800	1,647.00	14,493,600	
D M三井製糖ホールディングス	14,200	1,880.00	26,696,000	
塩水港精糖	20,200	208.00	4,201,600	
日新製糖	8,000	1,734.00	13,872,000	
森永製菓	35,900	3,995.00	143,420,500	
中村屋	3,600	3,105.00	11,178,000	
江崎グリコ	41,800	3,680.00	153,824,000	
名糖産業	6,600	1,626.00	10,731,600	
井村屋グループ	8,700	2,271.00	19,757,700	
不二家	9,400	2,305.00	21,667,000	貸付有価証券 3,900株
山崎製パン	111,500	1,586.00	176,839,000	
第一屋製パン	3,300	496.00	1,636,800	
モロゾフ	5,100	3,450.00	17,595,000	
亀田製菓	9,100	4,725.00	42,997,500	
寿スピリッツ	15,200	6,970.00	105,944,000	
カルビー	77,100	2,529.00	194,985,900	
森永乳業	29,600	4,540.00	134,384,000	
六甲バター	11,600	1,349.00	15,648,400	
ヤクルト本社	113,400	7,580.00	859,572,000	
明治ホールディングス	98,400	6,490.00	638,616,000	
雪印メグミルク	38,300	1,749.00	66,986,700	貸付有価証券 300株
プリマハム	21,200	2,155.00	45,686,000	
日本ハム	61,100	4,230.00	258,453,000	
林兼産業	5,100	489.00	2,493,900	
丸大食品	15,700	1,519.00	23,848,300	貸付有価証券 100株(100株)
S Foods	15,200	3,090.00	46,968,000	
柿安本店	5,900	2,377.00	14,024,300	
伊藤ハム米久ホールディングス	108,900	677.00	73,725,300	貸付有価証券 500株
サッポロホールディングス	52,200	2,880.00	150,336,000	貸付有価証券 100株
アサヒグループホール	362,700	4,409.00	1,599,144,300	

ディングス				
キリンホールディングス	621,900	2,157.50	1,341,749,250	
宝ホールディングス	101,100	986.00	99,684,600	
オエノンホールディングス	45,800	297.00	13,602,600	
養命酒製造	4,800	1,740.00	8,352,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	111,600	1,460.00	162,936,000	
サントリー食品インターナショナル	113,200	4,980.00	563,736,000	
ダイトーグループホールディングス	8,700	4,860.00	42,282,000	貸付有価証券 700株
伊藤園	51,400	5,340.00	274,476,000	貸付有価証券 400株
キーコーヒー	15,800	2,084.00	32,927,200	
ユニカフェ	5,100	911.00	4,646,100	貸付有価証券 2,300株（100株）
ジャパンフーズ	2,400	1,146.00	2,750,400	
日清オイリオグループ	20,000	3,010.00	60,200,000	
不二製油グループ本社	36,700	1,970.00	72,299,000	
かどや製油	1,600	3,560.00	5,696,000	
J - オイルミルズ	15,800	1,530.00	24,174,000	
キッコーマン	108,300	6,740.00	729,942,000	
味の素	346,700	3,031.00	1,050,847,700	
ブルドックソース	6,400	1,870.00	11,968,000	貸付有価証券 3,000株（200株）
キューピー	79,000	2,196.00	173,484,000	
ハウス食品グループ本社	56,300	2,756.00	155,162,800	
カゴメ	64,200	3,275.00	210,255,000	貸付有価証券 400株
焼津水産化学工業	7,300	898.00	6,555,400	
アリアケジャパン	15,500	5,400.00	83,700,000	
ピエトロ	2,200	1,814.00	3,990,800	貸付有価証券 900株
エバラ食品工業	3,700	2,962.00	10,959,400	貸付有価証券 100株（100株）
やまみ	1,500	1,549.00	2,323,500	
ニチレイ	67,800	2,268.00	153,770,400	
東洋水産	77,400	5,090.00	393,966,000	

イトアンドホールディングス	6,400	2,275.00	14,560,000	
大冷	1,900	1,895.00	3,600,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,700	502.00	4,367,400	貸付有価証券 800株
日清食品ホールディングス	58,200	8,850.00	515,070,000	
永谷園ホールディングス	7,500	1,967.00	14,752,500	
一正蒲鉾	6,800	830.00	5,644,000	貸付有価証券 200株
フジッコ	15,700	1,969.00	30,913,300	
ロック・フィールド	17,300	1,414.00	24,462,200	貸付有価証券 8,000株（800株）
日本たばこ産業	907,200	2,420.00	2,195,424,000	
ケンコーマヨネーズ	8,900	1,435.00	12,771,500	
わらべや日洋ホールディングス	10,500	1,745.00	18,322,500	
なとり	9,400	2,003.00	18,828,200	
イフジ産業	2,900	953.00	2,763,700	
ピクルスコーポレーション	8,100	1,290.00	10,449,000	
ファーマフーズ	21,300	1,360.00	28,968,000	貸付有価証券 10,000株（4,900株）
ユーグレナ	86,900	875.00	76,037,500	貸付有価証券 13,700株（3,300株）
紀文食品	13,100	925.00	12,117,500	貸付有価証券 200株（200株）
ミヨシ油脂	6,100	1,033.00	6,301,300	貸付有価証券 2,700株
理研ビタミン	15,400	1,616.00	24,886,400	
片倉工業	16,000	1,944.00	31,104,000	貸付有価証券 200株
グンゼ	9,900	3,600.00	35,640,000	
東洋紡	65,300	1,004.00	65,561,200	
ユニチカ	45,300	226.00	10,237,800	貸付有価証券 3,100株（400株）
富士紡ホールディングス	7,000	3,205.00	22,435,000	
倉敷紡績	12,700	2,009.00	25,514,300	
シキボウ	8,700	892.00	7,760,400	
日本毛織	43,800	945.00	41,391,000	

ダイトウボウ	26,900	89.00	2,394,100	貸付有価証券 100株
トーア紡コーポレーショ ン	6,100	372.00	2,269,200	
ダイドーリミテッド	23,000	134.00	3,082,000	貸付有価証券 9,100株
帝国繊維	17,700	1,557.00	27,558,900	
帝人	148,500	1,383.00	205,375,500	
東レ	1,081,700	738.40	798,727,280	貸付有価証券 100株
住江織物	2,900	1,679.00	4,869,100	貸付有価証券 100株
日本フェルト	9,300	415.00	3,859,500	
イチカワ	2,000	1,424.00	2,848,000	
日東製網	1,800	1,342.00	2,415,600	
アツギ	12,100	501.00	6,062,100	
ダイニック	5,600	646.00	3,617,600	
セーレン	31,600	1,920.00	60,672,000	貸付有価証券 5,100株
ソトー	6,000	822.00	4,932,000	
東海染工	1,900	1,168.00	2,219,200	
小松マテーレ	25,600	1,253.00	32,076,800	
ワコールホールディング ス	36,600	2,112.00	77,299,200	
ホギメディカル	21,100	2,938.00	61,991,800	
クラウディアホールディ ングス	3,700	247.00	913,900	
T S Iホールディングス	51,800	342.00	17,715,600	貸付有価証券 100株
マツオカコーポレーショ ン	4,900	933.00	4,571,700	
ワールド	21,600	1,255.00	27,108,000	
三陽商会	7,500	877.00	6,577,500	
ナイガイ	5,600	287.00	1,607,200	貸付有価証券 100株
オンワードホールディン グス	93,700	244.00	22,862,800	
ルックホールディングス	5,300	1,603.00	8,495,900	貸付有価証券 100株
ゴールドウイン	28,100	7,540.00	211,874,000	

デサント	29,500	2,950.00	87,025,000	貸付有価証券 500株
キング	7,800	533.00	4,157,400	
ヤマトインターナショナル	13,000	275.00	3,575,000	貸付有価証券 3,200株（400株）
特種東海製紙	9,100	3,135.00	28,528,500	
王子ホールディングス	654,800	574.00	375,855,200	
日本製紙	71,000	950.00	67,450,000	貸付有価証券 100株
三菱製紙	21,900	301.00	6,591,900	
北越コーポレーション	101,700	679.00	69,054,300	貸付有価証券 11,100株
中越パルプ工業	6,300	890.00	5,607,000	
巴川製紙所	4,900	600.00	2,940,000	
大王製紙	73,700	1,340.00	98,758,000	貸付有価証券 15,800株
阿波製紙	3,900	307.00	1,197,300	
レンゴー	137,200	695.00	95,354,000	
トーモク	8,800	1,494.00	13,147,200	
ザ・パック	11,100	2,158.00	23,953,800	
北の達人コーポレーション	59,100	188.00	11,110,800	貸付有価証券 28,600株（14,500株）
クラレ	229,100	1,112.00	254,759,200	
旭化成	1,045,800	1,041.50	1,089,200,700	
共和レザー	9,400	575.00	5,405,000	
昭和電工	144,500	2,464.00	356,048,000	
住友化学	1,155,300	536.00	619,240,800	
住友精化	6,800	2,881.00	19,590,800	
日産化学	79,800	6,100.00	486,780,000	
ラサ工業	5,800	1,887.00	10,944,600	
クレハ	12,300	9,740.00	119,802,000	
多木化学	5,800	4,320.00	25,056,000	貸付有価証券 1,300株
テイカ	10,300	1,189.00	12,246,700	
石原産業	28,900	1,018.00	29,420,200	
片倉コープアグリ	3,700	1,286.00	4,758,200	
日本曹達	19,100	4,260.00	81,366,000	
東ソー	215,500	1,734.00	373,677,000	

トクヤマ	50,300	1,732.00	87,119,600	
セントラル硝子	25,500	3,045.00	77,647,500	
東亜合成	83,000	1,014.00	84,162,000	
大阪ソーダ	13,500	3,140.00	42,390,000	貸付有価証券 2,200株
関東電化工業	32,100	878.00	28,183,800	
デンカ	57,200	3,230.00	184,756,000	
信越化学工業	269,000	15,150.00	4,075,350,000	貸付有価証券 5,200株
日本カーバイド工業	5,900	1,336.00	7,882,400	
堺化学工業	11,000	1,856.00	20,416,000	貸付有価証券 3,500株
第一稀元素化学工業	14,500	1,119.00	16,225,500	
エア・ウォーター	140,300	1,683.00	236,124,900	
日本酸素ホールディングス	143,600	2,213.00	317,786,800	
日本化学工業	4,800	1,947.00	9,345,600	
東邦アセチレン	3,400	1,123.00	3,818,200	
日本パーカライジング	74,000	892.00	66,008,000	
高压ガス工業	24,200	650.00	15,730,000	
チタン工業	1,900	1,661.00	3,155,900	
四国化成工業	19,800	1,234.00	24,433,200	
戸田工業	3,500	2,251.00	7,878,500	貸付有価証券 200株
ステラ ケミファ	8,300	2,400.00	19,920,000	
保土谷化学工業	4,700	3,265.00	15,345,500	
日本触媒	24,900	5,280.00	131,472,000	貸付有価証券 2,900株
大日精化工業	12,300	1,733.00	21,315,900	
カネカ	38,000	3,265.00	124,070,000	
三菱瓦斯化学	137,900	1,980.00	273,042,000	
三井化学	135,700	2,921.00	396,379,700	
J S R	153,900	3,545.00	545,575,500	
東京応化工業	25,300	6,560.00	165,968,000	
大阪有機化学工業	12,500	2,200.00	27,500,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,051,200	754.50	793,130,400	貸付有価証券 400株
K Hネオケム	25,900	2,456.00	63,610,400	



ダイセル	227,300	843.00	191,613,900	
住友ベークライト	24,200	4,305.00	104,181,000	
積水化学工業	329,100	1,826.00	600,936,600	
日本ゼオン	132,400	1,351.00	178,872,400	
アイカ工業	41,300	2,777.00	114,690,100	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
UBE	77,800	2,030.00	157,934,000	
積水樹脂	23,400	1,662.00	38,890,800	
タキロンシーアイ	35,700	531.00	18,956,700	
旭有機材	9,300	1,983.00	18,441,900	貸付有価証券 200株
ニチバン	9,000	1,615.00	14,535,000	貸付有価証券 500株
リケンテクノス	35,800	425.00	15,215,000	
大倉工業	7,600	1,693.00	12,866,800	
積水化成成品工業	20,500	405.00	8,302,500	
群栄化学工業	3,500	2,553.00	8,935,500	
タイガースポリマー	8,200	448.00	3,673,600	
ミライアル	5,300	1,772.00	9,391,600	貸付有価証券 100株
ダイキアクシス	6,400	732.00	4,684,800	貸付有価証券 2,700株
ダイキョーニシカワ	34,800	505.00	17,574,000	貸付有価証券 100株
竹本容器	5,900	797.00	4,702,300	
森六ホールディングス	8,300	1,791.00	14,865,300	
恵和	4,500	3,660.00	16,470,000	
日本化薬	119,000	1,091.00	129,829,000	貸付有価証券 300株
カーリットホールディングス	14,700	681.00	10,010,700	
日本精化	11,500	1,964.00	22,586,000	
扶桑化学工業	13,600	3,515.00	47,804,000	
トリケミカル研究所	17,000	2,169.00	36,873,000	
ADEKA	68,800	2,385.00	164,088,000	
日油	50,600	4,835.00	244,651,000	
新日本理化	24,700	255.00	6,298,500	
ハリマ化成グループ	11,400	755.00	8,607,000	

花王	356,400	5,259.00	1,874,307,600	
第一工業製薬	5,800	1,964.00	11,391,200	
石原ケミカル	7,900	1,249.00	9,867,100	
日華化学	5,600	863.00	4,832,800	
ニイタカ	3,200	2,091.00	6,691,200	貸付有価証券 300株
三洋化成工業	9,900	4,620.00	45,738,000	
有機合成薬品工業	11,500	270.00	3,105,000	
大日本塗料	19,200	704.00	13,516,800	
日本ペイントホールディングス	620,400	984.00	610,473,600	
関西ペイント	152,200	1,814.00	276,090,800	貸付有価証券 100株
神東塗料	13,000	155.00	2,015,000	
中国塗料	36,800	864.00	31,795,200	貸付有価証券 17,100株
日本特殊塗料	10,700	988.00	10,571,600	
藤倉化成	20,500	477.00	9,778,500	
太陽ホールディングス	24,300	2,828.00	68,720,400	
D I C	63,100	2,411.00	152,134,100	貸付有価証券 200株
サカタインクス	32,800	857.00	28,109,600	
東洋インキ S C ホールディングス	32,800	1,930.00	63,304,000	
T & K T O K A	13,300	784.00	10,427,200	
富士フイルムホールディングス	296,300	7,050.00	2,088,915,000	
資生堂	314,000	5,199.00	1,632,486,000	
ライオン	178,600	1,440.00	257,184,000	貸付有価証券 100株
高砂香料工業	10,200	2,374.00	24,214,800	
マンダム	33,700	1,423.00	47,955,100	
ミルボン	20,800	4,425.00	92,040,000	貸付有価証券 100株
ファンケル	68,200	2,270.00	154,814,000	貸付有価証券 700株
コーセー	31,700	11,360.00	360,112,000	
コタ	11,800	1,453.00	17,145,400	
シーボン	2,200	1,695.00	3,729,000	

ポーラ・オルビスホールディングス	72,000	1,554.00	111,888,000	貸付有価証券 300株
ノエビアホールディングス	13,100	5,510.00	72,181,000	
アジュバンホールディングス	3,800	958.00	3,640,400	
新日本製薬	6,900	1,428.00	9,853,200	
エステー	10,800	1,443.00	15,584,400	
アグロ カネショウ	5,600	1,249.00	6,994,400	貸付有価証券 2,600株
コニシ	26,300	1,487.00	39,108,100	
長谷川香料	29,100	2,549.00	74,175,900	
星光P M C	9,500	553.00	5,253,500	
小林製薬	47,200	7,980.00	376,656,000	貸付有価証券 200株
荒川化学工業	12,600	980.00	12,348,000	
メック	11,900	2,261.00	26,905,900	
日本高純度化学	4,200	2,241.00	9,412,200	
タカラバイオ	44,100	1,849.00	81,540,900	
J C U	17,800	3,130.00	55,714,000	
新田ゼラチン	9,900	613.00	6,068,700	
O A T アグリオ	7,000	1,553.00	10,871,000	貸付有価証券 100株（100株）
デクセリアルズ	43,900	3,765.00	165,283,500	
アース製薬	13,900	5,120.00	71,168,000	
北興化学工業	14,600	922.00	13,461,200	
大成ラミック	4,700	2,644.00	12,426,800	
クミアイ化学工業	62,700	1,058.00	66,336,600	貸付有価証券 100株
日本農薬	30,000	665.00	19,950,000	
アキレス	10,800	1,378.00	14,882,400	
有沢製作所	23,500	1,024.00	24,064,000	貸付有価証券 300株
日東電工	101,900	9,020.00	919,138,000	
レック	20,600	639.00	13,163,400	貸付有価証券 500株
三光合成	19,300	336.00	6,484,800	
きもと	25,800	218.00	5,624,400	
藤森工業	13,800	3,420.00	47,196,000	

前澤化成工業	10,200	1,289.00	13,147,800	貸付有価証券 4,700株
未来工業	6,000	1,515.00	9,090,000	
ウェーブロックホールディングス	6,400	626.00	4,006,400	貸付有価証券 400株(400株)
JSP	9,900	1,367.00	13,533,300	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	31,000	2,525.00	78,275,000	
天馬	13,200	2,402.00	31,706,400	貸付有価証券 5,800株
信越ポリマー	30,300	1,130.00	34,239,000	
東リ	39,600	206.00	8,157,600	
ニフコ	56,300	3,135.00	176,500,500	
バルカー	13,700	2,600.00	35,620,000	
ユニ・チャーム	324,900	4,390.00	1,426,311,000	貸付有価証券 400株
ショーエイコーポレーション	4,500	579.00	2,605,500	貸付有価証券 200株(200株)
協和キリン	179,000	3,000.00	537,000,000	
武田薬品工業	1,325,000	3,695.00	4,895,875,000	貸付有価証券 300株
アステラス製薬	1,441,300	2,116.00	3,049,790,800	
住友ファーマ	104,100	1,036.00	107,847,600	
塩野義製薬	201,100	6,786.00	1,364,664,600	
わかもと製薬	17,600	247.00	4,347,200	貸付有価証券 100株
日本新薬	39,200	7,670.00	300,664,000	
中外製薬	527,300	3,398.00	1,791,765,400	
科研製薬	24,800	3,735.00	92,628,000	
エーザイ	191,400	5,352.00	1,024,372,800	
ロート製薬	82,400	3,610.00	297,464,000	
小野薬品工業	343,100	3,234.00	1,109,585,400	
久光製薬	38,600	3,415.00	131,819,000	
持田製薬	19,600	3,170.00	62,132,000	
参天製薬	300,600	1,011.00	303,906,600	
扶桑薬品工業	5,600	2,118.00	11,860,800	
日本ケミファ	1,900	1,871.00	3,554,900	
ツムラ	49,600	2,911.00	144,385,600	

キッセイ薬品工業	26,200	2,478.00	64,923,600	
生化学工業	29,700	814.00	24,175,800	
栄研化学	26,600	1,646.00	43,783,600	
日水製薬	6,200	1,711.00	10,608,200	
鳥居薬品	9,000	3,000.00	27,000,000	
JCRファーマ	47,500	2,240.00	106,400,000	
東和薬品	24,300	2,296.00	55,792,800	
富士製薬工業	9,500	944.00	8,968,000	
ゼリア新薬工業	26,900	2,083.00	56,032,700	貸付有価証券 1,200株
第一三共	1,256,900	3,200.00	4,022,080,000	
キョーリン製薬ホールディングス	31,600	1,744.00	55,110,400	
大幸薬品	25,400	577.00	14,655,800	貸付有価証券 11,300株（1,200株）
ダイト	10,700	2,677.00	28,643,900	
大塚ホールディングス	330,900	4,495.00	1,487,395,500	
大正製薬ホールディングス	34,200	5,200.00	177,840,000	貸付有価証券 500株
ペプチドリーム	88,500	1,285.00	113,722,500	貸付有価証券 1,000株
あすか製薬ホールディングス	17,100	1,000.00	17,100,000	
サワイグループホールディングス	33,900	4,035.00	136,786,500	貸付有価証券 3,300株
日本コークス工業	142,400	117.00	16,660,800	
ニチレキ	19,400	1,256.00	24,366,400	
ユシロ化学工業	8,200	931.00	7,634,200	
ビーピー・カストロール	6,000	1,150.00	6,900,000	
富士石油	39,600	321.00	12,711,600	
MORESCO	5,600	1,223.00	6,848,800	貸付有価証券 100株（100株）
出光興産	176,700	3,220.00	568,974,000	
ENEOSホールディングス	2,536,100	518.10	1,313,953,410	
コスモエネルギーホールディングス	60,600	3,650.00	221,190,000	貸付有価証券 600株
横浜ゴム	85,800	1,862.00	159,759,600	
TOYO TIRE	83,400	1,717.00	143,197,800	

ブリヂストン	460,700	5,238.00	2,413,146,600	貸付有価証券 45,800株
住友ゴム工業	142,300	1,204.00	171,329,200	貸付有価証券 10,200株
藤倉コンポジット	13,500	898.00	12,123,000	
オカモト	8,700	3,775.00	32,842,500	
フコク	7,400	963.00	7,126,200	
ニッタ	16,400	2,753.00	45,149,200	
住友理工	32,700	592.00	19,358,400	
三ツ星ベルト	20,500	2,762.00	56,621,000	
バンドー化学	27,200	918.00	24,969,600	
日東紡績	22,300	2,374.00	52,940,200	
A G C	146,800	4,845.00	711,246,000	貸付有価証券 200株
日本板硝子	77,800	384.00	29,875,200	貸付有価証券 10,200株
石塚硝子	2,700	1,634.00	4,411,800	
日本山村硝子	6,000	721.00	4,326,000	
日本電気硝子	64,200	2,695.00	173,019,000	
オハラ	6,700	1,176.00	7,879,200	
住友大阪セメント	28,600	3,435.00	98,241,000	貸付有価証券 3,000株
太平洋セメント	95,800	1,961.00	187,863,800	
日本ヒューム	14,900	659.00	9,819,100	
日本コンクリート工業	31,300	271.00	8,482,300	
三谷セキサン	7,200	4,285.00	30,852,000	貸付有価証券 3,200株
アジアパイルホールディ ングス	24,600	462.00	11,365,200	
東海カーボン	133,400	1,064.00	141,937,600	
日本カーボン	8,700	4,120.00	35,844,000	
東洋炭素	10,300	2,774.00	28,572,200	貸付有価証券 500株
ノリタケカンパニーリミ テド	8,800	4,090.00	35,992,000	
T O T O	108,100	4,240.00	458,344,000	
日本碍子	171,600	1,815.00	311,454,000	
日本特殊陶業	121,100	2,490.00	301,539,000	
ダントーホールディング	11,000	260.00	2,860,000	貸付有価証券

ス				6,300株
MARUWA	5,800	14,000.00	81,200,000	
品川リフラクトリーズ	3,900	3,545.00	13,825,500	
黒崎播磨	2,900	4,270.00	12,383,000	
ヨータイ	10,700	1,409.00	15,076,300	
東京窯業	18,300	267.00	4,886,100	
ニッカトー	7,200	469.00	3,376,800	
フジインコーポレーテッド	13,500	5,530.00	74,655,000	
クニミネ工業	5,300	905.00	4,796,500	
エーアンドエーマテリアル	2,800	875.00	2,450,000	
ニチアス	36,700	2,242.00	82,281,400	
ニチハ	22,100	2,549.00	56,332,900	
日本製鉄	713,000	1,899.50	1,354,343,500	貸付有価証券 6,000株
神戸製鋼所	297,400	610.00	181,414,000	
中山製鋼所	24,200	422.00	10,212,400	
合同製鐵	8,400	1,325.00	11,130,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	407,400	1,413.00	575,656,200	貸付有価証券 7,600株
東京製鐵	51,400	1,536.00	78,950,400	
共英製鋼	17,200	1,329.00	22,858,800	
大和工業	28,400	4,500.00	127,800,000	
東京鐵鋼	7,000	1,208.00	8,456,000	
大阪製鐵	8,900	1,432.00	12,744,800	
淀川製鋼所	19,500	2,169.00	42,295,500	
丸一鋼管	49,800	2,828.00	140,834,400	貸付有価証券 5,500株
モリ工業	4,300	2,450.00	10,535,000	
大同特殊鋼	24,300	3,445.00	83,713,500	
日本高周波鋼業	6,100	331.00	2,019,100	貸付有価証券 100株
日本冶金工業	11,600	2,115.00	24,534,000	貸付有価証券 300株
山陽特殊製鋼	15,200	1,874.00	28,484,800	
愛知製鋼	9,400	2,055.00	19,317,000	
日立金属	179,600	2,003.00	359,738,800	貸付有価証券

				27,900株(9,000株)
日本金属	4,200	1,065.00	4,473,000	
大平洋金属	10,200	2,475.00	25,245,000	貸付有価証券 400株
新日本電工	97,400	345.00	33,603,000	貸付有価証券 100株
栗本鐵工所	7,100	1,620.00	11,502,000	
虹技	2,200	1,004.00	2,208,800	
日本鑄鉄管	1,700	1,001.00	1,701,700	
三菱製鋼	10,700	932.00	9,972,400	
日亜鋼業	19,900	260.00	5,174,000	
日本精線	2,600	4,180.00	10,868,000	
エンビプロ・ホールディングス	11,000	836.00	9,196,000	貸付有価証券 5,100株(3,000株)
シンニッタン	20,200	219.00	4,423,800	
新家工業	3,700	1,451.00	5,368,700	
大紀アルミニウム工業所	22,100	1,203.00	26,586,300	貸付有価証券 700株
日本軽金属ホールディングス	42,200	1,486.00	62,709,200	
三井金属鉱業	45,000	3,185.00	143,325,000	貸付有価証券 200株
東邦亜鉛	8,800	2,205.00	19,404,000	
三菱マテリアル	100,900	1,958.00	197,562,200	
住友金属鉱山	192,800	4,547.00	876,661,600	
DOWAホールディングス	41,100	4,575.00	188,032,500	
古河機械金属	26,100	1,206.00	31,476,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,300	2,270.00	43,811,000	貸付有価証券 7,000株(4,600株)
東邦チタニウム	29,800	2,220.00	66,156,000	貸付有価証券 14,000株(14,000株)
UACJ	23,600	2,109.00	49,772,400	貸付有価証券 8,700株
CKサンエツ	3,200	3,890.00	12,448,000	
古河電気工業	49,300	2,191.00	108,016,300	貸付有価証券 300株
住友電気工業	595,600	1,462.00	870,767,200	
フジクラ	185,800	794.00	147,525,200	
昭和電線ホールディング	14,500	1,686.00	24,447,000	



ス				
東京特殊電線	2,300	2,258.00	5,193,400	
タツタ電線	29,400	461.00	13,553,400	
カナレ電気	2,500	1,611.00	4,027,500	貸付有価証券 1,100株（100株）
平河ヒューテック	9,200	1,069.00	9,834,800	
リョービ	18,200	1,023.00	18,618,600	
アーレスティ	17,700	375.00	6,637,500	
アサヒホールディングス	66,800	2,069.00	138,209,200	貸付有価証券 1,400株
稲葉製作所	8,800	1,352.00	11,897,600	
宮地エンジニアリンググループ	4,800	3,360.00	16,128,000	
トーカロ	43,000	1,219.00	52,417,000	
アルファC o	6,100	970.00	5,917,000	
SUMCO	268,800	1,806.00	485,452,800	貸付有価証券 54,600株
川田テクノロジーズ	3,200	3,570.00	11,424,000	
RS Technologies	5,400	5,820.00	31,428,000	
ジェイテックコーポレーション	2,100	2,066.00	4,338,600	
信和	10,300	778.00	8,013,400	
東洋製罐グループホールディングス	92,000	1,381.00	127,052,000	
ホッカンホールディングス	8,200	1,220.00	10,004,000	
コロナ	8,400	827.00	6,946,800	
横河ブリッジホールディングス	25,400	1,883.00	47,828,200	
駒井ハルテック	2,800	1,656.00	4,636,800	
高田機工	1,400	2,459.00	3,442,600	貸付有価証券 600株
三和ホールディングス	157,200	1,269.00	199,486,800	
文化シャッター	50,400	970.00	48,888,000	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
三協立山	20,400	550.00	11,220,000	
アルインコ	11,400	862.00	9,826,800	
東洋シャッター	3,700	604.00	2,234,800	
LIXIL	262,400	2,455.00	644,192,000	

日本ファイルコン	10,800	500.00	5,400,000	
ノーリツ	28,400	1,430.00	40,612,000	
長府製作所	16,900	1,746.00	29,507,400	
リンナイ	29,700	9,090.00	269,973,000	
ダイニチ工業	8,000	626.00	5,008,000	
日東精工	19,500	478.00	9,321,000	
三洋工業	2,000	1,632.00	3,264,000	
岡部	27,500	610.00	16,775,000	
ジーテクト	19,200	1,282.00	24,614,400	
東プレ	27,300	1,009.00	27,545,700	
高周波熱錬	26,400	646.00	17,054,400	貸付有価証券 400株
東京製綱	10,200	937.00	9,557,400	
サンコール	14,300	614.00	8,780,200	
モリテック スチール	13,000	286.00	3,718,000	
パイオラックス	22,600	1,976.00	44,657,600	
エイチワン	15,400	597.00	9,193,800	
日本発條	144,800	925.00	133,940,000	
中央発條	8,000	691.00	5,528,000	
アドバネクス	2,200	1,236.00	2,719,200	
立川ブラインド工業	6,800	1,045.00	7,106,000	貸付有価証券 3,100株
三益半導体工業	13,000	2,087.00	27,131,000	貸付有価証券 100株
日本ドライケミカル	3,900	1,508.00	5,881,200	
日本製鋼所	45,400	2,932.00	133,112,800	
三浦工業	67,800	2,670.00	181,026,000	
タクマ	50,700	1,318.00	66,822,600	
ツガミ	34,900	1,144.00	39,925,600	貸付有価証券 100株
オークマ	17,100	5,330.00	91,143,000	
芝浦機械	18,800	2,684.00	50,459,200	
アマダ	263,100	1,009.00	265,467,900	
アイダエンジニアリング	38,800	896.00	34,764,800	
滝澤鉄工所	4,800	1,155.00	5,544,000	
F U J I	70,000	2,002.00	140,140,000	
牧野フライス製作所	17,400	4,420.00	76,908,000	

オーエスジー	74,400	1,591.00	118,370,400	
ダイジェット工業	1,800	943.00	1,697,400	貸付有価証券 800株（800株）
旭ダイヤモンド工業	41,800	607.00	25,372,600	
D M G 森精機	94,500	1,804.00	170,478,000	貸付有価証券 900株
ソディック	36,300	795.00	28,858,500	
ディスコ	24,600	29,910.00	735,786,000	
日東工器	8,400	1,453.00	12,205,200	
日進工具	13,100	1,215.00	15,916,500	
パンチ工業	14,100	452.00	6,373,200	
富士ダイス	8,400	630.00	5,292,000	
豊和工業	8,500	912.00	7,752,000	
OKK	6,200	978.00	6,063,600	貸付有価証券 2,900株
東洋機械金属	10,800	558.00	6,026,400	
津田駒工業	3,000	547.00	1,641,000	
エンシュウ	3,700	903.00	3,341,100	
島精機製作所	24,400	2,130.00	51,972,000	貸付有価証券 100株
オプトラ	20,900	1,843.00	38,518,700	
NCホールディングス	4,300	1,985.00	8,535,500	
イワキポンプ	10,600	931.00	9,868,600	
フリー	14,800	1,040.00	15,392,000	
ヤマシンフィルタ	28,700	297.00	8,523,900	貸付有価証券 100株
日阪製作所	18,300	827.00	15,134,100	
やまびこ	29,200	1,153.00	33,667,600	
野村マイクロ・サイエンス	5,500	3,575.00	19,662,500	貸付有価証券 1,600株
平田機工	7,500	4,120.00	30,900,000	
ペガサスミシン製造	16,900	605.00	10,224,500	
マルマエ	6,800	1,826.00	12,416,800	貸付有価証券 3,100株
タツモ	8,500	1,234.00	10,489,000	貸付有価証券 500株（400株）
ナプテスコ	90,800	3,175.00	288,290,000	
三井海洋開発	17,700	1,101.00	19,487,700	

レオン自動機	17,800	1,142.00	20,327,600	
S M C	49,400	59,010.00	2,915,094,000	
ホソカワミクロン	11,100	2,561.00	28,427,100	
ユニオンツール	6,200	3,285.00	20,367,000	貸付有価証券 300株(100株)
オイレス工業	22,100	1,530.00	33,813,000	
日精エー・エス・ビー機 械	6,200	3,640.00	22,568,000	
サトーホールディングス	21,900	1,859.00	40,712,100	
技研製作所	14,800	3,010.00	44,548,000	
日本エアータック	7,700	1,007.00	7,753,900	
カワタ	5,000	1,004.00	5,020,000	
日精樹脂工業	10,900	874.00	9,526,600	
オカダアイヨン	5,300	1,475.00	7,817,500	
ワイエイシイホールディ ングス	6,600	1,664.00	10,982,400	
小松製作所	764,000	3,072.00	2,347,008,000	
住友重機械工業	92,200	3,085.00	284,437,000	貸付有価証券 4,600株
日立建機	67,600	3,150.00	212,940,000	
日工	21,600	608.00	13,132,800	
巴工業	6,200	2,318.00	14,371,600	貸付有価証券 1,500株
井関農機	14,000	1,173.00	16,422,000	
T O W A	14,400	1,734.00	24,969,600	貸付有価証券 6,700株
丸山製作所	2,900	1,538.00	4,460,200	
北川鉄工所	6,900	1,446.00	9,977,400	
ローツェ	8,300	8,540.00	70,882,000	
タカキタ	5,400	505.00	2,727,000	貸付有価証券 2,500株(200株)
クボタ	816,700	2,068.50	1,689,343,950	
荏原実業	7,700	2,168.00	16,693,600	
三菱化工機	5,100	1,971.00	10,052,100	
月島機械	27,900	870.00	24,273,000	
帝国電機製作所	11,100	1,574.00	17,471,400	
東京機械製作所	6,900	830.00	5,727,000	貸付有価証券 100株
新東工業	33,300	669.00	22,277,700	

澁谷工業	13,800	2,195.00	30,291,000	
アイチ コーポレーション	24,000	838.00	20,112,000	
小森コーポレーション	40,700	816.00	33,211,200	
鶴見製作所	12,200	1,851.00	22,582,200	
住友精密工業	2,500	2,836.00	7,090,000	
日本ギア工業	6,000	268.00	1,608,000	
酒井重工業	2,800	2,855.00	7,994,000	
荏原製作所	67,400	5,180.00	349,132,000	
石井鐵工所	2,100	2,878.00	6,043,800	
西島製作所	14,200	1,269.00	18,019,800	
北越工業	14,700	858.00	12,612,600	
ダイキン工業	194,300	20,340.00	3,952,062,000	貸付有価証券 3,800株
オルガノ	4,900	8,440.00	41,356,000	
トーヨーカネツ	6,000	2,712.00	16,272,000	
栗田工業	87,200	4,800.00	418,560,000	
椿本チエイン	22,000	3,090.00	67,980,000	
大同工業	7,100	812.00	5,765,200	貸付有価証券 100株
木村化工機	13,300	682.00	9,070,600	貸付有価証券 5,100株
アネスト岩田	26,200	883.00	23,134,600	
ダイフク	83,900	7,410.00	621,699,000	
サムコ	4,500	2,565.00	11,542,500	貸付有価証券 2,000株
加藤製作所	8,000	795.00	6,360,000	
油研工業	2,700	1,732.00	4,676,400	
タダノ	83,600	917.00	76,661,200	貸付有価証券 100株
フジテック	54,600	2,790.00	152,334,000	貸付有価証券 6,400株
C K D	45,000	1,737.00	78,165,000	
キトー	13,600	2,594.00	35,278,400	貸付有価証券 100株
平和	47,000	1,998.00	93,906,000	
理想科学工業	13,600	2,241.00	30,477,600	
S A N K Y O	36,400	4,065.00	147,966,000	

日本金銭機械	17,100	646.00	11,046,600	
マースグループホールディングス	10,700	1,683.00	18,008,100	
フクシマガリレイ	10,800	3,060.00	33,048,000	
オーイズミ	5,900	405.00	2,389,500	
ダイコク電機	7,700	1,223.00	9,417,100	貸付有価証券 2,600株
竹内製作所	25,600	2,303.00	58,956,800	
アマノ	44,100	2,322.00	102,400,200	
J U K I	23,500	709.00	16,661,500	貸付有価証券 500株
ジャノメ	14,300	705.00	10,081,500	
マックス	20,700	1,599.00	33,099,300	
グローリー	41,100	2,023.00	83,145,300	貸付有価証券 1,100株
新晃工業	15,700	1,576.00	24,743,200	貸付有価証券 100株
大和冷機工業	24,400	1,047.00	25,546,800	
セガサミーホールディングス	167,200	2,091.00	349,615,200	
日本ピストンリング	6,100	1,261.00	7,692,100	
リケン	6,500	2,378.00	15,457,000	
T P R	20,200	1,210.00	24,442,000	
ツバキ・ナカシマ	37,000	925.00	34,225,000	貸付有価証券 100株
ホシザキ	49,300	8,150.00	401,795,000	
大豊工業	13,700	687.00	9,411,900	
日本精工	298,200	743.00	221,562,600	貸付有価証券 7,000株
N T N	325,200	267.00	86,828,400	貸付有価証券 1,100株
ジェイテクト	149,700	1,050.00	157,185,000	貸付有価証券 400株
不二越	12,600	3,520.00	44,352,000	
日本トムソン	41,000	531.00	21,771,000	
T H K	95,200	2,533.00	241,141,600	
ユーシン精機	13,100	675.00	8,842,500	
前澤給装工業	11,400	878.00	10,009,200	貸付有価証券 200株（200株）

イーグル工業	19,100	970.00	18,527,000	
前澤工業	10,500	605.00	6,352,500	
日本ピラー工業	15,300	2,706.00	41,401,800	
キッツ	50,500	655.00	33,077,500	
マキタ	195,400	3,346.00	653,808,400	
三井E & Sホールディングス	61,100	345.00	21,079,500	貸付有価証券 6,100株
日立造船	136,600	836.00	114,197,600	
三菱重工業	253,100	4,877.00	1,234,368,700	
I H I	105,200	3,810.00	400,812,000	
サノヤスホールディングス	19,700	127.00	2,501,900	
スター精密	23,500	1,637.00	38,469,500	
日清紡ホールディングス	97,300	1,068.00	103,916,400	
イビデン	83,600	3,765.00	314,754,000	
コニカミノルタ	350,800	464.00	162,771,200	貸付有価証券 100株
ブラザー工業	196,700	2,417.00	475,423,900	
ミネベアミツミ	275,700	2,240.00	617,568,000	
日立製作所	810,800	6,477.00	5,251,551,600	
東芝	294,700	5,501.00	1,621,144,700	貸付有価証券 1,800株
三菱電機	1,610,900	1,395.50	2,248,010,950	
富士電機	96,400	5,440.00	524,416,000	貸付有価証券 100株
東洋電機製造	5,800	902.00	5,231,600	
安川電機	172,200	4,360.00	750,792,000	
シンフォニアテクノロジー	18,200	1,317.00	23,969,400	
明電舎	25,400	1,912.00	48,564,800	
オリジン	4,000	1,211.00	4,844,000	
山洋電気	6,600	5,070.00	33,462,000	
デンヨー	12,800	1,533.00	19,622,400	
PHCホールディングス	26,000	1,250.00	32,500,000	貸付有価証券 600株
東芝テック	18,100	4,220.00	76,382,000	
芝浦メカトロニクス	3,000	10,080.00	30,240,000	
マブチモーター	38,600	3,555.00	137,223,000	

日本電産	395,400	7,862.00	3,108,634,800	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,400	447.00	2,860,800	貸付有価証券 600株(600株)
トレックス・セミコンダクター	7,700	2,598.00	20,004,600	
東光高岳	9,400	1,674.00	15,735,600	貸付有価証券 900株
ダブル・スコープ	48,500	1,780.00	86,330,000	貸付有価証券 22,700株(22,400株)
ダイヘン	16,600	4,005.00	66,483,000	
ヤーマン	27,500	1,661.00	45,677,500	貸付有価証券 1,500株
JVCケンウッド	137,300	175.00	24,027,500	
ミマキエンジニアリング	15,100	506.00	7,640,600	
I-PEX	7,800	1,275.00	9,945,000	
日新電機	39,500	1,545.00	61,027,500	
大崎電気工業	29,200	497.00	14,512,400	
オムロン	140,300	6,690.00	938,607,000	
日東工業	21,200	2,315.00	49,078,000	
I D E C	20,900	2,673.00	55,865,700	貸付有価証券 100株
正興電機製作所	4,800	1,050.00	5,040,000	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
不二電機工業	3,100	1,117.00	3,462,700	貸付有価証券 1,400株
ジーエス・ユアサコーポレーション	52,000	2,101.00	109,252,000	
サクサホールディングス	3,900	1,369.00	5,339,100	
メルコホールディングス	4,400	3,370.00	14,828,000	貸付有価証券 1,600株
テクノメディカ	3,800	1,551.00	5,893,800	貸付有価証券 1,500株
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	4,700	1,296.00	6,091,200	貸付有価証券 2,200株(1,700株)
日本電気	204,700	5,180.00	1,060,346,000	
富士通	151,700	16,545.00	2,509,876,500	
沖電気工業	65,400	745.00	48,723,000	
岩崎通信機	6,900	805.00	5,554,500	
電気興業	8,400	2,451.00	20,588,400	
サンケン電気	14,900	4,675.00	69,657,500	貸付有価証券



				3,400株
ナカヨ	2,800	1,087.00	3,043,600	
アイホン	8,300	1,695.00	14,068,500	
ルネサスエレクトロニクス	916,200	1,278.00	1,170,903,600	貸付有価証券 8,200株
セイコーエプソン	195,200	2,099.00	409,724,800	
ワコム	130,800	774.00	101,239,200	貸付有価証券 43,200株
アルバック	33,600	4,600.00	154,560,000	貸付有価証券 2,700株
アクセル	6,700	779.00	5,219,300	貸付有価証券 600株(600株)
E I Z O	12,300	3,720.00	45,756,000	貸付有価証券 100株
日本信号	38,200	905.00	34,571,000	
京三製作所	34,000	425.00	14,450,000	
能美防災	20,200	1,659.00	33,511,800	
ホーチキ	11,100	1,227.00	13,619,700	
星和電機	7,200	480.00	3,456,000	貸付有価証券 100株
エレコム	38,600	1,509.00	58,247,400	
パナソニック ホールディングス	1,798,100	1,108.00	1,992,294,800	
シャープ	170,800	1,053.00	179,852,400	貸付有価証券 37,900株
アンリツ	108,600	1,447.00	157,144,200	
富士通ゼネラル	45,800	2,458.00	112,576,400	
ソニーグループ	1,056,100	11,370.00	12,007,857,000	貸付有価証券 16,500株
T D K	244,200	4,190.00	1,023,198,000	
帝国通信工業	7,400	1,338.00	9,901,200	
タムラ製作所	62,100	548.00	34,030,800	貸付有価証券 15,000株
アルプスアルパイン	141,600	1,438.00	203,620,800	貸付有価証券 1,400株
池上通信機	5,000	603.00	3,015,000	
日本電波工業	16,900	1,122.00	18,961,800	
鈴木	8,300	801.00	6,648,300	貸付有価証券 100株
メイコー	18,200	3,275.00	59,605,000	

日本トリム	3,200	2,445.00	7,824,000	
ローランド ディー . ジー .	9,900	3,260.00	32,274,000	
フォスター電機	16,100	726.00	11,688,600	
S M K	3,900	2,090.00	8,151,000	
ヨコオ	11,700	2,125.00	24,862,500	
ティアック	26,200	119.00	3,117,800	貸付有価証券 700株(700株)
ホシデン	38,400	1,196.00	45,926,400	
ヒロセ電機	24,600	17,240.00	424,104,000	
日本航空電子工業	35,400	2,023.00	71,614,200	
T O A	18,100	762.00	13,792,200	貸付有価証券 100株
マクセル	31,600	1,323.00	41,806,800	
古野電気	20,000	994.00	19,880,000	
ユニデンホールディング ス	3,700	3,855.00	14,263,500	
スミダコーポレーション	15,800	757.00	11,960,600	
アイコム	5,700	2,403.00	13,697,100	
リオン	6,000	2,412.00	14,472,000	
本多通信工業	13,100	510.00	6,681,000	貸付有価証券 5,600株
横河電機	159,400	2,225.00	354,665,000	
新電元工業	6,100	3,195.00	19,489,500	
アズビル	98,800	3,440.00	339,872,000	貸付有価証券 100株
東亜ディーケーケー	8,300	842.00	6,988,600	貸付有価証券 200株(200株)
日本光電工業	66,600	2,819.00	187,745,400	
チノー	5,300	1,589.00	8,421,700	
共和電業	16,200	319.00	5,167,800	貸付有価証券 100株
日本電子材料	8,100	1,722.00	13,948,200	
堀場製作所	29,700	5,900.00	175,230,000	
アドバンテスト	125,300	7,140.00	894,642,000	
小野測器	6,600	437.00	2,884,200	
エスベック	12,900	1,699.00	21,917,100	
キーエンス	152,800	47,390.00	7,241,192,000	
日置電機	8,100	6,370.00	51,597,000	

シスメックス	128,000	7,870.00	1,007,360,000	
日本マイクロニクス	26,500	1,270.00	33,655,000	
メガチップス	14,900	3,060.00	45,594,000	
OBARA GROUP	6,900	2,899.00	20,003,100	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
澤藤電機	2,000	1,399.00	2,798,000	
原田工業	8,000	916.00	7,328,000	貸付有価証券 3,400株
コーセル	18,700	821.00	15,352,700	
イリソ電子工業	14,200	3,165.00	44,943,000	
オプテックスグループ	27,700	1,982.00	54,901,400	貸付有価証券 2,100株
千代田インテグレ	6,600	1,947.00	12,850,200	
レーザーテック	70,700	15,150.00	1,071,105,000	貸付有価証券 500株
スタンレー電気	111,700	2,165.00	241,830,500	
岩崎電気	5,600	2,591.00	14,509,600	
ウシオ電機	82,000	1,672.00	137,104,000	
岡谷電機産業	12,000	249.00	2,988,000	貸付有価証券 1,000株(900株)
ヘリオス テクノ ホールディング	14,300	289.00	4,132,700	
エノモト	4,700	1,485.00	6,979,500	
日本セラミック	15,700	2,005.00	31,478,500	
遠藤照明	7,700	769.00	5,921,300	
古河電池	12,000	1,166.00	13,992,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
双信電機	8,100	537.00	4,349,700	
山一電機	11,400	1,715.00	19,551,000	貸付有価証券 100株
図研	11,000	2,783.00	30,613,000	
日本電子	33,300	5,180.00	172,494,000	貸付有価証券 100株
カシオ計算機	108,600	1,243.00	134,989,800	
ファナック	147,900	20,990.00	3,104,421,000	貸付有価証券 3,200株
日本シイエムケイ	30,800	430.00	13,244,000	貸付有価証券 100株
エンプラス	4,200	3,110.00	13,062,000	

大真空	21,500	939.00	20,188,500	貸付有価証券 200株
ローム	71,900	9,390.00	675,141,000	
浜松ホトニクス	115,200	5,290.00	609,408,000	
三井ハイテック	15,100	8,840.00	133,484,000	貸付有価証券 2,000株
新光電気工業	49,500	3,550.00	175,725,000	
京セラ	237,200	7,229.00	1,714,718,800	
太陽誘電	77,200	4,770.00	368,244,000	
村田製作所	471,600	7,677.00	3,620,473,200	
双葉電子工業	28,900	646.00	18,669,400	
北陸電気工業	6,300	1,085.00	6,835,500	
ニチコン	47,600	1,261.00	60,023,600	貸付有価証券 200株
日本ケミコン	15,900	1,742.00	27,697,800	
K O A	24,000	1,595.00	38,280,000	
市光工業	20,200	368.00	7,433,600	
小糸製作所	87,000	4,290.00	373,230,000	
ミツバ	27,800	399.00	11,092,200	
S C R E E Nホールディングス	27,500	9,440.00	259,600,000	
キャノン電子	15,500	1,536.00	23,808,000	
キャノン	837,700	3,232.00	2,707,446,400	
リコー	423,400	1,078.00	456,425,200	
象印マホービン	43,100	1,371.00	59,090,100	貸付有価証券 1,700株
M U T O Hホールディングス	2,100	2,027.00	4,256,700	貸付有価証券 300株（100株）
東京エレクトロン	107,000	44,900.00	4,804,300,000	貸付有価証券 1,300株
トヨタ紡織	62,200	2,039.00	126,825,800	
芦森工業	3,200	1,033.00	3,305,600	
ユニプレス	26,800	873.00	23,396,400	
豊田自動織機	125,100	8,210.00	1,027,071,000	
モリタホールディングス	27,000	1,322.00	35,694,000	
三櫻工業	23,300	647.00	15,075,100	
デンソー	343,700	7,295.00	2,507,291,500	
東海理化電機製作所	44,400	1,466.00	65,090,400	

川崎重工業	117,200	2,638.00	309,173,600	貸付有価証券 300株
名村造船所	45,800	416.00	19,052,800	貸付有価証券 18,900株
日本車輛製造	5,600	2,053.00	11,496,800	
三菱ロジスネクスト	22,300	812.00	18,107,600	貸付有価証券 100株
近畿車輛	2,500	1,097.00	2,742,500	
日産自動車	1,988,200	555.80	1,105,041,560	
いすゞ自動車	501,900	1,562.00	783,967,800	
トヨタ自動車	7,970,400	2,156.00	17,184,182,400	貸付有価証券 97,100株
日野自動車	210,500	704.00	148,192,000	
三菱自動車工業	624,000	482.00	300,768,000	貸付有価証券 10,000株
エフテック	11,100	529.00	5,871,900	
レシップホールディングス	6,700	530.00	3,551,000	
G M B	3,000	703.00	2,109,000	
ファルテック	2,900	607.00	1,760,300	
武蔵精密工業	37,600	1,379.00	51,850,400	
日産車体	24,700	582.00	14,375,400	貸付有価証券 10,900株
新明和工業	45,200	1,083.00	48,951,600	
極東開発工業	28,300	1,418.00	40,129,400	
トピー工業	13,000	1,350.00	17,550,000	
ティラド	4,300	2,669.00	11,476,700	
タチエス	28,300	1,115.00	31,554,500	貸付有価証券 100株
N O K	69,500	1,129.00	78,465,500	
フタバ産業	39,100	383.00	14,975,300	
K Y B	15,700	3,020.00	47,414,000	
大同メタル工業	32,300	521.00	16,828,300	
プレス工業	77,500	417.00	32,317,500	
ミクニ	20,200	339.00	6,847,800	
太平洋工業	33,200	1,055.00	35,026,000	
河西工業	20,700	268.00	5,547,600	
アイシン	123,400	4,235.00	522,599,000	

マツダ	507,100	1,155.00	585,700,500	
今仙電機製作所	11,100	582.00	6,460,200	貸付有価証券 200株
本田技研工業	1,264,200	3,398.00	4,295,751,600	貸付有価証券 4,800株
スズキ	351,300	4,128.00	1,450,166,400	貸付有価証券 200株
S U B A R U	456,300	2,601.50	1,187,064,450	
安永	7,200	699.00	5,032,800	
ヤマハ発動機	220,000	2,603.00	572,660,000	貸付有価証券 3,000株
T B K	17,500	340.00	5,950,000	
エクセディ	25,400	1,745.00	44,323,000	
豊田合成	49,900	2,139.00	106,736,100	
愛三工業	26,400	706.00	18,638,400	
盟和産業	2,400	1,019.00	2,445,600	
日本プラスト	12,500	460.00	5,750,000	
ヨロズ	14,000	905.00	12,670,000	
エフ・シー・シー	27,600	1,359.00	37,508,400	
シマノ	64,200	21,870.00	1,404,054,000	
テイ・エス テック	71,200	1,394.00	99,252,800	
ジャムコ	9,800	1,205.00	11,809,000	
テルモ	477,000	3,951.00	1,884,627,000	
クリエートメディック	5,100	988.00	5,038,800	
日機装	45,400	812.00	36,864,800	貸付有価証券 200株
日本エム・ディ・エム	9,700	1,490.00	14,453,000	
島津製作所	206,600	4,270.00	882,182,000	
J M S	13,400	563.00	7,544,200	
クボテック	3,600	262.00	943,200	貸付有価証券 100株（100株）
長野計器	11,500	1,106.00	12,719,000	
ブイ・テクノロジー	7,400	2,785.00	20,609,000	
東京計器	10,700	1,309.00	14,006,300	貸付有価証券 300株（300株）
愛知時計電機	6,500	1,365.00	8,872,500	
インターアクション	8,400	1,822.00	15,304,800	貸付有価証券 1,200株（900株）

オーバル	15,100	295.00	4,454,500	貸付有価証券 100株
東京精密	27,000	4,435.00	119,745,000	
マニー	63,400	1,321.00	83,751,400	
ニコン	244,200	1,634.00	399,022,800	
トプコン	79,300	1,734.00	137,506,200	
オリンパス	838,800	2,694.00	2,259,727,200	
理研計器	12,000	3,605.00	43,260,000	
タムロン	12,200	2,607.00	31,805,400	
H O Y A	325,500	12,005.00	3,907,627,500	
シード	7,900	494.00	3,902,600	
ノーリツ鋼機	15,200	2,322.00	35,294,400	
A & D ホロンホールディングス	18,900	870.00	16,443,000	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
朝日インテック	184,800	1,824.00	337,075,200	
シチズン時計	175,500	552.00	96,876,000	
リズム	5,300	1,713.00	9,078,900	貸付有価証券 100株
大研医器	13,300	488.00	6,490,400	
メニコン	53,300	3,075.00	163,897,500	貸付有価証券 2,900株
シンシア	1,800	436.00	784,800	
松風	6,100	1,619.00	9,875,900	
セイコーホールディングス	23,800	2,750.00	65,450,000	貸付有価証券 300株
ニプロ	119,700	1,060.00	126,882,000	
中本パックス	4,700	1,590.00	7,473,000	
スノーピーク	22,000	2,545.00	55,990,000	貸付有価証券 10,300株（200株）
パラマウントベッドホールディングス	32,300	2,093.00	67,603,900	
トランザクション	10,200	1,081.00	11,026,200	貸付有価証券 600株
粧美堂	4,400	406.00	1,786,400	貸付有価証券 2,000株
ニホンフラッシュ	13,600	1,031.00	14,021,600	
前田工織	16,300	2,701.00	44,026,300	
永大産業	19,600	265.00	5,194,000	
アートネイチャー	14,400	712.00	10,252,800	

バンダイナムコホールディングス	143,300	9,409.00	1,348,309,700	
アイフィスジャパン	4,300	647.00	2,782,100	貸付有価証券 1,700株
共立印刷	24,800	154.00	3,819,200	
SHOEI	15,100	5,100.00	77,010,000	
フランスベッドホールディングス	21,700	900.00	19,530,000	
パイロットコーポレーション	25,500	4,745.00	120,997,500	
萩原工業	10,400	1,074.00	11,169,600	貸付有価証券 2,200株
フジシールインターナショナル	36,700	1,418.00	52,040,600	
タカラトミー	69,600	1,321.00	91,941,600	
広済堂ホールディングス	10,400	1,254.00	13,041,600	貸付有価証券 600株
エステールホールディングス	3,700	634.00	2,345,800	貸付有価証券 1,800株
タカノ	5,800	817.00	4,738,600	貸付有価証券 2,300株
プロネクサス	13,100	1,048.00	13,728,800	
ホクシン	11,900	143.00	1,701,700	貸付有価証券 1,000株（200株）
ウッドワン	5,200	1,116.00	5,803,200	
大建工業	9,000	1,760.00	15,840,000	
凸版印刷	231,900	2,368.00	549,139,200	
大日本印刷	188,200	2,997.00	564,035,400	
共同印刷	4,500	2,465.00	11,092,500	
NISSHA	31,100	1,457.00	45,312,700	
光村印刷	1,400	1,255.00	1,757,000	
TAKARA & COMPANY	9,900	1,810.00	17,919,000	貸付有価証券 1,400株
アシックス	135,800	2,401.00	326,055,800	
ツツミ	4,200	1,899.00	7,975,800	
ローランド	11,700	4,010.00	46,917,000	
小松ウオール工業	5,100	1,859.00	9,480,900	
ヤマハ	98,000	5,290.00	518,420,000	
河合楽器製作所	4,400	2,588.00	11,387,200	



クリナップ	15,700	558.00	8,760,600	
ピジョン	101,900	1,747.00	178,019,300	貸付有価証券 1,800株
兼松サステック	1,100	1,707.00	1,877,700	
キングジム	13,200	882.00	11,642,400	貸付有価証券 300株
リンテック	33,400	2,366.00	79,024,400	
イトーキ	31,100	375.00	11,662,500	貸付有価証券 100株
任天堂	95,200	57,680.00	5,491,136,000	
三菱鉛筆	24,400	1,420.00	34,648,000	貸付有価証券 300株
タカラスタANDARD	29,700	1,233.00	36,620,100	
コクヨ	76,400	1,669.00	127,511,600	
ナカバヤシ	14,100	497.00	7,007,700	
グローブライド	13,400	2,123.00	28,448,200	
オカムラ	50,900	1,107.00	56,346,300	
美津濃	14,800	2,231.00	33,018,800	
東京電力ホールディングス	1,261,600	471.00	594,213,600	
中部電力	489,300	1,296.00	634,132,800	貸付有価証券 5,100株
関西電力	606,000	1,304.00	790,224,000	
中国電力	249,900	846.00	211,415,400	
北陸電力	146,800	510.00	74,868,000	
東北電力	377,300	712.00	268,637,600	貸付有価証券 200株
四国電力	144,000	760.00	109,440,000	
九州電力	330,900	840.00	277,956,000	
北海道電力	146,500	470.00	68,855,000	貸付有価証券 300株
沖縄電力	35,800	1,252.00	44,821,600	貸付有価証券 500株
電源開発	130,900	2,016.00	263,894,400	
エフオン	10,200	531.00	5,416,200	貸付有価証券 200株
イーレックス	22,800	1,994.00	45,463,200	
レノバ	33,100	2,033.00	67,292,300	貸付有価証券 10,600株（7,500株）

東京瓦斯	307,800	2,661.00	819,055,800	
大阪瓦斯	290,800	2,455.00	713,914,000	
東邦瓦斯	69,800	3,090.00	215,682,000	
北海道瓦斯	8,400	1,603.00	13,465,200	
広島ガス	30,400	322.00	9,788,800	
西部ガスホールディングス	17,000	1,773.00	30,141,000	
静岡ガス	41,200	831.00	34,237,200	
メタウォーター	17,500	1,937.00	33,897,500	
SBSホールディングス	12,500	2,628.00	32,850,000	
東武鉄道	157,400	3,040.00	478,496,000	
相鉄ホールディングス	51,400	2,322.00	119,350,800	
東急	403,400	1,529.00	616,798,600	
京浜急行電鉄	197,300	1,433.00	282,730,900	
小田急電鉄	225,000	1,801.00	405,225,000	
京王電鉄	78,500	4,660.00	365,810,000	貸付有価証券 500株
京成電鉄	105,300	3,600.00	379,080,000	貸付有価証券 1,500株
富士急行	18,200	4,135.00	75,257,000	
新京成電鉄	3,900	2,910.00	11,349,000	
東日本旅客鉄道	270,400	6,721.00	1,817,358,400	
西日本旅客鉄道	187,300	4,889.00	915,709,700	
東海旅客鉄道	125,800	15,180.00	1,909,644,000	
西武ホールディングス	208,800	1,414.00	295,243,200	
鴻池運輸	24,800	1,163.00	28,842,400	
西日本鉄道	42,600	2,825.00	120,345,000	
ハマキョウレックス	11,300	2,768.00	31,278,400	
サカイ引越センター	7,800	4,210.00	32,838,000	
近鉄グループホールディングス	153,000	4,100.00	627,300,000	
阪急阪神ホールディングス	190,800	3,670.00	700,236,000	
南海電気鉄道	68,300	2,688.00	183,590,400	
京阪ホールディングス	65,200	3,255.00	212,226,000	
神戸電鉄	3,800	3,220.00	12,236,000	貸付有価証券 1,500株
名古屋鉄道	161,300	2,062.00	332,600,600	

山陽電気鉄道	11,700	2,143.00	25,073,100	貸付有価証券 100株
アルプス物流	11,100	1,103.00	12,243,300	貸付有価証券 300株(300株)
ヤマトホールディングス	223,700	2,120.00	474,244,000	
山九	39,900	3,765.00	150,223,500	
丸運	8,100	237.00	1,919,700	
丸全昭和運輸	11,500	2,903.00	33,384,500	
センコーグループホールディングス	76,700	880.00	67,496,000	
トナミホールディングス	3,300	3,440.00	11,352,000	
ニッコンホールディングス	51,200	2,094.00	107,212,800	
日本石油輸送	1,700	2,496.00	4,243,200	
福山通運	22,400	3,080.00	68,992,000	
セイノーホールディングス	94,200	1,079.00	101,641,800	
エスライン	4,500	840.00	3,780,000	
神奈川中央交通	4,000	3,405.00	13,620,000	貸付有価証券 1,500株
日立物流	30,800	8,630.00	265,804,000	貸付有価証券 7,200株(400株)
丸和運輸機関	29,200	1,347.00	39,332,400	貸付有価証券 5,600株
C & F ロジホールディングス	14,300	1,008.00	14,414,400	
九州旅客鉄道	112,500	2,736.00	307,800,000	
S Gホールディングス	279,300	2,176.00	607,756,800	
NIPPON EXPRESSホールディング	50,000	7,450.00	372,500,000	
日本郵船	133,500	9,140.00	1,220,190,000	貸付有価証券 4,600株
商船三井	252,600	3,020.00	762,852,000	
川崎汽船	49,200	8,170.00	401,964,000	貸付有価証券 11,200株
N S ユナイテッド海運	7,900	3,670.00	28,993,000	貸付有価証券 600株
明治海運	16,300	1,232.00	20,081,600	貸付有価証券 7,500株
飯野海運	66,500	704.00	46,816,000	

共栄タンカー	2,800	988.00	2,766,400	貸付有価証券 100株
乾汽船	10,000	1,719.00	17,190,000	貸付有価証券 3,600株(200株)
日本航空	350,800	2,374.00	832,799,200	貸付有価証券 24,700株
A N Aホールディングス	388,700	2,494.50	969,612,150	貸付有価証券 93,900株
パスコ	3,000	1,304.00	3,912,000	
ランコム	4,500	6,120.00	27,540,000	貸付有価証券 1,900株
日新	12,000	1,550.00	18,600,000	
三菱倉庫	44,500	3,185.00	141,732,500	
三井倉庫ホールディングス	16,100	2,858.00	46,013,800	
住友倉庫	49,700	1,985.00	98,654,500	
澁澤倉庫	8,500	2,151.00	18,283,500	
東陽倉庫	24,000	296.00	7,104,000	
日本トランスシティ	30,500	493.00	15,036,500	
ケイヒン	2,700	1,308.00	3,531,600	
中央倉庫	8,700	966.00	8,404,200	
川西倉庫	2,900	1,106.00	3,207,400	貸付有価証券 1,200株
安田倉庫	11,500	940.00	10,810,000	
ファイズホールディングス	3,400	727.00	2,471,800	貸付有価証券 200株
東洋埠頭	4,600	1,268.00	5,832,800	
上組	82,300	2,573.00	211,757,900	
サンリツ	4,200	710.00	2,982,000	
キムラユニティー	4,200	1,471.00	6,178,200	
キューソー流通システム	8,000	1,112.00	8,896,000	貸付有価証券 3,600株
近鉄エクスプレス	30,100	4,170.00	125,517,000	貸付有価証券 1,000株(700株)
東海運	9,100	293.00	2,666,300	
エーアイティー	10,000	1,442.00	14,420,000	貸付有価証券 300株(300株)
内外トランスライン	6,200	1,878.00	11,643,600	貸付有価証券 2,500株
日本コンセプト	5,100	1,427.00	7,277,700	貸付有価証券

				100株(100株)
NEC ネットエスアイ	54,700	1,806.00	98,788,200	
クロスキャット	8,600	934.00	8,032,400	貸付有価証券 200株
システナ	236,000	392.00	92,512,000	貸付有価証券 500株
デジタルアーツ	8,900	5,380.00	47,882,000	
日鉄ソリューションズ	27,100	3,545.00	96,069,500	
キューブシステム	8,300	896.00	7,436,800	貸付有価証券 3,400株
WOW WORLD	2,300	1,059.00	2,435,700	
コア	7,000	1,443.00	10,101,000	
手間いらず	2,400	4,935.00	11,844,000	貸付有価証券 400株(400株)
ラクーンホールディングス	14,000	1,695.00	23,730,000	貸付有価証券 3,000株(2,600株)
ソリトンシステムズ	8,300	1,181.00	9,802,300	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	7,200	3,640.00	26,208,000	
T I S	149,000	3,225.00	480,525,000	
J N Sホールディングス	7,600	397.00	3,017,200	貸付有価証券 300株
グリー	75,300	797.00	60,014,100	貸付有価証券 35,200株(3,300株)
GMOベパボ	1,700	1,975.00	3,357,500	貸付有価証券 700株(700株)
コーエーテクモホールディングス	52,800	4,230.00	223,344,000	貸付有価証券 1,000株
三菱総合研究所	7,700	4,025.00	30,992,500	
ボルテージ	4,400	344.00	1,513,600	貸付有価証券 200株(100株)
電算	1,800	2,152.00	3,873,600	
A G S	7,200	733.00	5,277,600	
ファインデックス	13,900	640.00	8,896,000	
ブレインパッド	14,000	941.00	13,174,000	
K L a b	29,000	411.00	11,919,000	貸付有価証券 100株
ポールトゥウィンホールディングス	24,000	890.00	21,360,000	

ネクソン	375,800	2,783.00	1,045,851,400	貸付有価証券 100株
アイスタイル	42,700	225.00	9,607,500	貸付有価証券 2,000株(1,100株)
エムアップホールディングス	19,100	1,270.00	24,257,000	
エイチーム	10,700	730.00	7,811,000	
エニグモ	17,900	478.00	8,556,200	貸付有価証券 2,200株(1,300株)
テクノスジャパン	12,800	476.00	6,092,800	
e n i s h	11,300	388.00	4,384,400	貸付有価証券 1,500株(700株)
コロプラ	54,400	611.00	33,238,400	貸付有価証券 2,800株
オルトプラス	12,100	359.00	4,343,900	貸付有価証券 900株(300株)
ブロードリーフ	82,000	433.00	35,506,000	貸付有価証券 43,600株
クロス・マーケティンググループ	6,300	808.00	5,090,400	貸付有価証券 2,900株(1,600株)
デジタルハーツホールディングス	7,500	1,530.00	11,475,000	
システム情報	12,400	920.00	11,408,000	
メディアドゥ	5,800	1,620.00	9,396,000	貸付有価証券 300株
じげん	46,800	304.00	14,227,200	貸付有価証券 200株
ブイキューブ	16,800	991.00	16,648,800	貸付有価証券 7,800株(5,400株)
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	515.00	1,854,000	
サイバーリンクス	5,500	1,213.00	6,671,500	
ディー・エル・イー	11,100	314.00	3,485,400	貸付有価証券 4,700株(2,800株)
フィックスターズ	16,400	875.00	14,350,000	
C A R T A H O L D I N G S	6,700	1,827.00	12,240,900	貸付有価証券 1,000株(200株)
オブティム	11,500	685.00	7,877,500	
セレス	6,200	1,105.00	6,851,000	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
S H I F T	9,600	16,850.00	161,760,000	

ティーガイア	14,700	1,607.00	23,622,900	
セック	2,400	2,494.00	5,985,600	
テクマトリックス	28,000	1,555.00	43,540,000	
プロシップ	5,500	1,423.00	7,826,500	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	43,000	2,305.00	99,115,000	貸付有価証券 600株
GMOペイメントゲートウェイ	32,100	8,650.00	277,665,000	
ザッパラス	6,000	367.00	2,202,000	貸付有価証券 100株
システムリサーチ	4,800	2,005.00	9,624,000	
インターネットイニシアティブ	44,100	4,580.00	201,978,000	
さくらインターネット	17,700	535.00	9,469,500	
ヴィンクス	4,600	1,206.00	5,547,600	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,700	4,735.00	17,519,500	貸付有価証券 1,600株(1,100株)
SRAホールディングス	8,000	2,763.00	22,104,000	
システムインテグレータ	5,200	479.00	2,490,800	貸付有価証券 200株
朝日ネット	15,100	558.00	8,425,800	
eBASE	19,700	521.00	10,263,700	貸付有価証券 200株
アバント	17,700	1,290.00	22,833,000	
アドソル日進	5,900	1,496.00	8,826,400	貸付有価証券 100株(100株)
ODKソリューションズ	3,400	583.00	1,982,200	
フリービット	8,600	755.00	6,493,000	貸付有価証券 300株
コムチュア	18,600	2,497.00	46,444,200	
サイバーコム	2,500	1,235.00	3,087,500	
アステリア	11,900	966.00	11,495,400	
アイル	8,300	1,530.00	12,699,000	
マークライnz	8,300	1,977.00	16,409,100	
メディカル・データ・ビジョン	21,000	974.00	20,454,000	貸付有価証券 2,800株
gumi	22,900	623.00	14,266,700	貸付有価証券 8,200株(7,500株)
ショーケース	3,600	441.00	1,587,600	

モバイルファクトリー	3,700	1,201.00	4,443,700	貸付有価証券 900株(900株)
テラスカイ	6,000	1,386.00	8,316,000	貸付有価証券 2,800株(1,000株)
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,300	1,314.00	9,592,200	
P C Iホールディングス	6,800	894.00	6,079,200	
パイブドHD	3,000	2,761.00	8,283,000	
アイピーシー	2,500	442.00	1,105,000	貸付有価証券 300株(300株)
ネオジャパン	4,700	1,050.00	4,935,000	貸付有価証券 700株(700株)
P R T I M E S	3,500	1,897.00	6,639,500	貸付有価証券 1,500株(1,200株)
ラクス	75,900	1,307.00	99,201,300	貸付有価証券 1,300株
ランドコンピュータ	3,800	980.00	3,724,000	貸付有価証券 100株(100株)
ダブルスタンダード	5,000	1,849.00	9,245,000	
オープンドア	9,800	1,756.00	17,208,800	貸付有価証券 4,600株(2,300株)
マイネット	5,900	484.00	2,855,600	
アカツキ	7,400	2,619.00	19,380,600	
ベネフィットジャパン	1,200	1,879.00	2,254,800	
U b i c o mホールディングス	4,300	2,210.00	9,503,000	貸付有価証券 1,300株
カナミックネットワーク	19,300	529.00	10,209,700	
ノムラシステムコーポレーション	8,500	238.00	2,023,000	貸付有価証券 1,000株
チェンジ	33,100	1,732.00	57,329,200	貸付有価証券 7,800株(3,500株)
シンクロ・フード	8,400	378.00	3,175,200	
オークネット	8,800	2,089.00	18,383,200	貸付有価証券 3,500株
キャピタル・アセット・プランニング	3,100	658.00	2,039,800	
セグエグループ	4,300	537.00	2,309,100	
エイトレッド	2,300	1,949.00	4,482,700	貸付有価証券 1,300株
マクロミル	33,200	926.00	30,743,200	
ピーグリー	3,900	1,325.00	5,167,500	貸付有価証券



				900株
オロ	5,100	1,485.00	7,573,500	貸付有価証券 300株(300株)
ユーザーローカル	5,000	1,590.00	7,950,000	
テモナ	3,200	358.00	1,145,600	
ニーズウェル	4,400	639.00	2,811,600	
マネーフォワード	33,700	3,105.00	104,638,500	貸付有価証券 600株
サインポスト	5,300	802.00	4,250,600	貸付有価証券 1,000株(400株)
電算システムホールディングス	6,800	2,157.00	14,667,600	
ソルクシーズ	14,000	363.00	5,082,000	
フェイス	4,300	600.00	2,580,000	
プロトコーポレーション	17,600	973.00	17,124,800	
ハイマックス	4,400	1,286.00	5,658,400	
野村総合研究所	298,300	3,475.00	1,036,592,500	貸付有価証券 8,600株
サイバネットシステム	11,800	768.00	9,062,400	貸付有価証券 200株
C Eホールディングス	8,200	409.00	3,353,800	貸付有価証券 100株
日本システム技術	3,000	2,419.00	7,257,000	
インテージホールディングス	19,000	1,302.00	24,738,000	
東邦システムサイエンス	4,400	875.00	3,850,000	貸付有価証券 1,700株
ソースネクスト	71,300	222.00	15,828,600	貸付有価証券 12,800株(10,400株)
インフォコム	18,100	2,018.00	36,525,800	
シンプレクス・ホールディングス	26,200	1,711.00	44,828,200	貸付有価証券 3,000株
HEROZ	4,700	789.00	3,708,300	貸付有価証券 100株
ラクスル	19,200	1,620.00	31,104,000	貸付有価証券 9,000株(2,700株)
I P S	4,500	2,161.00	9,724,500	貸付有価証券 100株(100株)
F I G	18,000	302.00	5,436,000	貸付有価証券 7,700株
システムサポート	6,000	1,151.00	6,906,000	

イーソル	10,100	565.00	5,706,500	貸付有価証券 2,300株(500株)
アルテリア・ネットワークス	17,400	1,167.00	20,305,800	
東海ソフト	2,600	922.00	2,397,200	
ウイングアーク1st	12,600	1,468.00	18,496,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	3,700	1,463.00	5,413,100	
サーバーワークス	2,800	2,059.00	5,765,200	貸付有価証券 900株(200株)
東名	1,300	1,119.00	1,454,700	
ヴィッツ	1,500	1,041.00	1,561,500	
トピラスシステムズ	3,300	853.00	2,814,900	
Sansan	54,500	805.00	43,872,500	貸付有価証券 4,500株
Link-U	3,000	656.00	1,968,000	貸付有価証券 500株(500株)
ギフトィ	14,100	1,101.00	15,524,100	貸付有価証券 6,600株(6,500株)
ベース	2,800	5,410.00	15,148,000	
JMDC	20,700	5,190.00	107,433,000	貸付有価証券 400株
フォーカスシステムズ	10,500	898.00	9,429,000	
クレスコ	12,000	1,851.00	22,212,000	
フジ・メディア・ホールディングス	151,200	1,128.00	170,553,600	
オーピック	52,100	18,350.00	956,035,000	貸付有価証券 100株
ジャストシステム	23,500	3,590.00	84,365,000	
TDCソフト	13,600	1,021.00	13,885,600	
Zホールディングス	2,385,500	399.10	952,053,050	
トレンドマイクロ	83,500	6,470.00	540,245,000	
IDホールディングス	10,400	830.00	8,632,000	
日本オラクル	26,900	7,560.00	203,364,000	
アルファシステムズ	4,400	4,070.00	17,908,000	
フューチャー	34,900	1,420.00	49,558,000	
CAC Holdings	9,000	1,420.00	12,780,000	
SBテクノロジー	7,100	2,240.00	15,904,000	

トーセ	4,200	752.00	3,158,400	
オービックビジネスコン サルタント	15,800	4,060.00	64,148,000	
伊藤忠テクノソリュー ションズ	75,400	3,155.00	237,887,000	
アイティフォー	20,000	756.00	15,120,000	
東計電算	2,000	5,650.00	11,300,000	
エックスネット	2,600	1,005.00	2,613,000	
大塚商会	89,500	3,875.00	346,812,500	貸付有価証券 300株
サイボウズ	22,100	829.00	18,320,900	貸付有価証券 300株
電通国際情報サービス	21,600	3,660.00	79,056,000	
A C C E S S	18,700	683.00	12,772,100	
デジタルガレージ	27,400	3,785.00	103,709,000	
E Mシステムズ	27,300	1,011.00	27,600,300	貸付有価証券 1,000株
ウェザーニューズ	5,200	5,890.00	30,628,000	貸付有価証券 100株
C I J	12,800	757.00	9,689,600	
ビジネスエンジニアリン グ	3,800	2,215.00	8,417,000	貸付有価証券 1,600株（300株）
日本エンタープライズ	16,800	155.00	2,604,000	
WOWOW	7,200	1,500.00	10,800,000	貸付有価証券 3,200株
スカラ	13,900	738.00	10,258,200	
インテリジェント ウェ イブ	8,300	775.00	6,432,500	貸付有価証券 2,300株
I M A G I C A G R O U P	12,500	705.00	8,812,500	
ネットワンシステムズ	61,000	2,888.00	176,168,000	
システムソフト	44,400	99.00	4,395,600	貸付有価証券 6,100株
アルゴグラフィックス	12,900	3,115.00	40,183,500	
マーベラス	26,100	665.00	17,356,500	
エイベックス	28,500	1,305.00	37,192,500	
B I P R O G Y	51,700	2,749.00	142,123,300	
兼松エレクトロニクス	9,000	3,960.00	35,640,000	
都築電気	7,700	1,251.00	9,632,700	

TBSホールディングス	86,800	1,703.00	147,820,400	
日本テレビホールディングス	138,100	1,218.00	168,205,800	
朝日放送グループホールディングス	14,200	645.00	9,159,000	貸付有価証券 1,500株
テレビ朝日ホールディングス	39,800	1,471.00	58,545,800	貸付有価証券 1,100株
スカパーJ S A Tホールディングス	140,100	519.00	72,711,900	
テレビ東京ホールディングス	10,700	1,988.00	21,271,600	
日本BS放送	5,600	1,044.00	5,846,400	貸付有価証券 2,400株
ビジョン	27,200	1,247.00	33,918,400	貸付有価証券 4,500株
スマートバリュー	3,800	464.00	1,763,200	
USEN-NEXT HOLDINGS	13,600	1,809.00	24,602,400	貸付有価証券 5,300株(400株)
ワイヤレスゲート	6,800	304.00	2,067,200	
コネクシオ	11,700	1,274.00	14,905,800	
日本通信	137,600	191.00	26,281,600	貸付有価証券 17,800株(17,800株)
クロップス	3,000	1,030.00	3,090,000	
日本電信電話	1,812,900	3,934.00	7,131,948,600	貸付有価証券 42,300株
KDDI	1,206,000	4,466.00	5,385,996,000	貸付有価証券 23,300株
ソフトバンク	2,505,500	1,499.50	3,756,997,250	貸付有価証券 3,000株
光通信	19,100	13,790.00	263,389,000	
エムティーアイ	13,900	438.00	6,088,200	
GMOインターネット	57,900	2,215.00	128,248,500	
ファイバーゲート	7,500	887.00	6,652,500	貸付有価証券 3,500株(1,700株)
アイドママーケティングコミュニケーション	3,500	300.00	1,050,000	
KADOKAWA	89,500	2,846.00	254,717,000	
学研ホールディングス	23,400	876.00	20,498,400	
ゼンリン	27,000	910.00	24,570,000	
昭文社ホールディングス	6,700	369.00	2,472,300	貸付有価証券

				300株(300株)
インプレスホールディングス	13,700	216.00	2,959,200	
アイネット	7,900	1,213.00	9,582,700	
松竹	10,000	12,250.00	122,500,000	
東宝	97,600	4,735.00	462,136,000	
東映	4,900	17,950.00	87,955,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	440,400	1,865.00	821,346,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
ピー・シー・エー	9,700	1,133.00	10,990,100	
ビジネスブレイン太田昭和	5,200	1,336.00	6,947,200	
D T S	30,800	3,015.00	92,862,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	77,000	5,980.00	460,460,000	
シーイーシー	17,700	1,091.00	19,310,700	貸付有価証券 300株
カプコン	156,000	3,185.00	496,860,000	貸付有価証券 1,400株
アイ・エス・ピー	7,700	996.00	7,669,200	
ジャステック	9,600	1,135.00	10,896,000	
S C S K	114,500	2,201.00	252,014,500	
日本システムウエア	6,200	2,338.00	14,495,600	
アイネス	13,900	1,554.00	21,600,600	
T K C	26,100	3,120.00	81,432,000	
富士ソフト	16,500	7,340.00	121,110,000	貸付有価証券 5,700株(2,600株)
N S D	51,800	2,304.00	119,347,200	
コナミホールディングス	60,100	7,740.00	465,174,000	
福井コンピュータホールディングス	7,600	3,250.00	24,700,000	
J B C Cホールディングス	11,200	1,524.00	17,068,800	
ミロク情報サービス	14,600	1,076.00	15,709,600	
ソフトバンクグループ	992,000	5,025.00	4,984,800,000	貸付有価証券 17,800株
高千穂交易	6,000	1,820.00	10,920,000	貸付有価証券 2,100株
オルパヘルスケアホールディングス	2,700	1,770.00	4,779,000	貸付有価証券 1,200株

伊藤忠食品	3,600	4,835.00	17,406,000	
エレマテック	13,300	1,243.00	16,531,900	
あらた	12,600	3,750.00	47,250,000	
トーメンデバイス	2,500	5,580.00	13,950,000	
東京エレクトロン デバイス	4,900	5,080.00	24,892,000	
フィールズ	14,500	892.00	12,934,000	
双日	174,700	1,851.00	323,369,700	貸付有価証券 6,100株
アルフレッサ ホールディングス	176,300	1,817.00	320,337,100	
横浜冷凍	42,400	854.00	36,209,600	
神栄	2,400	862.00	2,068,800	
ラサ商事	7,700	964.00	7,422,800	
アルコニックス	20,900	1,276.00	26,668,400	
神戸物産	119,300	3,175.00	378,777,500	貸付有価証券 9,700株（2,600株）
ハイパー	4,100	453.00	1,857,300	貸付有価証券 100株（100株）
あい ホールディングス	23,700	1,549.00	36,711,300	貸付有価証券 100株
ディービーエックス	5,600	1,039.00	5,818,400	
ダイワボウホールディングス	74,000	1,682.00	124,468,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	39,600	2,601.00	102,999,600	
ラクト・ジャパン	5,700	2,035.00	11,599,500	貸付有価証券 100株（100株）
グリムス	7,400	1,381.00	10,219,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,200	705.00	19,176,000	
八洲電機	12,000	960.00	11,520,000	貸付有価証券 5,100株
メディアスホールディングス	9,500	972.00	9,234,000	貸付有価証券 4,400株
レスターホールディングス	15,700	1,911.00	30,002,700	貸付有価証券 4,000株
ジューテックホールディングス	3,400	1,014.00	3,447,600	貸付有価証券 1,600株
大光	7,000	703.00	4,921,000	貸付有価証券

				3,000株(400株)
OCHIホールディングス	4,100	1,220.00	5,002,000	
TOKAIホールディングス	80,400	856.00	68,822,400	
黒谷	4,500	584.00	2,628,000	貸付有価証券 2,100株(800株)
Cominix	2,900	730.00	2,117,000	
三洋貿易	15,700	956.00	15,009,200	
ビューティガレージ	2,700	2,369.00	6,396,300	貸付有価証券 1,200株(1,000株)
ウイン・パートナーズ	12,000	1,002.00	12,024,000	
ミタチ産業	4,200	907.00	3,809,400	
シップヘルスケアホールディングス	49,700	2,369.00	117,739,300	貸付有価証券 2,100株
明治電機工業	5,100	1,069.00	5,451,900	
デリカフーズホールディングス	6,400	515.00	3,296,000	貸付有価証券 2,600株
スターティアホールディングス	3,800	740.00	2,812,000	
コメダホールディングス	36,200	2,257.00	81,703,400	
ピーバンドットコム	2,300	540.00	1,242,000	
アセンテック	5,700	607.00	3,459,900	貸付有価証券 2,600株
富士興産	4,100	1,047.00	4,292,700	
協栄産業	1,700	1,364.00	2,318,800	
フルサト・マルカホールディングス	15,100	2,404.00	36,300,400	貸付有価証券 600株
ヤマエグループホールディングス	9,900	1,208.00	11,959,200	
小野建	15,300	1,387.00	21,221,100	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
南陽	3,200	1,766.00	5,651,200	
佐鳥電機	10,300	1,063.00	10,948,900	貸付有価証券 400株(100株)
エコトレーディング	3,500	569.00	1,991,500	
伯東	10,100	2,578.00	26,037,800	
コンドーテック	12,400	1,005.00	12,462,000	
中山福	8,700	318.00	2,766,600	貸付有価証券 100株(100株)

ナガイレーベン	20,700	1,834.00	37,963,800	
三菱食品	16,000	3,410.00	54,560,000	
松田産業	12,100	2,020.00	24,442,000	
第一興商	31,500	3,745.00	117,967,500	貸付有価証券 1,600株
メディopalホールディング グス	162,100	1,918.00	310,907,800	貸付有価証券 300株
S P K	6,600	1,358.00	8,962,800	
萩原電気ホールディング ス	5,800	1,937.00	11,234,600	
アズワン	23,800	5,570.00	132,566,000	貸付有価証券 400株
スズデン	5,400	1,872.00	10,108,800	
尾家産業	4,000	831.00	3,324,000	
シモジマ	10,200	937.00	9,557,400	
ドウシヤ	15,600	1,508.00	23,524,800	貸付有価証券 6,800株
小津産業	3,600	1,858.00	6,688,800	貸付有価証券 900株
高速	9,100	1,505.00	13,695,500	
たけびし	5,800	1,448.00	8,398,400	
リックス	3,500	1,835.00	6,422,500	貸付有価証券 100株
丸文	13,700	725.00	9,932,500	
ハビネット	13,000	1,578.00	20,514,000	
橋本総業ホールディング ス	3,100	1,930.00	5,983,000	
日本ライフライン	49,200	905.00	44,526,000	
タカショー	12,800	747.00	9,561,600	貸付有価証券 4,100株
I D O M	50,300	708.00	35,612,400	貸付有価証券 100株
進和	9,800	2,116.00	20,736,800	
エスケイジャパン	4,000	452.00	1,808,000	貸付有価証券 1,200株
ダイترون	6,600	1,858.00	12,262,800	
シークス	22,000	957.00	21,054,000	
田中商事	5,100	597.00	3,044,700	
オーハシテクニカ	8,400	1,311.00	11,012,400	



白銅	5,300	2,315.00	12,269,500	
ダイコー通産	2,000	1,118.00	2,236,000	
伊藤忠商事	1,050,800	3,686.00	3,873,248,800	
丸紅	1,516,600	1,245.50	1,888,925,300	
高島	2,400	2,467.00	5,920,800	
長瀬産業	80,200	1,825.00	146,365,000	
蝶理	9,300	1,929.00	17,939,700	
豊田通商	154,400	4,490.00	693,256,000	
三共生興	21,200	552.00	11,702,400	
兼松	59,000	1,326.00	78,234,000	
ツカモトコーポレーション	2,800	1,104.00	3,091,200	
三井物産	1,232,100	3,010.00	3,708,621,000	
日本紙パルプ商事	8,100	3,730.00	30,213,000	
カメイ	18,400	1,035.00	19,044,000	
東都水産	800	4,640.00	3,712,000	貸付有価証券 400株
OUGホールディングス	2,400	2,759.00	6,621,600	
スターゼン	11,600	1,975.00	22,910,000	
山善	63,200	957.00	60,482,400	貸付有価証券 200株
椿本興業	2,900	3,520.00	10,208,000	
住友商事	1,004,300	1,816.00	1,823,808,800	
内田洋行	6,700	5,040.00	33,768,000	
三菱商事	1,140,600	4,061.00	4,631,976,600	
第一実業	6,800	3,290.00	22,372,000	
キャノンマーケティング ジャパン	41,200	2,831.00	116,637,200	
西華産業	7,500	1,587.00	11,902,500	
佐藤商事	12,200	1,107.00	13,505,400	
菱洋エレクトロ	9,800	2,190.00	21,462,000	貸付有価証券 400株
東京産業	14,000	707.00	9,898,000	
ユアサ商事	14,100	3,335.00	47,023,500	
神鋼商事	3,700	3,750.00	13,875,000	
トルク	8,800	197.00	1,733,600	
阪和興業	30,300	2,702.00	81,870,600	
正栄食品工業	10,700	3,530.00	37,771,000	貸付有価証券

				4,800株
カナデン	13,500	999.00	13,486,500	
菱電商事	13,100	1,563.00	20,475,300	
岩谷産業	37,800	4,960.00	187,488,000	
ナイス	5,300	1,618.00	8,575,400	
ニチモウ	2,100	2,350.00	4,935,000	
極東貿易	4,800	2,644.00	12,691,200	
アステナホールディングス	22,000	415.00	9,130,000	
三愛オブリ	38,400	959.00	36,825,600	
稲畑産業	33,200	2,199.00	73,006,800	
G S Iクレオス	7,900	1,314.00	10,380,600	貸付有価証券 3,300株
明和産業	15,300	707.00	10,817,100	貸付有価証券 7,100株（300株）
クワザワホールディングス	6,100	459.00	2,799,900	
ワキタ	31,800	1,150.00	36,570,000	
東邦ホールディングス	47,800	2,047.00	97,846,600	貸付有価証券 9,300株
サンゲツ	41,300	1,532.00	63,271,600	
ミツウロコグループホールディングス	20,600	862.00	17,757,200	
シナネンホールディングス	5,700	3,400.00	19,380,000	
伊藤忠エネクス	36,700	1,028.00	37,727,600	
サンリオ	48,200	2,555.00	123,151,000	
サンワテクノス	9,000	1,306.00	11,754,000	
リョーサン	17,400	2,221.00	38,645,400	
新光商事	22,900	878.00	20,106,200	
トーヨー	6,700	1,285.00	8,609,500	貸付有価証券 200株（100株）
三信電気	7,100	1,533.00	10,884,300	
東陽テクニカ	16,400	1,085.00	17,794,000	
モスフードサービス	21,800	3,035.00	66,163,000	
加賀電子	14,000	3,000.00	42,000,000	
ソーダニッカ	14,600	580.00	8,468,000	
立花エレテック	11,500	1,527.00	17,560,500	
フォーバル	6,300	834.00	5,254,200	

PALTAC	23,300	4,025.00	93,782,500	
三谷産業	25,900	311.00	8,054,900	
太平洋興発	6,100	620.00	3,782,000	
西本Wismettac ホールディングス	3,800	3,915.00	14,877,000	
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,500	1,827.00	2,740,500	
コア商事ホールディン グス	10,400	731.00	7,602,400	貸付有価証券 4,600株（400株）
国際紙パルプ商事	31,900	466.00	14,865,400	
ヤマタネ	7,300	1,572.00	11,475,600	
丸紅建材リース	1,400	1,912.00	2,676,800	
日鉄物産	10,700	4,985.00	53,339,500	
泉州電業	4,300	4,835.00	20,790,500	貸付有価証券 1,200株
トラスコ中山	34,500	1,698.00	58,581,000	
オートボックスセブン	53,000	1,354.00	71,762,000	
モリト	12,100	757.00	9,159,700	貸付有価証券 100株
加藤産業	20,000	3,045.00	60,900,000	
北恵	4,200	870.00	3,654,000	貸付有価証券 1,700株
イノテック	10,000	1,285.00	12,850,000	
イエローハット	27,000	1,633.00	44,091,000	
J Kホールディングス	12,200	912.00	11,126,400	
日伝	12,100	1,857.00	22,469,700	
北沢産業	9,600	215.00	2,064,000	
杉本商事	7,800	2,103.00	16,403,400	
因幡電機産業	42,300	2,636.00	111,502,800	
東テク	5,100	2,880.00	14,688,000	
ミスミグループ本社	208,400	2,671.00	556,636,400	
アルテック	10,500	236.00	2,478,000	
タキヒヨー	4,600	976.00	4,489,600	貸付有価証券 1,000株
蔵王産業	3,200	1,880.00	6,016,000	
スズケン	61,300	3,830.00	234,779,000	
ジェコス	11,400	806.00	9,188,400	
グローセル	18,400	402.00	7,396,800	

ローソン	36,700	4,365.00	160,195,500	
サンエー	11,700	3,990.00	46,683,000	
カワチ薬品	12,900	2,085.00	26,896,500	
エービーシー・マート	25,900	5,670.00	146,853,000	
ハードオフコーポレーション	7,300	898.00	6,555,400	
アスクル	37,600	1,430.00	53,768,000	貸付有価証券 1,400株
ゲオホールディングス	20,700	1,207.00	24,984,900	
アダストリア	17,900	1,935.00	34,636,500	貸付有価証券 100株
ジーフット	10,000	326.00	3,260,000	貸付有価証券 4,700株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,400	408.00	979,200	
くら寿司	17,300	3,130.00	54,149,000	貸付有価証券 3,800株（3,100株）
キャンドゥ	6,100	2,153.00	13,133,300	貸付有価証券 2,800株（1,000株）
アイケイ	5,200	488.00	2,537,600	貸付有価証券 900株（300株）
パルグループホールディングス	14,500	1,718.00	24,911,000	
エディオン	76,200	1,194.00	90,982,800	貸付有価証券 22,700株（12,200株）
サーラコーポレーション	33,700	649.00	21,871,300	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
ワッツ	8,000	713.00	5,704,000	貸付有価証券 3,700株
ハローズ	7,600	2,888.00	21,948,800	
フジオフードグループ本社	12,900	1,380.00	17,802,000	貸付有価証券 6,000株
あみやき亭	3,900	2,904.00	11,325,600	
ひらまつ	35,200	197.00	6,934,400	
大黒天物産	5,300	3,880.00	20,564,000	貸付有価証券 1,300株（900株）
ハニーズホールディングス	13,600	1,149.00	15,626,400	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
ファーマライズホールディングス	3,700	713.00	2,638,100	貸付有価証券 1,600株
アルペン	12,300	1,999.00	24,587,700	貸付有価証券

				5,700株
ハブ	5,400	554.00	2,991,600	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
クオールホールディングス	20,400	1,320.00	26,928,000	
ジンスホールディングス	9,600	3,900.00	37,440,000	
ビックカメラ	98,500	1,120.00	110,320,000	貸付有価証券 13,200株(1,800株)
DCMホールディングス	98,600	1,013.00	99,881,800	
Monotaro	209,900	1,706.00	358,089,400	
東京一番フーズ	3,900	598.00	2,332,200	
DDホールディングス	8,700	623.00	5,420,100	貸付有価証券 100株(100株)
きちりホールディングス	4,400	411.00	1,808,400	貸付有価証券 2,000株
アークランドサービス ホールディングス	12,100	2,108.00	25,506,800	貸付有価証券 5,600株
J.フロント リテイ リング	188,800	1,132.00	213,721,600	
ドトール・日レスホール ディングス	27,100	1,512.00	40,975,200	
マツキヨココカラ&カン パニー	98,900	5,210.00	515,269,000	
ブロンコビリー	8,900	2,450.00	21,805,000	貸付有価証券 4,200株
ZOZO	114,200	2,414.00	275,678,800	
トレジャー・ファクト リー	4,900	1,074.00	5,262,600	
物語コーポレーション	8,200	5,740.00	47,068,000	貸付有価証券 3,800株
三越伊勢丹ホールディ ングス	263,000	1,072.00	281,936,000	
Hamee	6,000	988.00	5,928,000	貸付有価証券 2,000株
マーケットエンタープラ イズ	1,700	1,019.00	1,732,300	貸付有価証券 500株(400株)
ウエルシアホールディ ングス	87,800	2,404.00	211,071,200	
クリエイティブSDホー ルディングス	24,500	2,763.00	67,693,500	
丸善CHIホールディ ングス	19,400	382.00	7,410,800	貸付有価証券 9,100株

ミサワ	3,400	618.00	2,101,200	貸付有価証券 1,400株
ティーライフ	2,200	1,377.00	3,029,400	
エー・ピーホールディングス	3,200	444.00	1,420,800	
チムニー	5,100	1,203.00	6,135,300	貸付有価証券 2,100株
シュッピン	13,800	1,356.00	18,712,800	貸付有価証券 2,300株（2,100株）
オイシックス・ラ・大地	23,900	1,473.00	35,204,700	貸付有価証券 11,200株
ネクステージ	33,700	2,125.00	71,612,500	
ジョイフル本田	49,900	1,536.00	76,646,400	貸付有価証券 19,200株
鳥貴族ホールディングス	5,700	2,239.00	12,762,300	貸付有価証券 2,500株
ホットランド	12,400	1,338.00	16,591,200	貸付有価証券 5,800株（900株）
すかいらーくホールディングス	206,400	1,610.00	332,304,000	貸付有価証券 97,100株（2,600株）
SFPホールディングス	8,100	1,562.00	12,652,200	貸付有価証券 3,800株（500株）
綿半ホールディングス	11,800	1,335.00	15,753,000	
ヨシックスホールディングス	3,200	2,490.00	7,968,000	貸付有価証券 1,400株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	48,200	1,054.00	50,802,800	貸付有価証券 1,300株（800株）
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,600	1,396.00	12,005,600	貸付有価証券 4,000株（200株）
B E E N O S	8,400	2,184.00	18,345,600	貸付有価証券 3,900株（300株）
あさひ	13,700	1,281.00	17,549,700	貸付有価証券 6,000株
日本調剤	10,100	1,267.00	12,796,700	
コスモス薬品	16,700	12,130.00	202,571,000	
トーエル	7,500	874.00	6,555,000	貸付有価証券 3,500株（100株）
セブン & アイ・ホールディングス	587,700	5,215.00	3,064,855,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	103,700	930.00	96,441,000	貸付有価証券 9,400株

ツルハホールディングス	36,200	6,930.00	250,866,000	
サンマルクホールディングス	13,100	1,558.00	20,409,800	
フェリシモ	3,700	1,160.00	4,292,000	貸付有価証券 200株(200株)
トリドールホールディングス	41,300	2,206.00	91,107,800	貸付有価証券 1,700株
TOKYO BASE	15,200	311.00	4,727,200	貸付有価証券 1,400株(900株)
ウイルプラスホールディングス	3,100	892.00	2,765,200	
JMホールディングス	12,100	1,515.00	18,331,500	
サツドラホールディングス	7,400	671.00	4,965,400	貸付有価証券 200株
アレンザホールディングス	11,600	988.00	11,460,800	
串カツ田中ホールディングス	4,400	1,881.00	8,276,400	貸付有価証券 100株
パロックジャパンリミテッド	11,500	797.00	9,165,500	貸付有価証券 2,400株
クスリのアオキホールディングス	15,400	5,290.00	81,466,000	貸付有価証券 1,500株
力の源ホールディングス	8,500	705.00	5,992,500	貸付有価証券 3,900株(100株)
FOOD & LIFE COMPANIE	89,100	2,715.00	241,906,500	
メディカルシステムネットワーク	15,000	408.00	6,120,000	
一家ホールディングス	3,500	580.00	2,030,000	
藤久ホールディングス	5,200	701.00	3,645,200	貸付有価証券 2,400株
はるやまホールディングス	7,800	440.00	3,432,000	貸付有価証券 600株(600株)
ノジマ	26,800	2,805.00	75,174,000	
カップ・クリエイト	23,300	1,421.00	33,109,300	貸付有価証券 400株(200株)
ライトオン	12,400	723.00	8,965,200	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
良品計画	191,000	1,323.00	252,693,000	
パリミキホールディングス	20,500	264.00	5,412,000	
アドヴァングループ	15,000	773.00	11,595,000	

アルビス	5,000	2,211.00	11,055,000	
コナカ	18,500	336.00	6,216,000	
ハウス オブ ローゼ	2,000	1,666.00	3,332,000	
G - 7ホールディングス	18,500	1,389.00	25,696,500	
イオン北海道	24,300	1,071.00	26,025,300	貸付有価証券 300株
コジマ	28,500	600.00	17,100,000	貸付有価証券 12,200株
ヒマラヤ	5,400	960.00	5,184,000	
コーナン商事	23,600	3,530.00	83,308,000	
エコス	5,700	2,083.00	11,873,100	
ワタミ	20,100	914.00	18,371,400	
マルシェ	5,400	453.00	2,446,200	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	332,000	2,026.00	672,632,000	
西松屋チェーン	34,000	1,366.00	46,444,000	貸付有価証券 15,600株
ゼンショーホールディ ングス	81,100	3,240.00	262,764,000	貸付有価証券 3,000株
幸楽苑ホールディングス	10,000	1,298.00	12,980,000	
ハークスレイ	6,900	535.00	3,691,500	
サイゼリヤ	24,600	2,582.00	63,517,200	
V Tホールディングス	62,500	458.00	28,625,000	貸付有価証券 400株
魚力	4,600	2,316.00	10,653,600	貸付有価証券 2,100株
ポブラ	3,900	146.00	569,400	
フジ・コーポレーション	8,800	1,163.00	10,234,400	
ユナイテッドアローズ	17,400	1,879.00	32,694,600	
ハイデイ日高	24,000	2,017.00	48,408,000	貸付有価証券 11,100株
YU - WA Creat ion Holdi	9,700	222.00	2,153,400	貸付有価証券 100株（100株）
コロワイド	68,200	1,805.00	123,101,000	貸付有価証券 32,000株（9,100株）
ピーシーデポコーポレ ーション	19,300	322.00	6,214,600	
壱番屋	11,700	4,875.00	57,037,500	貸付有価証券 700株



トップカルチャー	6,000	255.00	1,530,000	
P L A N T	4,000	661.00	2,644,000	
スギホールディングス	33,100	5,190.00	171,789,000	
薬王堂ホールディングス	8,300	2,044.00	16,965,200	貸付有価証券 600株（600株）
スクロール	25,600	880.00	22,528,000	
ヨンドシーホールディングス	14,400	1,759.00	25,329,600	貸付有価証券 300株
木曽路	22,200	2,133.00	47,352,600	貸付有価証券 8,600株
S R S ホールディングス	23,600	850.00	20,060,000	貸付有価証券 2,600株（900株）
千趣会	30,000	392.00	11,760,000	貸付有価証券 14,100株
タカキュー	12,000	91.00	1,092,000	貸付有価証券 5,300株
リテールパートナーズ	23,600	1,112.00	26,243,200	貸付有価証券 400株
ケーヨー	30,700	907.00	27,844,900	
上新電機	17,100	1,901.00	32,507,100	
日本瓦斯	80,700	1,865.00	150,505,500	
ロイヤルホールディングス	27,400	2,190.00	60,006,000	貸付有価証券 12,900株
東天紅	1,200	929.00	1,114,800	
いなげや	17,800	1,166.00	20,754,800	
チヨダ	14,800	758.00	11,218,400	貸付有価証券 6,700株（100株）
ライフコーポレーション	13,800	2,508.00	34,610,400	
リンガーハット	19,600	2,290.00	44,884,000	貸付有価証券 9,100株
MrMaxHD	20,700	593.00	12,275,100	
テンアライド	16,100	306.00	4,926,600	貸付有価証券 6,300株（100株）
A O K I ホールディングス	32,100	673.00	21,603,300	
オークワ	24,500	863.00	21,143,500	
コメリ	25,600	2,607.00	66,739,200	
青山商事	32,500	871.00	28,307,500	貸付有価証券 3,700株
しまむら	19,300	10,530.00	203,229,000	

はせがわ	8,800	259.00	2,279,200	
高島屋	114,800	1,323.00	151,880,400	貸付有価証券 300株
松屋	29,800	893.00	26,611,400	
エイチ・ツー・オー リテイリング	74,300	988.00	73,408,400	
近鉄百貨店	5,300	2,398.00	12,709,400	
丸井グループ	123,800	2,375.00	294,025,000	
アクシアル リテイリン グ	11,600	2,955.00	34,278,000	
井筒屋	7,800	335.00	2,613,000	貸付有価証券 3,400株（2,700株）
イオン	578,100	2,257.50	1,305,060,750	貸付有価証券 2,700株
イズミ	27,500	2,964.00	81,510,000	
平和堂	25,700	1,908.00	49,035,600	貸付有価証券 12,700株
フジ	39,400	2,171.00	85,537,400	貸付有価証券 3,000株
ヤオコー	18,800	6,170.00	115,996,000	
ゼビオホールディングス	22,600	918.00	20,746,800	
ケーズホールディングス	145,200	1,213.00	176,127,600	貸付有価証券 200株
O l y m p i cグループ	7,700	629.00	4,843,300	
日産東京販売ホールディ ングス	24,400	255.00	6,222,000	
シルバーライフ	3,400	1,550.00	5,270,000	貸付有価証券 1,500株（1,200株）
Genky D r u g S t o r e s	7,300	3,285.00	23,980,500	貸付有価証券 1,900株（700株）
ナルミヤ・インターナ ショナル	3,700	879.00	3,252,300	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	9,700	972.00	9,428,400	貸付有価証券 1,900株（500株）
ギフトホールディングス	2,600	2,147.00	5,582,200	貸付有価証券 600株
アインホールディングス	21,000	6,710.00	140,910,000	
元気寿司	4,600	2,486.00	11,435,600	
ヤマダホールディングス	604,300	468.00	282,812,400	
アークランドサカモト	26,000	1,487.00	38,662,000	

ニトリホールディングス	65,900	11,950.00	787,505,000	
グルメ杵屋	13,200	1,005.00	13,266,000	貸付有価証券 4,800株
愛眼	12,100	180.00	2,178,000	
ケーユーホールディングス	8,700	1,019.00	8,865,300	
吉野家ホールディングス	57,900	2,460.00	142,434,000	貸付有価証券 10,200株
松屋フーズホールディングス	8,000	3,805.00	30,440,000	
サガミホールディングス	24,300	1,131.00	27,483,300	貸付有価証券 10,400株
関西フードマーケット	14,500	1,162.00	16,849,000	貸付有価証券 100株
王将フードサービス	11,000	6,660.00	73,260,000	
プレナス	18,600	1,924.00	35,786,400	貸付有価証券 600株（600株）
ミニストップ	12,300	1,407.00	17,306,100	貸付有価証券 200株（200株）
アークス	30,200	1,953.00	58,980,600	
パローホールディングス	34,900	1,813.00	63,273,700	
ベルク	7,400	5,050.00	37,370,000	
大庄	8,900	1,162.00	10,341,800	貸付有価証券 2,100株
ファーストリテイリング	22,200	69,500.00	1,542,900,000	貸付有価証券 400株
サンドラッグ	62,500	2,827.00	176,687,500	
サックスパーホールディングス	15,600	561.00	8,751,600	貸付有価証券 1,400株（700株）
ヤマザワ	3,600	1,523.00	5,482,800	
やまや	3,400	2,495.00	8,483,000	貸付有価証券 700株
ペルーナ	35,600	707.00	25,169,200	
島根銀行	5,300	497.00	2,634,100	
じもとホールディングス	11,300	576.00	6,508,800	
めぶきフィナンシャルグループ	722,100	261.00	188,468,100	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,800	2,076.00	41,104,800	
九州フィナンシャルグループ	307,200	387.00	118,886,400	貸付有価証券

グループ				400株
ゆうちょ銀行	392,500	1,033.00	405,452,500	貸付有価証券 121,500株
富山第一銀行	37,900	406.00	15,387,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	865,300	466.00	403,229,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	92,600	751.00	69,542,600	貸付有価証券 2,400株
三十三フィナンシャルグループ	14,000	1,372.00	19,208,000	
第四北越フィナンシャルグループ	24,600	2,486.00	61,155,600	
ひろぎんホールディングス	223,500	606.00	135,441,000	
おきなわフィナンシャルグループ	14,400	2,137.00	30,772,800	貸付有価証券 4,000株
十六フィナンシャルグループ	20,300	2,318.00	47,055,400	
北國フィナンシャルホールディングス	14,600	4,710.00	68,766,000	
プロクレアホールディングス	17,200	1,921.00	33,041,200	
新生銀行	108,500	1,996.00	216,566,000	
あおぞら銀行	92,900	2,708.00	251,573,200	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,964,500	749.20	7,465,403,400	
りそなホールディングス	1,801,300	511.40	921,184,820	
三井住友トラスト・ホールディングス	288,100	4,240.00	1,221,544,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,103,000	4,051.00	4,468,253,000	
千葉銀行	498,000	729.00	363,042,000	貸付有価証券 100株
群馬銀行	282,400	379.00	107,029,600	
武蔵野銀行	22,400	1,779.00	39,849,600	
千葉興業銀行	36,900	261.00	9,630,900	貸付有価証券 100株
筑波銀行	64,800	189.00	12,247,200	貸付有価証券 200株
七十七銀行	46,800	1,911.00	89,434,800	
秋田銀行	10,200	1,595.00	16,269,000	

山形銀行	16,200	891.00	14,434,200	
岩手銀行	10,400	1,964.00	20,425,600	
東邦銀行	125,600	202.00	25,371,200	貸付有価証券 300株
東北銀行	7,600	977.00	7,425,200	
ふくおかフィナンシャル グループ	126,700	2,441.00	309,274,700	
静岡銀行	363,400	806.00	292,900,400	貸付有価証券 1,700株
スルガ銀行	145,800	365.00	53,217,000	貸付有価証券 100株
八十二銀行	338,900	474.00	160,638,600	貸付有価証券 2,300株
山梨中央銀行	17,200	1,147.00	19,728,400	
大垣共立銀行	29,900	1,711.00	51,158,900	
福井銀行	13,600	1,324.00	18,006,400	
清水銀行	6,200	1,471.00	9,120,200	
富山銀行	2,700	1,845.00	4,981,500	
滋賀銀行	28,500	2,761.00	78,688,500	
南都銀行	23,600	1,982.00	46,775,200	
百五銀行	146,300	330.00	48,279,000	貸付有価証券 1,000株
京都銀行	54,300	5,830.00	316,569,000	
紀陽銀行	51,700	1,341.00	69,329,700	
ほくほくフィナンシャル グループ	96,600	833.00	80,467,800	
山陰合同銀行	94,500	664.00	62,748,000	
中国銀行	126,100	989.00	124,712,900	
鳥取銀行	5,300	1,166.00	6,179,800	
伊予銀行	197,700	667.00	131,865,900	貸付有価証券 100株
百十四銀行	16,100	1,727.00	27,804,700	
四国銀行	23,000	834.00	19,182,000	
阿波銀行	23,200	2,018.00	46,817,600	
大分銀行	9,100	1,865.00	16,971,500	
宮崎銀行	9,500	2,090.00	19,855,000	
佐賀銀行	9,000	1,456.00	13,104,000	
琉球銀行	36,100	774.00	27,941,400	
セブン銀行	493,800	251.00	123,943,800	

				貸付有価証券 2,200株
みずほフィナンシャルグループ	2,037,900	1,558.00	3,175,048,200	
高知銀行	5,500	732.00	4,026,000	
山口フィナンシャルグループ	175,300	748.00	131,124,400	
長野銀行	5,200	1,285.00	6,682,000	
名古屋銀行	10,800	3,060.00	33,048,000	
北洋銀行	222,800	219.00	48,793,200	貸付有価証券 900株
愛知銀行	5,400	5,490.00	29,646,000	貸付有価証券 100株
中京銀行	5,400	1,701.00	9,185,400	
大光銀行	5,200	1,379.00	7,170,800	
愛媛銀行	22,200	913.00	20,268,600	
トマト銀行	5,300	1,010.00	5,353,000	
京葉銀行	69,400	470.00	32,618,000	
栃木銀行	76,500	254.00	19,431,000	
北日本銀行	4,900	1,555.00	7,619,500	
東和銀行	27,900	512.00	14,284,800	
福島銀行	18,100	222.00	4,018,200	貸付有価証券 200株
大東銀行	7,500	638.00	4,785,000	
トモニホールディングス	122,800	309.00	37,945,200	
フィデアホールディングス	15,200	1,291.00	19,623,200	貸付有価証券 100株
池田泉州ホールディングス	181,400	195.00	35,373,000	貸付有価証券 1,400株
F P G	55,900	908.00	50,757,200	貸付有価証券 1,400株
ジャパンインベストメントアドバイザー	12,900	1,305.00	16,834,500	貸付有価証券 2,500株
マーキュリアホールディングス	8,200	602.00	4,936,400	
S B Iホールディングス	205,300	2,588.00	531,316,400	貸付有価証券 4,900株
日本アジア投資	13,100	241.00	3,157,100	
ジャフコ グループ	63,500	1,612.00	102,362,000	
大和証券グループ本社	1,186,000	608.30	721,443,800	貸付有価証券

				1,400株
野村ホールディングス	2,538,600	496.50	1,260,414,900	
岡三証券グループ	123,500	332.00	41,002,000	貸付有価証券 300株
丸三証券	49,400	478.00	23,613,200	貸付有価証券 2,300株
東洋証券	51,800	186.00	9,634,800	貸付有価証券 4,300株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	172,800	369.00	63,763,200	貸付有価証券 800株
光世証券	3,500	448.00	1,568,000	
水戸証券	41,900	253.00	10,600,700	
いちよし証券	29,600	629.00	18,618,400	貸付有価証券 200株
松井証券	81,400	800.00	65,120,000	
マネックスグループ	138,500	407.00	56,369,500	貸付有価証券 65,000株
極東証券	20,000	687.00	13,740,000	
岩井コスモホールディングス	15,700	1,252.00	19,656,400	
アイザワ証券グループ	24,000	694.00	16,656,000	
マネーパートナーズグループ	17,700	244.00	4,318,800	
スパークス・グループ	76,800	258.00	19,814,400	貸付有価証券 400株
小林洋行	5,900	219.00	1,292,100	
かんぽ生命保険	167,400	2,231.00	373,469,400	
S O M P Oホールディングス	248,700	5,847.00	1,454,148,900	
アニコムホールディングス	51,100	634.00	32,397,400	
M S & A Dインシュアランスグループホール	352,100	4,110.00	1,447,131,000	
第一生命ホールディングス	791,700	2,544.00	2,014,084,800	
東京海上ホールディングス	486,500	7,659.00	3,726,103,500	
T & Dホールディングス	390,500	1,639.00	640,029,500	
アドバンスクリエイト	8,000	977.00	7,816,000	貸付有価証券 3,200株
全国保証	39,700	4,225.00	167,732,500	

あんしん保証	6,600	260.00	1,716,000	
ジェイリース	5,600	1,897.00	10,623,200	貸付有価証券 600株
イントラスト	7,000	550.00	3,850,000	
日本モーゲージサービス	9,200	946.00	8,703,200	
C a s a	5,900	844.00	4,979,600	貸付有価証券 1,900株
アルヒ	24,500	981.00	24,034,500	貸付有価証券 11,500株（9,300株）
プレミアグループ	8,400	3,885.00	32,634,000	貸付有価証券 400株（400株）
ネットプロテクションズ ホールディングス	50,500	455.00	22,977,500	貸付有価証券 21,800株（9,600株）
クレディセゾン	100,300	1,562.00	156,668,600	
芙蓉総合リース	15,300	7,580.00	115,974,000	
みずほリース	22,200	3,065.00	68,043,000	
東京センチュリー	27,900	4,255.00	118,714,500	
日本証券金融	65,300	859.00	56,092,700	
アイフル	279,000	355.00	99,045,000	貸付有価証券 3,500株
リコーリース	14,700	3,435.00	50,494,500	
イオンフィナンシャル サービス	90,400	1,213.00	109,655,200	貸付有価証券 400株
アコム	328,000	317.00	103,976,000	
ジャックス	17,100	3,320.00	56,772,000	
オリエントコーポレー ション	449,800	124.00	55,775,200	貸付有価証券 2,000株
オリックス	987,900	2,321.00	2,292,915,900	
三菱HCキャピタル	563,100	626.00	352,500,600	
九州リースサービス	7,500	571.00	4,282,500	貸付有価証券 1,800株
日本取引所グループ	396,600	2,061.00	817,392,600	
イー・ギャランティ	24,500	2,070.00	50,715,000	
アサックス	8,600	607.00	5,220,200	貸付有価証券 4,500株
NECキャピタルソ リューション	6,800	1,976.00	13,436,800	
いちご	185,200	295.00	54,634,000	貸付有価証券 44,400株
日本駐車場開発	170,200	164.00	27,912,800	貸付有価証券



				100株
スター・マイカ・ホールディングス	9,000	1,516.00	13,644,000	
SREホールディングス	4,200	1,938.00	8,139,600	貸付有価証券 1,900株（400株）
ADワークスグループ	31,300	154.00	4,820,200	貸付有価証券 14,700株
ヒューリック	373,500	1,068.00	398,898,000	貸付有価証券 56,200株
三栄建築設計	6,700	1,589.00	10,646,300	貸付有価証券 400株（400株）
野村不動産ホールディングス	86,000	3,245.00	279,070,000	
三重交通グループホールディングス	33,700	488.00	16,445,600	貸付有価証券 13,700株
サムティ	25,200	2,000.00	50,400,000	貸付有価証券 9,600株
ディア・ライフ	20,700	536.00	11,095,200	
コーセーアールイー	4,900	652.00	3,194,800	貸付有価証券 1,000株（400株）
地主	10,500	2,023.00	21,241,500	貸付有価証券 4,900株
プレサンスコーポレーション	19,300	1,449.00	27,965,700	
ハウスコム	2,900	941.00	2,728,900	
JPMC	8,000	1,020.00	8,160,000	
サンセイランディック	4,900	891.00	4,365,900	貸付有価証券 700株（700株）
エストラスト	1,900	550.00	1,045,000	
フージャースホールディングス	21,300	768.00	16,358,400	
オープンハウスグループ	52,900	5,320.00	281,428,000	貸付有価証券 100株
東急不動産ホールディングス	464,700	716.00	332,725,200	
飯田グループホールディングス	138,700	2,034.00	282,115,800	
イーランド	2,400	1,461.00	3,506,400	
ムゲンエステート	10,200	483.00	4,926,600	貸付有価証券 4,700株（600株）
ビーロッド	11,400	484.00	5,517,600	

ファーストブラザーズ	3,800	862.00	3,275,600	貸付有価証券 1,700株
And Doホールディングス	8,200	870.00	7,134,000	貸付有価証券 3,800株(600株)
シーアールイー	5,700	1,655.00	9,433,500	貸付有価証券 1,400株
プロパティエージェント	1,900	1,419.00	2,696,100	貸付有価証券 1,100株
ケイアイスター不動産	7,500	4,440.00	33,300,000	貸付有価証券 300株
アグレ都市デザイン	2,700	1,422.00	3,839,400	
グッドコムアセット	7,200	1,235.00	8,892,000	
ジェイ・エス・ビー	3,400	3,285.00	11,169,000	
ロードスターキャピタル	4,200	1,701.00	7,144,200	貸付有価証券 1,900株
テンポイノベーション	4,600	832.00	3,827,200	貸付有価証券 100株
グローバル・リンク・マネジメント	2,900	912.00	2,644,800	
フェイスネットワーク	2,100	1,344.00	2,822,400	
パーク24	98,500	1,876.00	184,786,000	
パラカ	4,700	1,756.00	8,253,200	貸付有価証券 1,700株
三井不動産	686,400	2,956.00	2,028,998,400	
三菱地所	995,400	2,011.50	2,002,247,100	
平和不動産	27,100	3,975.00	107,722,500	
東京建物	149,600	1,806.00	270,177,600	
京阪神ビルディング	23,000	1,234.00	28,382,000	
住友不動産	315,700	3,613.00	1,140,624,100	
テーオーシー	26,600	636.00	16,917,600	貸付有価証券 200株
東京楽天地	2,500	3,805.00	9,512,500	貸付有価証券 1,100株
レオパレス21	172,400	245.00	42,238,000	貸付有価証券 200株
スターツコーポレーション	22,600	2,629.00	59,415,400	
フジ住宅	19,300	650.00	12,545,000	
空港施設	16,600	528.00	8,764,800	
明和地所	7,800	613.00	4,781,400	貸付有価証券

				100株
ゴールドクレスト	13,100	1,667.00	21,837,700	
エスリード	6,500	1,646.00	10,699,000	
日神グループホールディングス	27,000	436.00	11,772,000	
日本エスコン	31,000	736.00	22,816,000	
タカラレーベン	69,700	338.00	23,558,600	
A V A N T I A	8,100	840.00	6,804,000	貸付有価証券 300株
イオンモール	83,400	1,617.00	134,857,800	
毎日コムネット	5,700	643.00	3,665,100	貸付有価証券 100株
ファースト住建	6,200	1,063.00	6,590,600	貸付有価証券 300株
カチタス	41,200	2,700.00	111,240,000	
トーセイ	22,900	1,158.00	26,518,200	
穴吹興産	3,600	2,240.00	8,064,000	貸付有価証券 1,600株
サンフロンティア不動産	23,000	1,058.00	24,334,000	
F J ネクストホールディングス	16,300	1,043.00	17,000,900	
インテリックス	3,700	576.00	2,131,200	
ランドビジネス	6,100	230.00	1,403,000	
サンネクスタグループ	5,300	1,093.00	5,792,900	貸付有価証券 100株
グランディハウス	11,300	533.00	6,022,900	
日本空港ビルデング	56,900	5,220.00	297,018,000	
明豊ファシリティワークス	7,400	639.00	4,728,600	
日本工営	10,200	3,270.00	33,354,000	
L I F U L L	49,200	152.00	7,478,400	貸付有価証券 4,200株
ミクシィ	36,900	2,126.00	78,449,400	
ジェイエシーリクルートメント	13,000	1,610.00	20,930,000	
日本M & A センターホールディングス	264,200	1,224.00	323,380,800	
メンバーズ	4,400	2,553.00	11,233,200	
中広	2,600	390.00	1,014,000	
U T グループ	23,200	1,980.00	45,936,000	

アイティメディア	7,600	1,515.00	11,514,000	
E・Jホールディングス	9,300	1,128.00	10,490,400	貸付有価証券 3,900株
夢真ビーネックスグループ	52,500	1,394.00	73,185,000	貸付有価証券 200株
コシダカホールディングス	43,100	742.00	31,980,200	貸付有価証券 9,400株
アルトナー	3,900	847.00	3,303,300	
パソナグループ	17,500	1,776.00	31,080,000	
CDS	4,000	1,773.00	7,092,000	
リンクアンドモチベーション	35,500	452.00	16,046,000	貸付有価証券 16,600株(300株)
エス・エム・エス	54,700	2,496.00	136,531,200	
サニーサイドアップグループ	5,600	550.00	3,080,000	貸付有価証券 300株(300株)
パーソルホールディングス	161,100	2,335.00	376,168,500	貸付有価証券 900株
リニカル	9,100	738.00	6,715,800	
クックパッド	50,600	198.00	10,018,800	貸付有価証券 400株
エスクリ	7,200	386.00	2,779,200	貸付有価証券 3,200株
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,800	626.00	4,882,800	
学情	6,500	850.00	5,525,000	貸付有価証券 2,600株
スタジオアリス	7,200	2,280.00	16,416,000	貸付有価証券 4,100株
シミックホールディングス	8,300	1,378.00	11,437,400	
エプロ	3,400	735.00	2,499,000	貸付有価証券 900株
NJS	3,500	1,930.00	6,755,000	
総合警備保障	60,500	3,665.00	221,732,500	
カカクコム	118,200	1,843.00	217,842,600	
セントケア・ホールディング	10,500	811.00	8,515,500	
サイネックス	2,700	592.00	1,598,400	
ルネサンス	11,200	931.00	10,427,200	貸付有価証券 600株(600株)

ディップ	28,300	3,475.00	98,342,500	貸付有価証券 100株
デジタルホールディングス	11,200	1,285.00	14,392,000	
新日本科学	19,600	1,964.00	38,494,400	
キャリアデザインセンター	3,600	1,088.00	3,916,800	
ベネフィット・ワン	58,600	1,724.00	101,026,400	貸付有価証券 3,200株
エムスリー	284,300	3,575.00	1,016,372,500	
ツカダ・グローバルホールディング	10,300	335.00	3,450,500	貸付有価証券 4,800株（1,700株）
プラス	2,100	997.00	2,093,700	
アウトソーシング	92,300	1,006.00	92,853,800	
ウェルネット	14,900	478.00	7,122,200	貸付有価証券 500株
ワールドホールディングス	6,400	2,130.00	13,632,000	
ディー・エヌ・エー	61,300	1,773.00	108,684,900	貸付有価証券 200株
博報堂DYホールディングス	210,700	1,199.00	252,629,300	
ぐるなび	24,500	379.00	9,285,500	貸付有価証券 100株
タカミヤ	19,500	355.00	6,922,500	
ジャパンベストレスキューシステム	9,700	732.00	7,100,400	
ファンコミュニケーションズ	37,600	387.00	14,551,200	貸付有価証券 100株
ライク	5,400	2,141.00	11,561,400	
ビジネス・ブレークスルー	6,000	443.00	2,658,000	貸付有価証券 1,400株
エスプール	45,500	1,067.00	48,548,500	
WDBホールディングス	7,300	2,116.00	15,446,800	
ティア	9,400	435.00	4,089,000	
CDG	1,700	1,284.00	2,182,800	
アドウェイズ	24,100	648.00	15,616,800	貸付有価証券 3,300株（3,100株）
バリューコマース	12,600	2,956.00	37,245,600	
インフォマート	176,500	346.00	61,069,000	貸付有価証券

				400株
J Pホールディングス	41,400	233.00	9,646,200	貸付有価証券 300株
C Lホールディングス	3,400	918.00	3,121,200	貸付有価証券 1,500株
プレステージ・インター ナショナル	60,400	597.00	36,058,800	
アミューズ	8,800	1,989.00	17,503,200	
ドリームインキュベータ	4,700	2,040.00	9,588,000	貸付有価証券 1,300株
クイック	10,300	1,328.00	13,678,400	
T A C	8,700	222.00	1,931,400	
電通グループ	156,000	4,290.00	669,240,000	
テイクアンドギヴ・ニ ーズ	7,500	1,553.00	11,647,500	
ぴあ	5,100	3,190.00	16,269,000	
イオンファンタジー	6,200	2,562.00	15,884,400	貸付有価証券 2,900株(400株)
シーティーエス	18,200	774.00	14,086,800	
ネクシィーズグループ	5,200	518.00	2,693,600	貸付有価証券 200株(200株)
H . U . グループホール ディングス	42,100	2,784.00	117,206,400	
アルプス技研	13,300	1,744.00	23,195,200	貸付有価証券 100株
ダイオーズ	3,200	1,059.00	3,388,800	貸付有価証券 1,300株
日本空調サービス	16,900	787.00	13,300,300	
オリエンタルランド	177,700	18,175.00	3,229,697,500	
ダスキン	35,600	2,747.00	97,793,200	
明光ネットワークジャ パン	18,900	602.00	11,377,800	
ファルコホールディン グス	7,300	2,057.00	15,016,100	
秀英予備校	3,500	434.00	1,519,000	貸付有価証券 1,400株
ラウンドワン	45,000	1,545.00	69,525,000	
リゾートトラスト	70,100	2,127.00	149,102,700	
ビー・エム・エル	20,500	3,490.00	71,545,000	
りらいあコミュニケー	23,800	1,048.00	24,942,400	

シヨonz				
リソー教育	73,600	318.00	23,404,800	
早稲田アカデミー	9,000	1,120.00	10,080,000	貸付有価証券 2,300株
ユー・エス・エス	180,300	2,322.00	418,656,600	
東京個別指導学院	14,200	613.00	8,704,600	貸付有価証券 1,100株（700株）
サイバーエージェント	361,800	1,291.00	467,083,800	貸付有価証券 100株
楽天グループ	774,200	611.00	473,036,200	貸付有価証券 310,600株（11,200 株）
クリーク・アンド・リ バー社	8,400	1,854.00	15,573,600	
モーニングスター	28,200	496.00	13,987,200	
テー・オー・ダブリュー	30,800	312.00	9,609,600	貸付有価証券 1,800株
山田コンサルティンググ ループ	8,300	1,110.00	9,213,000	
セントラルスポーツ	6,000	2,404.00	14,424,000	貸付有価証券 2,500株
フルキャストホールディ ングス	13,700	2,041.00	27,961,700	
エン・ジャパン	27,800	1,606.00	44,646,800	
リソルホールディングス	1,700	4,630.00	7,871,000	貸付有価証券 600株
テクノプロ・ホールディ ングス	96,500	2,503.00	241,539,500	
アトラグループ	3,600	188.00	676,800	
インターワークス	4,600	371.00	1,706,600	
アイ・アールジャパン ホールディングス	7,500	1,839.00	13,792,500	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
KeepPer 技研	10,400	3,220.00	33,488,000	
ファーストロジック	2,700	776.00	2,095,200	
三機サービス	2,800	1,027.00	2,875,600	貸付有価証券 100株
Gunosy	8,900	999.00	8,891,100	貸付有価証券 600株
デザインワン・ジャパン	4,500	176.00	792,000	
イー・ガーディアン	5,800	2,711.00	15,723,800	
リブセンス	8,800	167.00	1,469,600	貸付有価証券

				500株
ジャパンマテリアル	49,500	1,927.00	95,386,500	
ベクトル	22,600	959.00	21,673,400	貸付有価証券 8,100株
ウチヤマホールディングス	7,900	298.00	2,354,200	貸付有価証券 100株
チャーム・ケア・コーポレーション	12,000	920.00	11,040,000	
キャリアリンク	5,900	1,849.00	10,909,100	
I B J	13,200	707.00	9,332,400	貸付有価証券 6,000株（900株）
アサンテ	7,100	1,495.00	10,614,500	
バリューHR	13,600	1,364.00	18,550,400	貸付有価証券 5,200株
M & Aキャピタルパートナーズ	13,300	3,065.00	40,764,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,200	1,173.00	7,272,600	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
E R Iホールディングス	4,500	1,309.00	5,890,500	貸付有価証券 400株（400株）
アビスト	2,500	2,782.00	6,955,000	
シグマクス・ホールディングス	19,400	989.00	19,186,600	
ウィルグループ	12,000	1,062.00	12,744,000	
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	18,300	161.00	2,946,300	
メドピア	11,700	1,727.00	20,205,900	貸付有価証券 1,200株
レアジョブ	3,000	534.00	1,602,000	貸付有価証券 700株（200株）
リクルートホールディングス	1,183,600	3,934.00	4,656,282,400	貸付有価証券 26,400株
エラン	22,200	1,017.00	22,577,400	
土木管理総合試験所	7,400	327.00	2,419,800	
ネットマーケティング	7,800	703.00	5,483,400	貸付有価証券 2,300株（1,100株）
日本郵政	1,928,400	960.10	1,851,456,840	
ベルシステム24ホールディングス	23,100	1,340.00	30,954,000	
鎌倉新書	18,300	549.00	10,046,700	貸付有価証券 4,800株



SMN	3,500	602.00	2,107,000	
一蔵	2,000	543.00	1,086,000	
グローバルキッズCOMPANY	2,600	703.00	1,827,800	
エアトリ	9,700	2,735.00	26,529,500	貸付有価証券 4,400株(3,900株)
アトラエ	11,200	1,563.00	17,505,600	
ストライク	6,800	3,165.00	21,522,000	
ソラスト	39,600	641.00	25,383,600	
セラク	5,100	1,046.00	5,334,600	貸付有価証券 100株(100株)
インソース	17,100	2,109.00	36,063,900	貸付有価証券 1,600株
ベイカレント・コンサルティング	11,400	32,700.00	372,780,000	
Orchestra Holdings	3,100	2,356.00	7,303,600	貸付有価証券 200株(200株)
アイモバイル	6,900	1,402.00	9,673,800	貸付有価証券 900株
キャリアインデックス	5,500	440.00	2,420,000	
MS - Japan	6,500	869.00	5,648,500	貸付有価証券 200株
船場	3,200	679.00	2,172,800	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グ	51,100	1,350.00	68,985,000	
フルテック	2,200	1,320.00	2,904,000	
グリーンズ	6,100	620.00	3,782,000	
ツナググループ・ホールディングス	4,200	315.00	1,323,000	
GameWith	4,800	478.00	2,294,400	
MS&Consulting	2,300	677.00	1,557,100	
ウェルビー	10,500	678.00	7,119,000	貸付有価証券 100株(100株)
エル・ティー・エス	2,100	3,560.00	7,476,000	貸付有価証券 800株(800株)
ミダックホールディングス	7,300	2,725.00	19,892,500	貸付有価証券 3,400株
日総工産	12,600	546.00	6,879,600	貸付有価証券 1,700株

キュービーネットホールディングス	7,400	1,353.00	10,012,200	
R P Aホールディングス	22,700	350.00	7,945,000	貸付有価証券 9,700株(9,500株)
スプリックス	5,200	912.00	4,742,400	貸付有価証券 700株(700株)
マネジメントソリューションズ	7,900	1,938.00	15,310,200	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
プロレド・パートナーズ	3,500	453.00	1,585,500	貸付有価証券 300株(100株)
and factory	4,300	399.00	1,715,700	
テノ・ホールディングス	2,000	704.00	1,408,000	
フロンティア・マネジメント	4,200	1,178.00	4,947,600	貸付有価証券 1,100株
ピアラ	2,600	684.00	1,778,400	貸付有価証券 1,200株(800株)
コプロ・ホールディングス	3,100	829.00	2,569,900	
ギークス	2,800	916.00	2,564,800	貸付有価証券 100株(100株)
カーブスホールディングス	44,200	627.00	27,713,400	
フォーラムエンジニアリング	10,300	938.00	9,661,400	
Fast Fitness Japan	2,900	1,339.00	3,883,100	貸付有価証券 300株(300株)
ダイレクトマーケティングミックス	17,100	1,661.00	28,403,100	貸付有価証券 100株
ポピンズ	3,700	1,837.00	6,796,900	
LITALICO	13,000	1,920.00	24,960,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	8,100	441.00	3,572,100	
リログループ	88,100	2,050.00	180,605,000	
東祥	12,000	1,192.00	14,304,000	貸付有価証券 400株(400株)
ビーウィズ	4,300	1,308.00	5,624,400	
TREホールディングス	27,500	1,850.00	50,875,000	
人・夢・技術グループ	6,400	2,213.00	14,163,200	
エイチ・アイ・エス	34,200	2,000.00	68,400,000	貸付有価証券 15,900株
ラックランド	4,900	2,996.00	14,680,400	貸付有価証券

				2,300株
共立メンテナンス	28,700	4,885.00	140,199,500	貸付有価証券 9,300株(5,100株)
イチネンホールディングス	16,500	1,207.00	19,915,500	
建設技術研究所	8,600	2,426.00	20,863,600	
スペース	10,800	902.00	9,741,600	
燦ホールディングス	7,000	1,866.00	13,062,000	貸付有価証券 100株(100株)
スバル興業	1,000	8,710.00	8,710,000	貸付有価証券 400株
東京テアトル	6,000	1,224.00	7,344,000	
タナベ経営	6,200	644.00	3,992,800	
ナガワ	4,700	7,590.00	35,673,000	貸付有価証券 400株
東京都競馬	12,000	3,755.00	45,060,000	
常磐興産	5,800	1,254.00	7,273,200	
カナモト	27,000	1,902.00	51,354,000	貸付有価証券 11,700株
西尾レントオール	13,900	2,678.00	37,224,200	
トランス・コスモス	20,400	3,495.00	71,298,000	貸付有価証券 500株
乃村工藝社	69,000	840.00	57,960,000	
藤田観光	7,000	2,811.00	19,677,000	貸付有価証券 3,200株
KNT-CTホールディングス	10,000	1,626.00	16,260,000	
日本管財	17,200	2,533.00	43,567,600	
トーカイ	13,200	1,617.00	21,344,400	
白洋舎	1,700	1,495.00	2,541,500	貸付有価証券 800株
セコム	158,700	8,095.00	1,284,676,500	
セントラル警備保障	7,800	2,361.00	18,415,800	貸付有価証券 500株(300株)
丹青社	31,300	798.00	24,977,400	
メイテック	19,100	6,470.00	123,577,000	
応用地質	16,300	1,673.00	27,269,900	
船井総研ホールディングス	31,100	2,050.00	63,755,000	
進学会ホールディングス	5,200	374.00	1,944,800	貸付有価証券

				2,200株（400株）
	オオバ	10,400	736.00	7,654,400 貸付有価証券 4,800株
	いであ	4,100	1,665.00	6,826,500 貸付有価証券 100株（100株）
	学究社	5,200	1,571.00	8,169,200 貸付有価証券 400株（400株）
	ベネッセホールディングス	53,700	2,118.00	113,736,600
	イオンディライト	18,600	2,849.00	52,991,400 貸付有価証券 1,700株（1,700株）
	ナック	7,600	956.00	7,265,600
	ダイセキ	29,400	4,145.00	121,863,000
	ステップ	5,900	1,695.00	10,000,500
	小計 銘柄数：2,152 組入時価比率：97.2%			410,014,931,210 100.0%
	合計			410,014,931,210

(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6月22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 6月22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	11,999,361,005	-	11,636,500,000	363,172,360
合計	11,999,361,005	-	11,636,500,000	363,172,360

(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 6月22日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	19,394,314,013
コール・ローン	2,757,011,604
株式	1,199,341,564,071
投資証券	30,116,091,732
派生商品評価勘定	110,956,693
未収入金	24,915,118
未収配当金	1,455,675,765
差入委託証拠金	4,325,757,613
流動資産合計	1,257,526,286,609
資産合計	1,257,526,286,609
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	45,436,288
未払金	12,273,074,070
未払解約金	46,265,474
未払利息	2,023
その他未払費用	3,198,600
流動負債合計	12,367,976,455
負債合計	12,367,976,455
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	285,234,307,599
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	959,924,002,555
元本等合計	1,245,158,310,154
純資産合計	1,245,158,310,154
負債純資産合計	1,257,526,286,609

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p>
-------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価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 6月22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	4.3654円
(10,000口当たり純資産額)	(43,654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 6月23日 至 2022年 6月22日	
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

### 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 6月22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 6月22日現在

期首	2021年 6月23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	252,216,611,468円
同期中における追加設定元本額	57,010,762,736円
同期中における一部解約元本額	23,993,066,605円
期末元本額	285,234,307,599円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	30,804,619円
バランスセレクト50	94,547,470円
バランスセレクト70	114,036,674円

野村外国株式インデックスファンド	490,923,072円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,053,494,150円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	3,945,037,686円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	3,873,509,119円
野村資産設計ファンド2015	9,289,678円
野村資産設計ファンド2020	9,849,314円
野村資産設計ファンド2025	17,426,889円
野村資産設計ファンド2030	26,283,587円
野村資産設計ファンド2035	22,225,932円
野村資産設計ファンド2040	42,382,039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)	45,657,874,886円
のむらップ・ファンド(保守型)	822,353,294円
のむらップ・ファンド(普通型)	10,391,587,995円
のむらップ・ファンド(積極型)	10,241,243,921円
野村資産設計ファンド2045	8,667,564円
野村インデックスファンド・外国株式	7,672,033,081円
マイ・ロード	959,523,489円
ネクストコア	3,576,433円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	168,889,053円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	2,581,731,516円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	313,744,963円
野村資産設計ファンド2050	10,578,854円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	3,008,279円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,769,863円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,375,195円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,194,396円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	232,395,461円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	859,633,760円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,847,179円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,830,959円
インデックス・ブレンド(タイプ)	29,276,666円
インデックス・ブレンド(タイプ)	8,073,259円
インデックス・ブレンド(タイプ)	36,405,761円
野村6資産均等バランス	1,380,724,363円
野村つみたて外国株投信	11,371,059,261円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	4,883,074,084円
世界6資産分散ファンド	37,919,636円
野村資産設計ファンド2060	7,626,971円
野村スリーゼロ先進国株式投信	911,829,306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	6,889,129,564円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	5,323,327,695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)	126,284,585円
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	62,864,471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)	538,363,847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)	602,042,278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)	1,369,211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)	4,152,308円



ワールド・インデックス・ファンドV A積極型(適格機関投資家専用)	719,268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)	901,351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)	12,055,475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)	371,675,361円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	4,437,881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)	26,739,625円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	85,899,884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)	2,144,316,881円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	19,960,253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)	721,835,866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)	11,627,475,197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)	1,091,927円
先進8ヵ国国債入替型プラス外国株式戦略20オープン(部分為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	8,436,161円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	1,364,688円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	8,937,268円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	8,935,953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)	88,389,297,529円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,016,633,497円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	7,630,330,900円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	7,435,410,092円
マイバランスDC30	768,647,478円
マイバランスDC50	1,783,050,835円
マイバランスDC70	1,625,435,708円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	34,704,312,256円
野村DC運用戦略ファンド	111,820,477円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,617,539円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	389,626,129円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	346,131,243円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	331,228,472円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	17,528,561円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	8,083,185円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	44,390,511円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	8,215,426円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	7,549,619円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	5,807,276円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	194,393,048円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	147,082,868円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	82,935,536円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	116,541,597円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	3,863,705円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	32,651,841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)	94,641,278円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	6,048,495円
野村DCバランスファンド(年金運用戦略タイプ)	55,823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6月22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	185,000	30.48	5,638,800.00	
		HALLIBURTON CO	178,000	33.55	5,971,900.00	
		SCHLUMBERGER LTD	279,000	38.82	10,830,780.00	
		APA CORPORATION	67,000	40.35	2,703,450.00	
		CHENIERE ENERGY INC	45,400	132.73	6,025,942.00	
		CHEVRON CORP	381,400	154.59	58,960,626.00	
		CONOCOPHILLIPS	254,500	99.28	25,266,760.00	
		COTERRA ENERGY INC	162,000	27.57	4,466,340.00	
		DEVON ENERGY CORP	123,600	60.56	7,485,216.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	33,600	132.28	4,444,608.00	
		EOG RESOURCES INC	114,100	117.65	13,423,865.00	
		EQT CORP	66,000	36.80	2,428,800.00	
		EXXON MOBIL CORP	829,000	91.48	75,836,920.00	
		HESS CORP	54,200	107.74	5,839,508.00	
		KINDER MORGAN INC	395,000	16.65	6,576,750.00	
		MARATHON OIL CORP	139,000	24.90	3,461,100.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	111,500	91.36	10,186,640.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	184,200	57.87	10,659,654.00	
		ONEOK INC	87,700	55.54	4,870,858.00	
		PHILLIPS 66	94,800	95.98	9,098,904.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	45,500	237.55	10,808,525.00	
		TARGA RESOURCES CORP	42,000	63.47	2,665,740.00	
		VALERO ENERGY CORP	80,000	116.47	9,317,600.00	
WILLIAMS COS	238,000	30.93	7,361,340.00			
AIR PRODUCTS	43,700	241.01	10,532,137.00			
ALBEMARLE CORP	22,600	216.33	4,889,058.00			

CELANESE CORP-SERIES A	20,900	124.10	2,593,690.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	41,200	90.73	3,738,076.00
CORTEVA INC	142,700	55.37	7,901,299.00
DOW INC	143,100	54.95	7,863,345.00
DUPONT DE NEMOURS INC	99,800	56.86	5,674,628.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	25,000	90.30	2,257,500.00
ECOLAB INC	50,000	148.59	7,429,500.00
FMC CORP	24,800	108.83	2,698,984.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	49,500	112.95	5,591,025.00
LINDE PLC	100,400	298.78	29,997,512.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	51,400	91.20	4,687,680.00
MOSAIC CO/THE	72,300	51.58	3,729,234.00
PPG INDUSTRIES	45,800	110.60	5,065,480.00
RPM INTERNATIONAL INC	25,800	75.39	1,945,062.00
SHERWIN-WILLIAMS	48,100	220.15	10,589,215.00
WESTLAKE CORPORATION	7,500	98.89	741,675.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	12,200	302.55	3,691,110.00
VULCAN MATERIALS CO	26,000	144.67	3,761,420.00
AMCOR PLC	300,000	11.92	3,576,000.00
AVERY DENNISON CORP	15,600	155.35	2,423,460.00
BALL CORP	61,800	65.49	4,047,282.00
CROWN HOLDINGS INC	24,700	92.10	2,274,870.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	68,000	41.88	2,847,840.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	18,800	139.51	2,622,788.00
SEALED AIR CORP	29,400	57.40	1,687,560.00
WESTROCK CO	52,000	40.16	2,088,320.00
ALCOA CORP	35,700	50.08	1,787,856.00
CLEVELAND-CLIFFS INC	102,000	16.76	1,709,520.00
FREEPORT-MCMORAN INC	287,000	34.03	9,766,610.00
NEWMONT CORP	157,300	65.17	10,251,241.00
NUCOR CORP	53,300	112.26	5,983,458.00
STEEL DYNAMICS	37,100	70.73	2,624,083.00
BOEING CO	109,000	136.75	14,905,750.00
GENERAL DYNAMICS	46,600	216.55	10,091,230.00
HEICO CORP	7,900	131.38	1,037,902.00

HEICO CORP-CLASS A	13,900	105.80	1,470,620.00	
HOWMET AEROSPACE INC	72,000	31.66	2,279,520.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	7,500	209.36	1,570,200.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	37,700	229.60	8,655,920.00	
LOCKHEED MARTIN	48,200	418.96	20,193,872.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	29,200	463.77	13,542,084.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	292,200	92.92	27,151,224.00	
TEXTRON INC	43,500	59.66	2,595,210.00	
TRANSDIGM GROUP INC	10,320	523.66	5,404,171.20	
ALLEGION PLC	17,900	95.08	1,701,932.00	
CARRIER GLOBAL CORP	166,000	35.01	5,811,660.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	25,600	58.31	1,492,736.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	139,100	47.40	6,593,340.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	6,400	186.89	1,196,096.00	
MASCO CORP	45,800	47.26	2,164,508.00	
OWENS CORNING INC	18,900	75.58	1,428,462.00	
SMITH (A.O.) CORP	24,700	52.89	1,306,383.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	45,200	124.15	5,611,580.00	
QUANTA SERVICES INC	27,900	119.23	3,326,517.00	
AMETEK INC	45,500	108.29	4,927,195.00	
EATON CORP PLC	77,900	126.14	9,826,306.00	
EMERSON ELEC	116,400	80.22	9,337,608.00	
GENERAC HOLDINGS INC	12,300	219.98	2,705,754.00	
PLUG POWER INC	105,000	16.58	1,740,900.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	22,900	193.39	4,428,631.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	32,000	42.39	1,356,480.00	
3M CORP	112,400	130.01	14,613,124.00	
GENERAL ELECTRIC CO	214,100	65.75	14,077,075.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	134,300	180.51	24,242,493.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	41,400	51.15	2,117,610.00	
CATERPILLAR INC DEL	104,900	196.37	20,599,213.00	
CUMMINS INC	27,600	196.19	5,414,844.00	
DEERE & COMPANY	57,100	329.27	18,801,317.00	
DOVER CORP	28,200	119.22	3,362,004.00	

FORTIVE CORP	68,000	54.07	3,676,760.00	
IDEX CORP	15,200	176.25	2,679,000.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	61,700	181.28	11,184,976.00	
INGERSOLL-RAND INC	81,000	41.86	3,390,660.00	
KORNIT DIGITAL LTD	11,200	34.71	388,752.00	
NORDSON CORP	10,400	197.99	2,059,096.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	82,400	69.87	5,757,288.00	
PACCAR	68,300	84.51	5,772,033.00	
PARKER HANNIFIN CORP	24,800	241.90	5,999,120.00	
PENTAIR PLC	33,700	44.30	1,492,910.00	
SNAP-ON INC	10,600	197.54	2,093,924.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	32,700	102.65	3,356,655.00	
WABTEC CORP	34,100	84.62	2,885,542.00	
XYLEM INC	35,900	74.81	2,685,679.00	
AERCAP HOLDINGS NV	25,100	40.37	1,013,287.00	
FASTENAL CO	113,100	49.74	5,625,594.00	
GRAINGER(W.W.) INC	8,900	449.84	4,003,576.00	
UNITED RENTALS INC	14,200	242.08	3,437,536.00	
CINTAS CORP	18,300	358.42	6,559,086.00	
COPART INC	42,500	105.96	4,503,300.00	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	43,200	124.53	5,379,696.00	
ROLLINS INC	41,000	32.45	1,330,450.00	
WASTE CONNECTIONS INC	49,600	117.25	5,815,600.00	
WASTE MANAGEMENT INC	80,800	143.99	11,634,392.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	25,900	101.25	2,622,375.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	32,700	95.81	3,132,987.00	
FEDEX CORPORATION	49,600	230.52	11,433,792.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	143,500	174.50	25,040,750.00	
DELTA AIR LINES INC	30,000	30.05	901,500.00	
SOUTHWEST AIRLINES	29,000	35.32	1,024,280.00	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	17,000	51.33	872,610.00	
AMERCO	1,720	464.97	799,748.40	
CSX CORP	432,000	28.99	12,523,680.00	
GRAB HOLDINGS LTD-CL A	203,000	2.73	554,190.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	16,800	158.73	2,666,664.00	

KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	30,100	45.05	1,356,005.00
LYFT INC-A	65,000	14.67	953,550.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	46,600	224.20	10,447,720.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	18,900	238.35	4,504,815.00
UBER TECHNOLOGIES INC	283,000	21.76	6,158,080.00
UNION PAC CORP	124,700	209.47	26,120,909.00
APTIV PLC	52,300	90.69	4,743,087.00
BORGWARNER INC	45,000	35.40	1,593,000.00
LEAR CORP	12,300	128.45	1,579,935.00
FORD MOTOR COMPANY	777,000	11.46	8,904,420.00
GENERAL MOTORS CO	268,000	32.64	8,747,520.00
LUCID GROUP INC	80,000	17.90	1,432,000.00
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	34,600	29.07	1,005,822.00
TESLA INC	172,030	711.11	122,332,253.30
DR HORTON INC	66,100	61.30	4,051,930.00
GARMIN LTD	30,600	95.65	2,926,890.00
LENNAR CORP-A	52,300	65.65	3,433,495.00
MOHAWK INDUSTRIES	9,500	120.43	1,144,085.00
NEWELL BRANDS INC	75,000	18.31	1,373,250.00
NVR INC	600	3,803.50	2,282,100.00
PULTEGROUP INC	51,000	37.17	1,895,670.00
WHIRLPOOL CORP	11,300	153.02	1,729,126.00
HASBRO INC	25,500	82.46	2,102,730.00
PELOTON INTERACTIVE INC-A	52,000	9.70	504,400.00
LULULEMON ATHLETICA INC	22,800	276.45	6,303,060.00
NIKE INC-B	249,900	108.68	27,159,132.00
V F CORP	65,700	46.38	3,047,166.00
AIRBNB INC-CLASS A	64,800	102.27	6,627,096.00
ARAMARK	44,000	29.72	1,307,680.00
BOOKING HOLDINGS INC	8,040	1,937.29	15,575,811.60
CAESARS ENTERTAINMENT INC	39,700	40.11	1,592,367.00
CARNIVAL CORP	159,000	9.57	1,521,630.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	5,550	1,261.24	6,999,882.00
DARDEN RESTAURANTS INC	25,000	113.70	2,842,500.00
	6,900	386.36	2,665,884.00

DOMINOS PIZZA INC				
EXPEDIA GROUP INC	30,100	98.78	2,973,278.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	54,700	114.44	6,259,868.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	69,000	31.71	2,187,990.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	54,800	141.58	7,758,584.00	
MCDONALD'S CORP	145,600	239.59	34,884,304.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	71,000	27.67	1,964,570.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	43,700	37.03	1,618,211.00	
STARBUCKS CORP	226,200	72.96	16,503,552.00	
VAIL RESORTS INC	8,200	223.27	1,830,814.00	
WYNN RESORTS LTD	22,800	54.30	1,238,040.00	
YUM BRANDS INC	55,800	111.57	6,225,606.00	
GENUINE PARTS CO	27,900	130.81	3,649,599.00	
LKQ CORP	52,600	47.77	2,512,702.00	
POOL CORP	7,800	332.76	2,595,528.00	
AMAZON.COM INC	1,793,600	108.68	194,928,448.00	
CHEWY INC - CLASS A	15,100	31.85	480,935.00	
DOORDASH INC-A	36,900	63.07	2,327,283.00	
EBAY INC	117,000	42.29	4,947,930.00	
ETSY INC	24,400	71.81	1,752,164.00	
MERCADOLIBRE INC	8,820	656.70	5,792,094.00	
WAYFAIR INC - CLASS A	14,600	44.97	656,562.00	
DOLLAR GENERAL CORP	45,100	238.97	10,777,547.00	
DOLLAR TREE INC	44,500	156.38	6,958,910.00	
TARGET CORP	93,500	144.70	13,529,450.00	
ADVANCE AUTO PARTS	12,000	171.73	2,060,760.00	
AUTOZONE	4,080	2,032.12	8,291,049.60	
BATH & BODY WORKS INC	50,400	30.36	1,530,144.00	
BEST BUY COMPANY INC	42,400	70.47	2,987,928.00	
BURLINGTON STORES INC	13,100	154.94	2,029,714.00	
CARMAX INC	31,300	87.68	2,744,384.00	
CARVANA CO	19,700	24.91	490,727.00	
HOME DEPOT	204,500	269.20	55,051,400.00	
LOWES COS INC	131,200	172.38	22,616,256.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	13,060	597.35	7,801,391.00	
	68,500	75.10	5,144,350.00	

ROSS STORES INC			
TJX COS INC	232,300	57.49	13,354,927.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	22,500	195.39	4,396,275.00
ULTA BEAUTY INC	10,500	401.26	4,213,230.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	86,840	463.11	40,216,472.40
KROGER CO	137,100	48.40	6,635,640.00
SYSCO CORP	98,600	80.07	7,894,902.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	143,000	40.10	5,734,300.00
WALMART INC	298,800	122.17	36,504,396.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	61,300	68.69	4,210,697.00
COCA COLA CO	806,500	60.70	48,954,550.00
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	39,300	51.73	2,032,989.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	32,200	234.94	7,565,068.00
KEURIG DR PEPPER INC	151,000	34.94	5,275,940.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	33,600	52.21	1,754,256.00
MONSTER BEVERAGE CORP	77,100	90.84	7,003,764.00
PEPSICO INC	270,900	160.71	43,536,339.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	109,500	79.40	8,694,300.00
BUNGE LIMITED	26,800	98.71	2,645,428.00
CAMPBELL SOUP CO	40,000	47.00	1,880,000.00
CONAGRA BRANDS INC	93,000	32.34	3,007,620.00
GENERAL MILLS	119,200	67.85	8,087,720.00
HERSHEY CO/THE	28,200	215.07	6,064,974.00
HORMEL FOODS CORP	58,700	45.31	2,659,697.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	21,300	124.39	2,649,507.00
KELLOGG CO	49,400	68.86	3,401,684.00
KRAFT HEINZ CO/THE	142,000	36.61	5,198,620.00
MCCORMICK & CO INC.	49,800	83.57	4,161,786.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	273,100	59.82	16,336,842.00
TYSON FOODS INC-CL A	57,000	84.01	4,788,570.00
ALTRIA GROUP INC	357,400	45.70	16,333,180.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	303,500	100.10	30,380,350.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	47,300	85.91	4,063,543.00
CLOROX CO	23,900	125.62	3,002,318.00
COLGATE PALMOLIVE CO.	157,300	76.46	12,027,158.00



KIMBERLY-CLARK CORP	66,600	125.08	8,330,328.00
PROCTER & GAMBLE CO	469,400	136.37	64,012,078.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	45,300	246.76	11,178,228.00
ABBOTT LABORATORIES	345,300	104.41	36,052,773.00
ABIOMED INC	8,700	232.27	2,020,749.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	14,300	230.31	3,293,433.00
BAXTER INTERNATIONAL INC.	99,500	64.02	6,369,990.00
BECTON,DICKINSON	55,400	236.53	13,103,762.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	279,000	36.30	10,127,700.00
DENTSPLY SIRONA INC	42,200	35.18	1,484,596.00
DEXCOM INC	74,800	70.46	5,270,408.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	122,800	89.34	10,970,952.00
HOLOGIC INC	48,900	68.20	3,334,980.00
IDEXX LABORATORIES INC	16,500	332.03	5,478,495.00
INSULET CORP	13,300	204.77	2,723,441.00
INTUITIVE SURGICAL INC	69,600	194.32	13,524,672.00
MASIMO CORP	10,600	126.88	1,344,928.00
MEDTRONIC PLC	262,900	88.71	23,321,859.00
NOVOCURE LTD	18,800	58.76	1,104,688.00
RESMED INC	28,400	201.51	5,722,884.00
STERIS PLC	20,000	195.18	3,903,600.00
STRYKER CORP	66,200	195.70	12,955,340.00
TELEFLEX INC	9,400	249.11	2,341,634.00
THE COOPER COMPANIES, INC.	9,800	303.97	2,978,906.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	41,600	102.23	4,252,768.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	30,200	143.26	4,326,452.00
ANTHEM INC	47,250	460.76	21,770,910.00
CARDINAL HEALTH INC	55,300	51.49	2,847,397.00
CENTENE CORP	115,100	80.86	9,306,986.00
CIGNA CORP	63,100	252.18	15,912,558.00
CVS HEALTH CORP	257,000	91.08	23,407,560.00
DAVITA INC	10,400	76.05	790,920.00
HCA HEALTHCARE INC	48,000	173.87	8,345,760.00
HENRY SCHEIN INC	27,800	74.53	2,071,934.00
HUMANA INC	25,000	448.98	11,224,500.00
	18,300	229.54	4,200,582.00

LABORATORY CRP OF AMER HLDGS				
MCKESSON CORP	29,300	309.38	9,064,834.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	11,100	258.58	2,870,238.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	23,700	131.93	3,126,741.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	184,250	480.32	88,498,960.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	12,500	102.96	1,287,000.00	
ABBVIE INC	346,400	143.47	49,698,008.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	23,000	139.02	3,197,460.00	
AMGEN INC	109,100	238.41	26,010,531.00	
BIOGEN INC	28,600	206.89	5,917,054.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	35,900	78.40	2,814,560.00	
EXACT SCIENCES CORP	32,300	38.04	1,228,692.00	
GILEAD SCIENCES INC	244,700	60.51	14,806,797.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	41,100	82.81	3,403,491.00	
INCYTE CORP	36,500	73.14	2,669,610.00	
MODERNA INC	67,600	129.99	8,787,324.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	19,100	93.37	1,783,367.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	21,020	587.67	12,352,823.40	
SEAGEN INC	27,200	170.01	4,624,272.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	50,100	270.17	13,535,517.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	426,800	76.47	32,637,396.00	
CATALENT INC	34,000	103.99	3,535,660.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	81,000	20.03	1,622,430.00	
ELI LILLY & CO.	158,500	297.34	47,128,390.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	12,000	149.12	1,789,440.00	
JOHNSON & JOHNSON	514,900	173.01	89,082,849.00	
MERCK & CO INC	495,000	88.03	43,574,850.00	
PFIZER INC	1,101,200	48.11	52,978,732.00	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	68,000	40.11	2,727,480.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	215,000	7.68	1,651,200.00	
VIATRIS INC	229,000	10.60	2,427,400.00	
ZOETIS INC	92,900	162.01	15,050,729.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,422,000	32.85	46,712,700.00	
CITIGROUP	388,600	47.96	18,637,256.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	99,000	36.17	3,580,830.00	
	132,000	34.37	4,536,840.00	

FIFTH THIRD BANCORP				
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	2,250	632.15	1,422,337.50	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	34,800	139.01	4,837,548.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	286,000	12.12	3,466,320.00	
JPMORGAN CHASE & CO	578,200	115.83	66,972,906.00	
KEYCORP	178,000	17.52	3,118,560.00	
M & T BANK CORP	34,900	165.26	5,767,574.00	
PNC FINANCIAL	81,600	156.49	12,769,584.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	180,000	19.09	3,436,200.00	
SIGNATURE BANK	12,700	175.55	2,229,485.00	
SVB FINANCIAL GROUP	11,330	402.82	4,563,950.60	
TRUIST FINANCIAL CORP	261,600	47.05	12,308,280.00	
US BANCORP	274,900	46.33	12,736,117.00	
WEBSTER FINANCIAL CORP	37,000	43.99	1,627,630.00	
WELLS FARGO CO	747,300	38.99	29,137,227.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	77,500	49.85	3,863,375.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	252,900	271.77	68,730,633.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	79,000	26.39	2,084,810.00	
AFLAC INC	121,000	54.18	6,555,780.00	
ALLEGHANY CORP	2,590	829.85	2,149,311.50	
ALLSTATE CORP	55,100	121.80	6,711,180.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	13,900	134.39	1,868,021.00	
AMERICAN INTL GROUP	159,400	52.15	8,312,710.00	
AON PLC	42,200	254.76	10,750,872.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	75,000	43.73	3,279,750.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	40,700	155.21	6,317,047.00	
ASSURANT INC	11,300	171.68	1,939,984.00	
BROWN & BROWN INC	46,000	54.87	2,524,020.00	
CHUBB LTD	83,800	189.47	15,877,586.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	30,000	115.55	3,466,500.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	5,400	177.67	959,418.00	
EVEREST RE GROUP LTD	7,800	270.89	2,112,942.00	
FNF GROUP	54,000	36.01	1,944,540.00	
GLOBE LIFE INC	17,700	94.76	1,677,252.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	65,300	65.07	4,249,071.00	
	33,200	48.82	1,620,824.00	

LINCOLN NATIONAL CORP				
LOEWS CORP	41,800	58.49	2,444,882.00	
MARKEL CORP	2,660	1,284.83	3,417,647.80	
MARSH & MCLENNAN COS	98,900	148.90	14,726,210.00	
METLIFE INC	137,300	62.53	8,585,369.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	50,700	65.48	3,319,836.00	
PROGRESSIVE CO	114,200	112.18	12,810,956.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	72,700	93.90	6,826,530.00	
TRAVELERS COS INC/THE	47,700	162.63	7,757,451.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	23,400	196.20	4,591,080.00	
WR BERKLEY CORP	42,600	67.53	2,876,778.00	
ACCENTURE PLC-CL A	123,800	282.73	35,001,974.00	
AFFIRM HOLDINGS INC	33,000	19.21	633,930.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	31,300	90.65	2,837,345.00	
AUTOMATIC DATA PROCESS	82,600	206.84	17,084,984.00	
BLOCK INC	101,400	60.52	6,136,728.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	23,200	134.72	3,125,504.00	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	49,300	43.62	2,150,466.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	103,000	67.75	6,978,250.00	
EPAM SYSTEMS INC	11,000	300.30	3,303,300.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	118,900	92.97	11,054,133.00	
FISERV INC	122,100	89.26	10,898,646.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	15,000	216.18	3,242,700.00	
GARTNER INC	16,100	233.28	3,755,808.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	55,900	111.52	6,233,968.00	
GODADDY INC - CLASS A	32,300	66.55	2,149,565.00	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	176,100	137.85	24,275,385.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	13,900	174.51	2,425,689.00	
MASTERCARD INC	170,900	317.40	54,243,660.00	
MONGODB INC	12,900	269.55	3,477,195.00	
OKTA INC	28,000	84.12	2,355,360.00	
PAYCHEX INC	64,200	116.28	7,465,176.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	217,700	72.37	15,754,949.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	42,600	122.54	5,220,204.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	45,600	56.64	2,582,784.00	

TWILIO INC - A	34,500	85.17	2,938,365.00
VERISIGN INC	19,700	160.68	3,165,396.00
VISA INC-CLASS A SHARES	324,800	194.39	63,137,872.00
WESTERN UNION CO	75,000	16.05	1,203,750.00
WIX.COM LTD	12,200	60.16	733,952.00
ADOBE INC	92,350	362.99	33,522,126.50
ANSYS INC	17,200	235.33	4,047,676.00
APPROVIN CORP-CLASS A	23,000	35.04	805,920.00
AUTODESK INC.	43,500	166.88	7,259,280.00
AVALARA INC	17,200	70.80	1,217,760.00
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	40,000	31.83	1,273,200.00
BILL.COM HOLDINGS INC	18,400	112.81	2,075,704.00
BLACK KNIGHT INC	29,800	62.89	1,874,122.00
CADENCE DESIGN SYS INC	54,800	148.14	8,118,072.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	26,800	44.77	1,199,836.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	20,100	120.18	2,415,618.00
CITRIX SYSTEMS INC	23,800	97.62	2,323,356.00
COUPA SOFTWARE INC	14,200	54.44	773,048.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	39,200	164.64	6,453,888.00
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	8,300	128.36	1,065,388.00
DATADOG INC - CLASS A	43,300	90.31	3,910,423.00
DOCUSIGN INC	38,800	59.55	2,310,540.00
DROPBOX INC-CLASS A	57,000	21.06	1,200,420.00
DYNATRACE INC	38,000	40.09	1,523,420.00
FAIR ISAAC CORP	5,120	385.01	1,971,251.20
FORTINET INC	26,700	281.01	7,502,967.00
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	15,800	72.04	1,138,232.00
HUBSPOT INC	8,900	299.17	2,662,613.00
INTUIT INC	52,900	377.43	19,966,047.00
MICROSOFT CORP	1,394,700	253.74	353,891,178.00
NORTONLIFELOCK INC	110,000	22.08	2,428,800.00
ORACLE CORPORATION	313,800	67.68	21,237,984.00
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	330,000	8.71	2,874,300.00
PALO ALTO NETWORKS INC	19,300	499.36	9,637,648.00
PAYCOM SOFTWARE INC	10,300	271.99	2,801,497.00

PTC INC	22,000	106.14	2,335,080.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	14,500	51.94	753,130.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	20,900	382.63	7,996,967.00
SALESFORCE INC	192,840	166.83	32,171,497.20
SERVICENOW INC	39,320	455.27	17,901,216.40
SPLUNK INC	30,100	93.57	2,816,457.00
SYNOPSYS INC	29,900	302.22	9,036,378.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	86,200	47.06	4,056,572.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	8,000	311.83	2,494,640.00
UNITY SOFTWARE INC	37,200	37.45	1,393,140.00
VMWARE INC - CLASS A	41,300	117.19	4,839,947.00
WORKDAY INC-CLASS A	38,900	138.60	5,391,540.00
ZENDESK INC	22,600	56.04	1,266,504.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	42,700	113.82	4,860,114.00
ZSCALER INC	16,400	150.25	2,464,100.00
ARISTA NETWORKS INC	47,700	93.83	4,475,691.00
CISCO SYSTEMS	813,900	44.14	35,925,546.00
F5 INC	12,400	152.83	1,895,092.00
JUNIPER NETWORKS INC	66,000	28.39	1,873,740.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	32,500	205.18	6,668,350.00
APPLE INC	3,195,800	135.87	434,213,346.00
DELL TECHNOLOGIES-C	55,800	49.23	2,747,034.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	259,000	13.90	3,600,100.00
HP INC	208,000	34.29	7,132,320.00
NETAPP INC	43,100	64.50	2,779,950.00
SEAGATE TECHNOLOGY	41,700	72.70	3,031,590.00
WESTERN DIGITAL CORP	61,800	46.50	2,873,700.00
AMPHENOL CORP-CL A	115,900	63.41	7,349,219.00
ARROW ELECTRS INC	13,700	109.30	1,497,410.00
CDW CORPORATION	26,300	159.83	4,203,529.00
COGNEX CORP	33,600	42.96	1,443,456.00
CORNING INC	155,000	32.12	4,978,600.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	36,300	136.54	4,956,402.00
TE CONNECTIVITY LTD	63,300	117.93	7,464,969.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	9,100	364.21	3,314,311.00

TRIMBLE INC	49,900	58.84	2,936,116.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	10,300	295.85	3,047,255.00
ADVANCED MICRO DEVICES	320,148	83.79	26,825,200.92
ANALOG DEVICES INC	103,000	148.35	15,280,050.00
APPLIED MATERIALS	173,800	95.17	16,540,546.00
BROADCOM INC	80,210	503.77	40,407,391.70
ENPHASE ENERGY INC	26,000	193.29	5,025,540.00
ENTEGRIS INC	25,700	95.77	2,461,289.00
INTEL CORP	797,500	37.73	30,089,675.00
KLA CORP	29,700	327.22	9,718,434.00
LAM RESEARCH	27,500	433.04	11,908,600.00
MARVELL TECHNOLOGY INC	163,600	47.03	7,694,108.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	108,800	59.35	6,457,280.00
MICRON TECHNOLOGY	218,200	56.80	12,393,760.00
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	8,800	412.84	3,632,992.00
NVIDIA CORP	489,540	165.66	81,097,196.40
NXP SEMICONDUCTORS NV	51,100	159.09	8,129,499.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	84,900	51.95	4,410,555.00
QORVO INC	20,700	96.26	1,992,582.00
QUALCOMM INC	220,700	124.39	27,452,873.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	31,700	93.20	2,954,440.00
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	10,600	283.10	3,000,860.00
TERADYNE INC	32,000	91.38	2,924,160.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	180,900	153.46	27,760,914.00
AT & T INC	1,399,000	19.96	27,924,040.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	31,000	21.88	678,280.00
LIBERTY GLOBAL PLC-C	64,000	22.93	1,467,520.00
LUMEN TECHNOLOGIES INC	182,000	10.79	1,963,780.00
VERIZON COMMUNICATIONS	822,000	50.65	41,634,300.00
T-MOBILE US INC	121,800	131.67	16,037,406.00
ALLIANT ENERGY CORP	48,400	55.22	2,672,648.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	99,500	89.95	8,950,025.00
CONSTELLATION ENERGY	62,900	60.38	3,797,902.00
DUKE ENERGY CORP	150,000	99.21	14,881,500.00
EDISON INTERNATIONAL	75,800	60.28	4,569,224.00

ENTERGY CORP	39,200	104.70	4,104,240.00
EVERGY INC	45,600	60.94	2,778,864.00
EVERSOURCE ENERGY	66,900	79.56	5,322,564.00
EXELON CORPORATION	191,500	41.60	7,966,400.00
FIRSTENERGY CORP	104,000	35.97	3,740,880.00
NEXTERA ENERGY INC	384,400	72.73	27,957,412.00
NRG ENERGY INC	49,000	37.00	1,813,000.00
PG&E CORP	292,000	10.00	2,920,000.00
PPL CORPORATION	142,000	25.85	3,670,700.00
SOUTHERN CO.	208,700	67.15	14,014,205.00
XCEL ENERGY INC	105,600	64.76	6,838,656.00
ATMOS ENERGY CORP	26,100	105.47	2,752,767.00
UGI CORP	40,000	38.52	1,540,800.00
AMEREN CORPORATION	49,400	82.45	4,073,030.00
CENTERPOINT ENERGY INC	120,000	27.75	3,330,000.00
CMS ENERGY CORP	56,700	61.93	3,511,431.00
CONSOLIDATED EDISON INC	68,700	88.21	6,060,027.00
DOMINION ENERGY INC	159,700	74.58	11,910,426.00
DTE ENERGY COMPANY	37,800	117.14	4,427,892.00
NISOURCE INC	79,000	26.98	2,131,420.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	98,200	59.66	5,858,612.00
SEMPRA ENERGY	61,800	142.82	8,826,276.00
WEC ENERGY GROUP INC	62,000	91.90	5,697,800.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	36,100	134.44	4,853,284.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	48,000	42.06	2,018,880.00
ALLY FINANCIAL INC	63,000	33.20	2,091,600.00
AMERICAN EXPRESS CO	126,400	144.76	18,297,664.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	81,700	106.46	8,697,782.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	55,600	94.48	5,253,088.00
SYNCHRONY FINANCIAL	103,800	29.22	3,033,036.00
UPSTART HOLDINGS INC	15,000	38.23	573,450.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	21,300	242.60	5,167,380.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	151,000	42.32	6,390,320.00
BLACKROCK INC	29,900	614.54	18,374,746.00
BLACKSTONE INC	137,900	91.23	12,580,617.00



CARLYLE GROUP INC/THE	38,000	32.51	1,235,380.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	21,200	109.69	2,325,428.00	
CME GROUP INC	70,100	208.50	14,615,850.00	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	23,200	57.49	1,333,768.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	7,400	358.77	2,654,898.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	57,000	24.18	1,378,260.00	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	13,000	51.58	670,540.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	66,200	284.81	18,854,422.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	109,000	93.81	10,225,290.00	
INVESCO LTD	65,000	16.56	1,076,400.00	
KKR & CO INC-A	107,700	46.37	4,994,049.00	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	15,500	191.71	2,971,505.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	7,200	265.74	1,913,328.00	
MOODYS CORP	32,400	260.06	8,425,944.00	
MORGAN STANLEY	261,600	74.63	19,523,208.00	
MSCI INC	15,900	400.25	6,363,975.00	
NASDAQ INC	22,500	152.63	3,434,175.00	
NORTHERN TRUST CORP	38,300	93.93	3,597,519.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	38,900	90.01	3,501,389.00	
S&P GLOBAL INC	69,395	320.02	22,207,787.90	
SCHWAB(CHARLES)CORP	284,900	62.38	17,772,062.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	22,500	52.80	1,188,000.00	
STATE STREET CORP	72,800	63.80	4,644,640.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	43,800	109.89	4,813,182.00	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	21,300	68.84	1,466,292.00	
AES CORP	127,000	19.89	2,526,030.00	
VISTRA CORP	87,000	22.77	1,980,990.00	
TELADOC HEALTH INC	34,000	31.51	1,071,340.00	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	27,600	185.43	5,117,868.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	58,100	113.88	6,616,428.00	
AVANTOR INC	118,000	29.84	3,521,120.00	
BIO TECHNE CORP	7,500	329.30	2,469,750.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	4,300	475.09	2,042,887.00	
CHARLES RIVER LABORATORIES	9,600	208.58	2,002,368.00	
DANAHER CORP	133,100	243.87	32,459,097.00	

ILLUMINA INC	30,400	183.24	5,570,496.00
IQVIA HOLDINGS INC	37,700	198.77	7,493,629.00
METTLER-TOLEDO INTL	4,530	1,097.57	4,971,992.10
PERKINELMER INC	24,500	135.64	3,323,180.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	76,610	513.54	39,342,299.40
WATERS CORP	11,900	308.51	3,671,269.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	14,600	288.53	4,212,538.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	26,900	84.26	2,266,594.00
CLARIVATE PLC	65,000	13.10	851,500.00
COSTAR GROUP INC	75,700	56.07	4,244,499.00
EQUIFAX INC	24,300	175.32	4,260,276.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	25,900	121.88	3,156,692.00
LEIDOS HOLDINGS INC	25,800	96.90	2,500,020.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	22,200	79.28	1,760,016.00
TRUNSON	37,400	76.30	2,853,620.00
VERISK ANALYTICS INC	31,300	165.13	5,168,569.00
CBRE GROUP INC	64,700	71.04	4,596,288.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	220,000	4.88	1,073,600.00
ZILLOW GROUP INC - C	33,200	30.04	997,328.00
CABLE ONE INC	1,120	1,200.02	1,344,022.40
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	23,800	437.47	10,411,786.00
COMCAST CORP-CL A	886,100	38.48	34,097,128.00
DISH NETWORK CORP-A	51,000	16.52	842,520.00
FOX CORP-CLASS A	62,000	32.56	2,018,720.00
FOX CORP-CLASS B	30,000	30.14	904,200.00
INTERPUBLIC GROUP	79,000	27.21	2,149,590.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	27,100	108.89	2,950,919.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	34,000	35.33	1,201,220.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	17,000	35.34	600,780.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	75,000	15.22	1,141,500.00
OMNICOM GROUP	40,000	63.52	2,540,800.00
PARAMOUNT GLOBAL	120,000	24.60	2,952,000.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	141,000	5.91	833,310.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	153,500	76.05	11,673,675.00
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	105,000	12.50	1,312,500.00

	DISNEY (WALT) CO	356,500	93.29	33,257,885.00	
	ELECTRONIC ARTS	54,900	130.39	7,158,411.00	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	37,100	60.75	2,253,825.00	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	33,100	83.98	2,779,738.00	
	NETFLIX INC	87,300	170.91	14,920,443.00	
	ROBLOX CORP -CLASS A	68,000	29.64	2,015,520.00	
	ROKU INC	24,200	89.08	2,155,736.00	
	SEA LTD-ADR	70,000	72.87	5,100,900.00	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	31,000	128.78	3,992,180.00	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	441,000	14.04	6,191,640.00	
	ALPHABET INC-CL A	58,900	2,230.88	131,398,832.00	
	ALPHABET INC-CL C	55,630	2,240.30	124,627,889.00	
	IAC/INTERACTIVECORP	15,000	77.26	1,158,900.00	
	MATCH GROUP INC	55,300	70.04	3,873,212.00	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	452,200	157.05	71,018,010.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	112,000	18.42	2,063,040.00	
	SNAP INC-A	211,000	12.85	2,711,350.00	
	TWITTER INC	159,000	38.91	6,186,690.00	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	49,000	34.32	1,681,680.00	
小計	銘柄数：603			6,400,396,825.42	
				(873,590,162,701)	
	組入時価比率：70.2%			72.8%	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	133,000	17.72	2,356,760.00	
	CAMECO CORP	79,000	28.30	2,235,700.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	231,800	70.97	16,450,846.00	
	CENOVUS ENERGY INC	271,000	25.95	7,032,450.00	
	ENBRIDGE INC	399,000	53.59	21,382,410.00	
	IMPERIAL OIL	46,000	65.14	2,996,440.00	
	KEYERA CORP	41,000	30.22	1,239,020.00	
	PARKLAND CORP	28,000	34.08	954,240.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	107,000	46.12	4,934,840.00	
	SUNCOR ENERGY INC	282,000	48.12	13,569,840.00	
	TC ENERGY CORP	193,500	66.97	12,958,695.00	
	TOURMALINE OIL CORP	61,000	69.51	4,240,110.00	
	NUTRIEN LTD	108,800	111.50	12,131,200.00	

CCL INDUSTRIES INC - CL B	28,200	58.11	1,638,702.00	
AGNICO EAGLE MINES LTD	90,100	66.45	5,987,145.00	
BARRICK GOLD	345,000	25.30	8,728,500.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	118,000	29.13	3,437,340.00	
FRANCO-NEVADA CORP	37,600	181.37	6,819,512.00	
IVANHOE MINES LTD-CL A	122,000	8.40	1,024,800.00	
KINROSS GOLD CORP	250,000	5.44	1,360,000.00	
LUNDIN MINING CORP	137,000	9.56	1,309,720.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	43,000	27.70	1,191,100.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	92,000	49.00	4,508,000.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	89,000	50.59	4,502,510.00	
WEST FRASER TIMBER	14,200	101.45	1,440,590.00	
CAE INC	60,000	30.43	1,825,800.00	
WSP GLOBAL INC	22,800	137.81	3,142,068.00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	17,000	99.27	1,687,590.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	38,000	33.14	1,259,320.00	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	21,100	77.97	1,645,167.00	
AIR CANADA	32,000	17.44	558,080.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	117,100	141.13	16,526,323.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	183,100	89.78	16,438,718.00	
TFI INTERNATIONAL INC	17,000	96.55	1,641,350.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	55,700	73.66	4,102,862.00	
BRP INC/CA- SUB VOTING	7,400	81.44	602,656.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	37,000	36.27	1,341,990.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	59,100	62.37	3,686,067.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	11,500	167.01	1,920,615.00	
DOLLARAMA INC	55,600	73.60	4,092,160.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	165,000	53.50	8,827,500.00	
EMPIRE CO LTD A	32,000	40.91	1,309,120.00	
LOBLAW COMPANIES	33,400	111.67	3,729,778.00	
METRO INC	46,700	67.12	3,134,504.00	
WESTON(GEORGE)LTD	14,100	145.73	2,054,793.00	
SAPUTO INC	50,000	27.86	1,393,000.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	58,000	9.28	538,240.00	
BANK OF MONTREAL	126,300	127.36	16,085,568.00	

BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	237,000	80.19	19,005,030.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	176,200	65.35	11,514,670.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	65,900	87.81	5,786,679.00	
ROYAL BANK OF CANADA	277,300	126.38	35,045,174.00	
TORONTO DOMINION BANK	356,800	87.51	31,223,568.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,940	645.37	3,188,127.80	
GREAT-WEST LIFECO INC	57,000	31.55	1,798,350.00	
IA FINANCIAL CORP INC	21,100	62.09	1,310,099.00	
INTACT FINANCIAL CORP	34,400	176.95	6,087,080.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	381,000	22.13	8,431,530.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	109,000	33.66	3,668,940.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	115,300	59.27	6,833,831.00	
CGI INC	42,100	98.54	4,148,534.00	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	14,000	49.60	694,400.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	22,300	423.84	9,451,632.00	
BLACKBERRY LTD	94,000	6.79	638,260.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,920	1,857.60	7,281,792.00	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	29,000	28.82	835,780.00	
OPEN TEXT CORP	51,000	47.91	2,443,410.00	
BCE INC	14,400	62.58	901,152.00	
TELUS CORP	78,600	28.80	2,263,680.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	70,300	60.83	4,276,349.00	
EMERA INC	51,000	57.93	2,954,430.00	
FORTIS INC	92,400	58.12	5,370,288.00	
HYDRO ONE LTD	63,000	32.72	2,061,360.00	
ALTAGAS LTD	52,000	26.31	1,368,120.00	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	126,000	17.04	2,147,040.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	27,000	36.82	994,140.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	278,000	56.64	15,745,920.00	
IGM FINANCIAL INC	15,000	35.45	531,750.00	
ONEX CORPORATION	13,200	66.64	879,648.00	
TMX GROUP LTD	11,300	133.92	1,513,296.00	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	24,000	44.23	1,061,520.00	
NORTHLAND POWER INC	46,000	36.96	1,700,160.00	
	32,600	129.08	4,208,008.00	

	THOMSON REUTERS CORP				
	FIRSTSERVICE CORP	7,200	150.43	1,083,096.00	
	QUEBECOR INC-CL B	34,000	28.78	978,520.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	91,000	36.92	3,359,720.00	
小計	銘柄数：86			454,758,822.80	
				(47,936,127,511)	
	組入時価比率：3.8%			4.0%	
ユーロ	TENARIS SA	88,000	13.28	1,169,080.00	
	ENI SPA	500,000	12.08	6,040,000.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	96,000	11.40	1,094,880.00	
	NESTE OYJ	82,000	45.20	3,706,400.00	
	OMV AG	28,100	45.22	1,270,682.00	
	REPSOL SA	286,000	14.27	4,081,220.00	
	TOTALENERGIES SE	485,500	50.50	24,517,750.00	
	AIR LIQUIDE SA	102,900	131.20	13,500,480.00	
	AKZO NOBEL	36,600	66.54	2,435,364.00	
	ARKEMA	11,600	93.08	1,079,728.00	
	BASF SE	179,700	46.07	8,279,677.50	
	COVESTRO AG	38,000	36.12	1,372,560.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	39,000	22.58	880,620.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	34,700	140.00	4,858,000.00	
	OCI	21,000	32.96	692,160.00	
	SOLVAY SA	14,200	82.86	1,176,612.00	
	SYMRISE AG	25,500	100.80	2,570,400.00	
	UMICORE	39,000	37.91	1,478,490.00	
	CRH PLC	150,000	32.79	4,919,250.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	27,400	49.52	1,356,848.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	46,200	33.21	1,534,302.00	
	ARCELORMITTAL	119,000	24.80	2,951,200.00	
	VOESTALPINE AG	24,000	24.40	585,600.00	
	STORA ENSO OYJ-R	108,000	15.78	1,704,780.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	102,000	31.06	3,168,120.00	
	AIRBUS SE	116,100	96.08	11,154,888.00	
	DASSAULT AVIATION SA	5,000	152.40	762,000.00	
	MTU AERO ENGINES AG	10,100	177.40	1,791,740.00	
	RHEINMETALL AG	8,400	224.00	1,881,600.00	

SAFRAN SA	66,400	95.30	6,327,920.00
THALES SA	20,600	115.50	2,379,300.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	97,700	45.07	4,403,339.00
KINGSPAN GROUP PLC	29,900	59.10	1,767,090.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	46,168	24.23	1,118,650.64
BOUYGUES	46,000	30.61	1,408,060.00
EIFFAGE SA	15,900	87.56	1,392,204.00
FERROVIAL SA	96,091	23.27	2,236,037.57
VINCI	105,300	84.47	8,894,691.00
LEGRAND SA	51,200	70.48	3,608,576.00
PRYSMIAN SPA	48,000	27.45	1,317,600.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	106,400	114.52	12,184,928.00
SIEMENS ENERGY AG	89,000	15.77	1,403,530.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	45,000	17.85	803,475.00
SIEMENS AG	149,100	103.14	15,378,174.00
ALSTOM	61,000	24.62	1,501,820.00
CNH INDUSTRIAL NV	193,000	12.27	2,369,075.00
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	91,000	27.18	2,473,835.00
GEA GROUP AG	29,000	33.89	982,810.00
KION GROUP AG	13,100	40.73	533,563.00
KNORR-BREMSE AG	15,200	57.70	877,040.00
KONE OYJ	67,000	47.28	3,167,760.00
RATIONAL AG	1,050	552.00	579,600.00
WARTSILA OYJ	101,000	7.93	800,930.00
BRENTAG SE	31,300	65.64	2,054,532.00
IMCD NV	11,500	123.75	1,423,125.00
DEUTSCHE POST AG-REG	196,000	35.24	6,908,020.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	112,000	6.33	709,856.00
ADP	6,100	131.60	802,760.00
AENA SME SA	14,400	135.35	1,949,040.00
ATLANTIA SPA	98,000	22.31	2,186,380.00
GETLINK	83,000	17.42	1,445,860.00
CONTINENTAL AG	20,600	72.50	1,493,500.00
MICHELIN (CGDE)	131,600	27.81	3,659,796.00
VALEO SA	36,000	20.64	743,040.00

BAYER MOTOREN WERK	64,000	79.66	5,098,240.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,200	73.10	745,620.00
FERRARI NV	25,100	174.95	4,391,245.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	158,200	64.17	10,151,694.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	29,400	68.44	2,012,136.00
RENAULT SA	40,000	26.33	1,053,200.00
STELLANTIS NV	426,000	12.69	5,409,348.00
VOLKSWAGEN AG	5,400	186.10	1,004,940.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	35,800	146.48	5,243,984.00
SEB SA	5,400	91.50	494,100.00
ADIDAS AG	34,300	166.08	5,696,544.00
ESSILORLUXOTTICA	56,200	140.90	7,918,580.00
HERMES INTERNATIONAL	6,150	1,002.50	6,165,375.00
KERING SA	14,560	494.30	7,197,008.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	54,360	553.50	30,088,260.00
MONCLER SPA	42,000	37.09	1,557,780.00
PUMA SE	21,200	64.90	1,375,880.00
ACCOR SA	32,000	28.22	903,040.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	32,700	99.12	3,241,224.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	20,000	33.38	667,600.00
SODEXO	18,200	66.82	1,216,124.00
D' IETEREN GROUP	4,800	137.00	657,600.00
DELIVERY HERO SE	34,000	34.00	1,156,000.00
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	32,900	17.24	567,459.20
PROSUS NV	163,800	49.97	8,185,086.00
ZALANDO SE	45,000	25.49	1,147,050.00
INDITEX SA	209,000	22.07	4,612,630.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	119,000	18.29	2,176,510.00
HELLOFRESH SE	31,800	29.68	943,824.00
JERONIMO MARTINS	55,000	18.45	1,014,750.00
KESKO OYJ-B SHS	50,000	21.25	1,062,500.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	206,000	25.08	5,167,510.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	169,900	48.89	8,307,260.50
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	107,000	9.69	1,037,258.00
HEINEKEN HOLDING NV	22,000	67.15	1,477,300.00



HEINEKEN NV	49,600	85.32	4,231,872.00
PERNOD RICARD SA	41,400	169.35	7,011,090.00
REMY COINTREAU	4,900	160.80	787,920.00
DANONE	129,200	51.64	6,671,888.00
JDE PEET'S BV	21,000	25.62	538,020.00
KERRY GROUP PLC-A	31,000	89.50	2,774,500.00
HENKEL AG & CO KGAA	20,300	59.15	1,200,745.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	35,700	60.08	2,144,856.00
BEIERSDORF AG	19,800	94.08	1,862,784.00
LOREAL-ORD	47,400	315.60	14,959,440.00
BIOMERIEUX	8,800	85.74	754,512.00
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	7,200	107.75	775,800.00
DIASORIN SPA	4,800	117.95	566,160.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	174,000	19.92	3,466,776.00
SARTORIUS AG-VORZUG	5,100	307.60	1,568,760.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	53,900	44.33	2,389,387.00
AMPLIFON SPA	24,000	26.36	632,640.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	39,900	45.31	1,807,869.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	84,000	27.79	2,334,360.00
ARGENX SE	9,700	338.30	3,281,510.00
GRIFOLS SA	54,000	18.42	994,950.00
BAYER AG-REG	193,400	62.06	12,002,404.00
IPSEN	7,300	82.90	605,170.00
MERCK KGAA	25,300	158.65	4,013,845.00
ORION OYJ	21,000	38.05	799,050.00
RECORDATI SPA	19,900	38.10	758,190.00
SANOFI	222,700	94.43	21,029,561.00
UCB SA	24,500	80.24	1,965,880.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	82,000	11.58	949,560.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,286,000	4.30	5,540,088.00
BANCO SANTANDER SA	3,390,000	2.79	9,483,525.00
BNP PARIBAS	215,700	49.35	10,645,873.50
CAIXABANK	890,000	3.58	3,190,650.00
COMMERZBANK AG	215,000	8.41	1,809,870.00
CREDIT AGRICOLE SA	245,000	9.39	2,302,265.00

ERSTE GROUP BANK AG	70,000	27.68	1,937,600.00
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	111,000	11.23	1,246,530.00
ING GROEP NV	771,000	10.03	7,736,214.00
INTESA SANPAOLO	3,270,000	1.88	6,167,220.00
KBC GROEP NV	49,300	58.08	2,863,344.00
MEDIOBANCA S.P.A.	124,000	8.67	1,075,080.00
SOCIETE GENERALE	159,000	23.72	3,771,480.00
UNICREDIT SPA	406,000	10.32	4,193,168.00
EURAZEO SE	7,800	62.00	483,600.00
EXOR NV	22,000	62.00	1,364,000.00
GROUPE BRUXELLES LAM	21,400	79.86	1,709,004.00
SOFINA SA	2,900	193.50	561,150.00
WENDEL	6,000	78.65	471,900.00
AEGON NV	329,000	4.44	1,460,760.00
AGEAS	32,000	42.40	1,356,800.00
ALLIANZ SE-REG	79,600	185.14	14,737,144.00
ASSICURAZIONI GENERALI	219,000	15.68	3,435,015.00
AXA SA	382,000	22.63	8,646,570.00
HANNOVER RUECK SE	12,000	137.85	1,654,200.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	27,500	220.20	6,055,500.00
NN GROUP NV	53,400	45.23	2,415,282.00
POSTE ITALIANE SPA	103,000	8.72	898,160.00
SAMPO OYJ-A SHS	99,000	41.43	4,101,570.00
ADYEN NV	4,230	1,266.40	5,356,872.00
AMADEUS IT GROUP SA	89,500	53.32	4,772,140.00
BECHTLE AG	15,700	37.06	581,842.00
CAPGEMINI SA	32,100	171.45	5,503,545.00
EDENRED	50,000	46.40	2,320,000.00
NEXI SPA	104,000	7.97	828,880.00
WORLDLINE SA	44,800	36.79	1,648,192.00
DASSAULT SYSTEMES SE	130,000	34.08	4,431,050.00
NEMETSCHEK SE	11,000	55.00	605,000.00
SAP SE	205,200	89.46	18,357,192.00
NOKIA OYJ	1,075,000	4.53	4,876,200.00
ASM INTERNATIONAL NV	9,000	244.65	2,201,850.00

ASML HOLDING NV	79,600	469.75	37,392,100.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	259,000	24.40	6,319,600.00
STMICROELECTRONICS NV	133,000	32.32	4,298,560.00
CELLNEX TELECOM SA	106,000	37.54	3,979,240.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	638,000	18.35	11,708,576.00
ELISA OYJ	28,400	51.30	1,456,920.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	72,000	9.31	670,608.00
KONINKLIJKE KPN NV	660,000	3.33	2,201,100.00
ORANGE SA	397,000	10.93	4,341,592.00
PROXIMUS	26,000	14.51	377,260.00
TELECOM ITALIA SPA	1,930,000	0.25	500,449.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	210,000	2.79	587,160.00
TELEFONICA SA	1,027,000	4.54	4,662,580.00
TELEFONICA SA-RTS	1,026,999	0.14	150,404.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	28.03	470,904.00
ACCIONA S.A.	4,800	173.80	834,240.00
ELECTRICITE DE FRANCE	113,000	8.01	905,808.00
ELIA GROUP SA/NV	6,200	130.90	811,580.00
ELIA GROUP SA/NV-RTS	6,177	0.39	2,415.82
ENDESA S.A.	65,000	18.76	1,219,725.00
ENEL SPA	1,590,000	5.46	8,689,350.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	554,000	4.39	2,433,722.00
FORTUM OYJ	89,000	15.93	1,418,215.00
IBERDROLA SA	1,141,000	9.73	11,111,058.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	79,000	18.50	1,461,895.00
TERNA SPA	275,000	7.06	1,942,050.00
VERBUND AG	12,700	96.25	1,222,375.00
ENAGAS SA	48,000	20.88	1,002,240.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	26,000	26.75	695,500.00
SNAM SPA	384,000	4.87	1,873,536.00
E.ON SE	443,000	8.72	3,866,504.00
ENGIE	354,000	11.46	4,057,548.00
VEOLIA ENVIRONNEMENT	133,000	23.58	3,136,140.00
AMUNDI SA	12,800	49.64	635,392.00
DEUTSCHE BANK AG-REG	405,000	9.70	3,932,145.00

	DEUTSCHE BOERSE AG	36,900	154.75	5,710,275.00	
	EURONEXT NV	15,700	75.64	1,187,548.00	
	EDP RENOVAVEIS SA	58,000	22.23	1,289,340.00	
	RWE AG	124,000	39.01	4,837,240.00	
	UNIPER SE	15,100	18.45	278,595.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	25,500	72.68	1,853,340.00	
	QIAGEN N.V.	44,000	40.99	1,803,560.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	5,500	277.70	1,527,350.00	
	BUREAU VERITAS SA	54,000	24.49	1,322,460.00	
	RANDSTAD NV	21,400	47.34	1,013,076.00	
	TELEPERFORMANCE	11,300	278.60	3,148,180.00	
	WOLTERS KLUWER	50,300	86.34	4,342,902.00	
	AROUNDTOWN SA	206,000	3.66	754,372.00	
	LEG IMMOBILIEN SE	14,000	80.64	1,128,960.00	
	VONOVIA SE	139,000	31.71	4,407,690.00	
	PUBLICIS GROUPE	43,300	47.53	2,058,049.00	
	VIVENDI SE	145,000	10.45	1,515,975.00	
	BOLLORE SE	168,000	4.94	829,920.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	17,300	43.27	748,571.00	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	143,000	18.85	2,696,694.00	
	SCOUT24 SE	15,200	52.10	791,920.00	
小計	銘柄数：225			791,735,341.73	
				(113,582,352,124)	
	組入時価比率：9.1%				9.5%
英ボンド	BP PLC	3,828,000	3.95	15,133,998.00	
	SHELL PLC-NEW	1,490,000	21.51	32,049,900.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	26,300	60.82	1,599,566.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	40,000	20.46	818,400.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	247,000	33.74	8,333,780.00	
	ANTOFAGASTA PLC	79,000	13.29	1,050,305.00	
	GLENCORE PLC	1,949,000	4.82	9,405,874.00	
	RIO TINTO PLC-REG	219,100	52.50	11,502,750.00	
	MONDI PLC	91,000	14.81	1,348,165.00	
	BAE SYSTEMS PLC	617,000	7.62	4,701,540.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,680,000	0.90	1,525,944.00	

DCC PLC	18,400	51.34	944,656.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	870,000	1.56	1,359,375.00
SMITHS GROUP PLC	80,000	14.56	1,164,800.00
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	14,100	92.00	1,297,200.00
ASHTED GROUP PLC	86,500	33.65	2,910,725.00
BUNZLE	66,000	25.89	1,708,740.00
FERGUSON PLC	43,500	90.18	3,922,830.00
RENTOKIL INTIAL PLC	373,000	4.49	1,675,516.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	207,000	4.60	952,200.00
PERSIMMON PLC	64,000	18.50	1,184,000.00
TAYLOR WIMPEY PLC	710,000	1.17	832,830.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	20,871	37.92	791,428.32
BURBERRY GROUP PLC	82,000	16.37	1,342,750.00
COMPASS GROUP PLC	353,000	16.91	5,969,230.00
ENTAIN PLC	110,000	13.06	1,436,600.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	35,400	43.08	1,525,032.00
WHITBREAD PLC	41,000	26.06	1,068,460.00
NEXT PLC	26,000	59.08	1,536,080.00
JD SPORTS FASHION PLC	465,000	1.06	496,620.00
KINGFISHER PLC	390,000	2.45	955,500.00
OCADO GROUP PLC	92,000	8.55	787,152.00
SAINSBURY	340,000	2.05	697,340.00
TESCO PLC	1,470,000	2.49	3,672,060.00
COCA-COLA HBC AG-DI	39,000	17.95	700,050.00
DIAGEO PLC	453,000	35.28	15,984,105.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	68,000	16.10	1,095,140.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	426,000	34.97	14,899,350.00
IMPERIAL BRANDS PLC	180,000	18.30	3,294,900.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	140,900	61.16	8,617,444.00
UNILEVER PLC	503,000	36.03	18,125,605.00
SMITH & NEPHEW PLC	170,000	11.40	1,938,850.00
NMC HEALTH PLC	13,300	0.00	53.20
ASTRAZENECA PLC	303,380	101.28	30,726,326.40
GSK PLC	995,000	16.91	16,831,420.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	37,000	14.82	548,340.00

BARCLAYS PLC	3,290,000	1.60	5,277,818.00	
HSBC HOLDINGS PLC	3,966,000	5.38	21,368,808.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	14,030,000	0.43	6,095,333.50	
NATWEST GROUP PLC	1,120,000	2.21	2,478,560.00	
STANDARD CHARTERED PLC	509,000	6.15	3,132,386.00	
M&G PLC	500,000	2.00	1,000,000.00	
ADMIRAL GROUP PLC	35,000	21.03	736,050.00	
AVIVA PLC	568,000	4.15	2,357,768.00	
LEGAL & GENERAL	1,140,000	2.45	2,794,140.00	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	144,000	6.20	893,088.00	
PRUDENTIAL PLC	534,000	9.76	5,211,840.00	
AVEVA GROUP PLC	26,000	24.88	646,880.00	
SAGE GROUP PLC (THE)	197,000	6.25	1,232,826.00	
HALMA PLC	76,000	19.31	1,467,940.00	
BT GROUP PLC	1,390,000	1.86	2,590,265.00	
VODAFONE GROUP PLC	5,250,000	1.27	6,707,400.00	
SSE PLC	212,000	16.08	3,410,020.00	
NATIONAL GRID PLC	707,000	10.28	7,271,495.00	
SEVERN TRENT PLC	48,000	27.67	1,328,160.00	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	135,000	10.16	1,372,275.00	
3I GROUP PLC	190,000	10.69	2,031,100.00	
ABRDN PLC	420,000	1.65	693,420.00	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	65,000	7.75	503,750.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	64,700	71.66	4,636,402.00	
SCHRODERS PLC	24,000	26.82	643,680.00	
ST JAMES S PLACE PLC	104,000	11.30	1,175,200.00	
EXPERIAN PLC	178,000	22.85	4,067,300.00	
INTERTEK GROUP PLC	31,000	42.88	1,329,280.00	
RELX PLC	378,000	21.02	7,945,560.00	
INFORMA PLC	300,000	5.44	1,632,000.00	
PEARSON	124,000	7.88	978,112.00	
WPP PLC	215,000	8.28	1,781,490.00	
AUTO TRADER GROUP PLC	195,000	5.29	1,032,330.00	
小計銘柄数：79			344,285,606.42	
			(57,537,010,544)	

	組入時価比率：4.6%			4.8%
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	41,000	18.26	748,660.00
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,370	700.50	959,685.00
	GIVAUDAN-REG	1,790	3,109.00	5,565,110.00
	SIKA AG-REG	28,800	221.50	6,379,200.00
	HOLCIM LTD	109,000	44.54	4,854,860.00
	GEBERIT AG-REG	6,880	456.40	3,140,032.00
	ABB LTD	324,000	25.96	8,411,040.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	4,900	170.20	833,980.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,400	173.95	1,287,230.00
	VAT GROUP AG	5,300	235.00	1,245,500.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	10,900	225.00	2,452,500.00
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	102,900	97.58	10,040,982.00
	THE SWATCH GROUP AG-B	5,500	225.30	1,239,150.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10,500	42.54	446,670.00
	BARRY CALLEBAUT AG	710	2,084.00	1,479,640.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	212	9,140.00	1,937,680.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	20	94,700.00	1,894,000.00
	NESTLE SA-REG	551,200	107.36	59,176,832.00
	ALCON INC	98,000	63.94	6,266,120.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	10,300	285.90	2,944,770.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	22,100	102.20	2,258,620.00
	NOVARTIS AG-REG	429,000	78.84	33,822,360.00
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	137,600	301.35	41,465,760.00
	ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	5,400	343.00	1,852,200.00
	VIFOR PHARMA AG/NEW	9,100	167.30	1,522,430.00
	BALOISE HOLDING AG	8,600	155.30	1,335,580.00
	SWISS LIFE HOLDING AG	6,010	485.60	2,918,456.00
	SWISS RE LTD	60,000	74.24	4,454,400.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	29,600	412.20	12,201,120.00
	TEMENOS AG-REG	13,700	76.98	1,054,626.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	34,200	52.46	1,794,132.00
	SWISSCOM AG-REG	4,850	521.00	2,526,850.00
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	504,000	5.78	2,914,128.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	42,200	44.83	1,891,826.00	

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	4,440	846.40	3,758,016.00	
	UBS GROUP AG	687,000	15.42	10,596,975.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	5,500	68.60	377,300.00	
	LONZA AG-REG	14,720	489.50	7,205,440.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	33,000	34.09	1,124,970.00	
	SGS SA-REG	1,270	2,132.00	2,707,640.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	15,300	82.70	1,265,310.00	
小計	銘柄数：41			260,351,780.00	
				(36,714,808,015)	
	組入時価比率：2.9%			3.1%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	37,000	437.90	16,202,300.00	
	BOLIDEN AB	53,000	360.00	19,080,000.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	19,000	437.90	8,320,100.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	123,000	158.55	19,501,650.00	
	ASSA ABLOY AB-B	200,000	214.50	42,900,000.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	298,000	74.14	22,093,720.00	
	SKANSKA AB-B SHS	66,000	157.20	10,375,200.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	26,000	201.80	5,246,800.00	
	LIFCO AB-B SHS	42,000	164.75	6,919,500.00	
	ALFA LAVAL AB	63,000	253.40	15,964,200.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	523,600	98.80	51,731,680.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	314,000	87.73	27,547,220.00	
	EPIROC AB - A	129,000	169.00	21,801,000.00	
	EPIROC AB - B	79,000	145.00	11,455,000.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	73,000	77.02	5,622,460.00	
	INDUTRADE AB	55,000	192.90	10,609,500.00	
	SANDVIK AB	207,000	180.00	37,260,000.00	
	SKF AB-B SHARES	78,000	164.80	12,854,400.00	
	VOLVO AB-A SHS	40,000	173.70	6,948,000.00	
	VOLVO AB-B SHS	297,000	167.52	49,753,440.00	
	SECURITAS AB-B SHS	54,000	87.84	4,743,360.00	
	VOLVO CAR AB-B	120,000	76.00	9,120,000.00	
	ELECTROLUX AB-B	41,000	137.22	5,626,020.00	
	EVOLUTION AB	36,300	930.40	33,773,520.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	146,000	123.54	18,036,840.00	



	SWEDISH MATCH AB	308,000	100.85	31,061,800.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	116,000	253.40	29,394,400.00	
	GETINGE AB-B SHS	45,000	223.60	10,062,000.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,000	214.90	7,736,400.00	
	NORDEA BANK ABP	655,000	96.43	63,161,650.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	314,000	106.15	33,331,100.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	283,000	90.16	25,515,280.00	
	SWEDBANK AB	170,000	137.80	23,426,000.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	24,092	234.60	5,651,983.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	32,000	231.80	7,417,600.00	
	INVESTOR AB-A SHS	96,000	186.00	17,856,000.00	
	INVESTOR AB-B SHS	354,000	167.12	59,160,480.00	
	KINNEVIK AB - B	44,000	162.55	7,152,200.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	15,500	424.00	6,572,000.00	
	SINCH AB	92,000	37.62	3,461,040.00	
	ERICSSON LM-B	570,000	77.86	44,380,200.00	
	HEXAGON AB-B SHS	377,000	106.20	40,037,400.00	
	TELIA CO AB	530,000	38.47	20,389,100.00	
	TELE 2 AB-B SHS	116,000	112.30	13,026,800.00	
	EQT AB	59,000	215.60	12,720,400.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	112,200	54.00	6,058,800.00	
	SAGAX AB-B	40,000	199.00	7,960,000.00	
	EMBRACER GROUP AB	134,000	80.33	10,764,220.00	
小計	銘柄数：48			959,782,763.20	
				(12,899,480,337)	
	組入時価比率：1.0%			1.1%	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	22,000	362.30	7,970,600.00	
	EQUINOR ASA	192,000	347.00	66,624,000.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	33,100	452.10	14,964,510.00	
	NORSK HYDRO	266,000	63.22	16,816,520.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	17,000	338.00	5,746,000.00	
	MOWI ASA	84,000	236.90	19,899,600.00	
	ORKLA ASA	153,000	74.40	11,383,200.00	
	SALMAR ASA	11,400	677.00	7,717,800.00	
	DNB BANK ASA	186,000	177.20	32,959,200.00	

	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	40,000	192.90	7,716,000.00	
	TELENOR ASA	129,000	128.20	16,537,800.00	
	ADEVINTA ASA	63,000	72.50	4,567,500.00	
小計	銘柄数：12			212,902,730.00	
				(2,940,186,701)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	20,400	491.50	10,026,600.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	40,200	415.70	16,711,140.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	1,700	1,587.00	2,697,900.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	201,000	174.24	35,022,240.00	
	DSV A/S	38,100	1,015.00	38,671,500.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	620	17,190.00	10,657,800.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,090	17,395.00	18,960,550.00	
	PANDORA A/S	20,000	465.50	9,310,000.00	
	CARLSBERG B	19,300	879.60	16,976,280.00	
	COLOPLAST-B	22,100	765.00	16,906,500.00	
	DEMANT A/S	20,100	266.40	5,354,640.00	
	GN STORE NORD A/S	24,100	223.10	5,376,710.00	
	GENMAB A/S	12,600	2,105.00	26,523,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	329,800	761.30	251,076,740.00	
	DANSKE BANK AS	132,000	111.25	14,685,000.00	
	TRYG A/S	68,000	159.90	10,873,200.00	
	ORSTED A/S	37,100	721.10	26,752,810.00	
小計	銘柄数：17			516,582,610.00	
				(9,964,878,546)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
豪ドル	AMPOL LTD	49,000	33.08	1,620,920.00	
	SANTOS LTD.	638,000	7.41	4,727,580.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	38,000	22.78	865,640.00	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	372,000	31.36	11,665,920.00	
	ORICA LTD	79,000	15.06	1,189,740.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	85,000	29.65	2,520,250.00	
	BHP GROUP LIMITED	991,000	40.95	40,581,450.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	90,000	15.87	1,428,300.00	
	EVOLUTION MINING LTD	340,000	3.44	1,169,600.00	

FORTESCUE METALS GROUP LTD	328,000	17.59	5,769,520.00	
MINERAL RESOURCES LTD	34,000	49.31	1,676,540.00	
NEWCREST MINING	175,000	23.75	4,156,250.00	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	222,000	8.12	1,802,640.00	
RIO TINTO LTD	73,000	103.90	7,584,700.00	
SOUTH32 LTD	930,000	4.16	3,868,800.00	
REECE LTD	49,000	13.79	675,710.00	
BRAMBLES LTD	270,000	10.59	2,859,300.00	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	170,000	4.55	773,500.00	
AURIZON HOLDINGS LTD	380,000	3.81	1,447,800.00	
TRANSURBAN GROUP	603,000	13.95	8,411,850.00	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	119,000	34.29	4,080,510.00	
CROWN RESORTS LTD	77,000	13.09	1,007,930.00	
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	10,300	63.86	657,758.00	
LOTTERY CORP LTD/THE	420,000	4.52	1,898,400.00	
WESFARMERS LIMITED	224,000	42.91	9,611,840.00	
COLES GROUP LTD	260,000	17.20	4,472,000.00	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	253,000	7.32	1,851,960.00	
WOOLWORTHS GROUP LTD	240,000	33.74	8,097,600.00	
TREASURY WINE ESTATES LTD	135,000	10.82	1,460,700.00	
COCHLEAR LTD	12,800	190.55	2,439,040.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	36,500	71.53	2,610,845.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	90,000	32.60	2,934,000.00	
CSL LIMITED	94,700	260.00	24,622,000.00	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	554,000	21.95	12,160,300.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	334,200	89.67	29,967,714.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	637,000	27.05	17,230,850.00	
WESTPAC BANKING CORP	691,000	19.71	13,619,610.00	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	480,000	4.32	2,073,600.00	
MEDIBANK PRIVATE LTD	520,000	3.17	1,648,400.00	
QBE INSURANCE	290,000	11.84	3,433,600.00	
SUNCORP GROUP LTD	245,000	10.91	2,672,950.00	
COMPUTERSHARE LTD	101,000	23.92	2,415,920.00	
WISETECH GLOBAL LTD	28,000	35.56	995,680.00	
XERO LIMITED	25,500	75.51	1,925,505.00	

	TELSTRA CORP LTD	790,000	3.82	3,017,800.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	330,000	5.67	1,871,100.00	
	APA GROUP	229,000	10.71	2,452,590.00	
	ASX LTD	37,800	78.52	2,968,056.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	70,700	164.00	11,594,800.00	
	IDP EDUCATION LTD	37,000	22.97	849,890.00	
	REA GROUP LTD	10,400	99.34	1,033,136.00	
	SEEK LTD	70,000	19.41	1,358,700.00	
小計	銘柄数：52			283,830,794.00	
				(26,881,614,499)	
	組入時価比率：2.2%			2.2%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	223,000	7.27	1,621,210.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	109,000	19.61	2,137,490.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	380,000	4.70	1,786,000.00	
	MERCURY NZ LTD	137,000	5.41	741,170.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	250,000	4.37	1,092,500.00	
小計	銘柄数：5			7,378,370.00	
				(634,244,685)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	330,000	18.08	5,966,400.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	524,040	52.65	27,590,706.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	276,000	82.80	22,852,800.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	280,000	23.35	6,538,000.00	
	MTR CORP	307,000	41.10	12,617,700.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	441,000	41.05	18,103,050.00	
	SANDS CHINA LTD	512,000	14.72	7,536,640.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	410,000	14.20	5,822,000.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	350,000	20.95	7,332,500.00	
	WH GROUP LIMITED	1,538,306	5.59	8,599,130.54	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	720,000	31.65	22,788,000.00	
	HANG SENG BANK	150,000	139.70	20,955,000.00	
	AIA GROUP LTD	2,369,000	81.60	193,310,400.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	719,600	10.46	7,527,016.00	

	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	134,000	48.95	6,559,300.00	
	CLP HLDGS	317,000	67.40	21,365,800.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	277,000	49.65	13,753,050.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	2,220,383	8.35	18,540,198.05	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	237,400	364.20	86,461,080.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	383,040	52.55	20,128,752.00	
	ESR GROUP LTD	380,000	20.95	7,961,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	360,000	14.72	5,299,200.00	
	HENDERSON LAND	267,443	29.20	7,809,335.60	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	309,916	28.15	8,724,135.40	
	SINO LAND CO.LTD	620,000	11.30	7,006,000.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	281,000	93.10	26,161,100.00	
	SWIRE PACIFIC-A	104,000	45.10	4,690,400.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	230,000	18.92	4,351,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	311,000	34.60	10,760,600.00	
小計	銘柄数：29			617,110,893.59	
				(10,731,558,439)	
	組入時価比率：0.9%			0.9%	
シンガポールドル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	310,000	3.93	1,218,300.00	
	KEPPEL CORP.	280,000	6.61	1,850,800.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	280,000	5.21	1,458,800.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,130,000	0.73	830,550.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	380,000	4.02	1,527,600.00	
	DBS GROUP HLDGS	358,000	30.25	10,829,500.00	
	OCBC-ORD	672,000	11.50	7,728,000.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	228,000	26.85	6,121,800.00	
	VENTURE CORP LTD	58,000	16.87	978,460.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,610,000	2.55	4,105,500.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	173,000	9.47	1,638,310.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	530,000	3.81	2,019,300.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	8.16	571,200.00	
	UOL GROUP LIMITED	87,000	7.26	631,620.00	
小計	銘柄数：14			41,509,740.00	

					(4,084,143,318)	
		組入時価比率：0.3%				0.3%
新シケル	ICL GROUP LTD		139,000	34.25	4,760,750.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD		5,000	691.80	3,459,000.00	
	BANK HAPOALIM BM		254,000	30.40	7,721,600.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL		289,000	32.15	9,291,350.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A		251,000	18.41	4,620,910.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		28,000	113.80	3,186,400.00	
	NICE LTD		11,600	687.80	7,978,480.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD		22,000	161.40	3,550,800.00	
	AZRIELI GROUP		8,600	248.20	2,134,520.00	
	小計	銘柄数：9				46,703,810.00
					(1,844,996,651)	
		組入時価比率：0.1%				0.2%
合計					1,199,341,564,071	
					(1,199,341,564,071)	

(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6月22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	29,700	3,909,114.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	61,000	2,027,640.00	
		AMERICAN TOWER CORP	89,300	22,043,705.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	315,000	1,874,250.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	27,500	5,263,500.00	
		BOSTON PROPERTIES	28,600	2,574,000.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	19,800	2,581,326.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	84,300	13,653,228.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	55,600	7,124,584.00	
		DUKE REALTY CORP	74,000	3,891,660.00	
		EQUINIX INC	17,880	11,446,418.40	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,600	2,406,776.00	

	EQUITY RESIDENTIAL	70,200	5,002,452.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,600	3,218,922.00	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	25,900	4,191,138.00	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	106,000	2,637,280.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	135,000	2,223,450.00	
	INVITATION HOMES INC	118,000	4,015,540.00	
	IRON MOUNTAIN INC	57,700	2,722,863.00	
	KIMCO REALTY CORP	123,000	2,339,460.00	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	119,000	1,744,540.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	22,500	3,682,800.00	
	PROLOGIS INC	144,100	16,191,076.00	
	PUBLIC STORAGE	30,900	9,334,581.00	
	REALTY INCOME CORP	114,600	7,502,862.00	
	REGENCY CENTERS CORP	28,800	1,681,056.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	21,100	6,398,364.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	65,100	6,288,009.00	
	SUN COMMUNITIES INC	22,500	3,479,625.00	
	UDR INC	64,000	2,822,400.00	
	VENTAS INC	77,400	3,757,770.00	
	VICI PROPERTIES INC	187,000	5,583,820.00	
	VORNADO REALTY TRUST	32,000	904,640.00	
	WELLTOWER INC	88,500	6,963,180.00	
	WEYERHAEUSER CO	147,000	4,915,680.00	
	WP CAREY INC	36,500	3,063,810.00	
小計	銘柄数：36	2,686,680	189,461,519.40	
			(25,859,602,782)	
	組入時価比率：2.1%		85.9%	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	658,729.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	28,000	571,200.00	
小計	銘柄数：2	42,900	1,229,929.00	
			(129,646,815)	
	組入時価比率：0.0%		0.4%	
ユーロ	COVIVIO	8,100	462,915.00	
	GECINA SA	9,600	936,000.00	
	KLEPIERRE	40,000	826,800.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,900	1,297,292.00	

小計	WAREHOUSES DE PAUW SCA	29,000	916,980.00	
	銘柄数：5	110,600	4,439,987.00	(636,960,535)
	組入時価比率：0.1%			2.1%
英ポンド	BRITISH LAND	183,000	922,320.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	132,000	949,344.00	
	SEGRO PLC	231,000	2,275,350.00	
	小計	銘柄数：3	546,000	4,147,014.00
	組入時価比率：0.1%			2.3%
豪ドル	DEXUS/AU	219,000	2,003,850.00	
	GOODMAN GROUP	332,000	5,819,960.00	
	GPT GROUP	380,000	1,596,000.00	
	LENDLEASE GROUP	135,000	1,229,850.00	
	MIRVAC GROUP	750,000	1,530,000.00	
	SCENTRE GROUP	1,010,000	2,646,200.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	460,000	1,679,000.00	
	VICINITY CENTRES	800,000	1,504,000.00	
	小計	銘柄数：8	4,086,000	18,008,860.00
	組入時価比率：0.1%			5.7%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	3,501,500.00	
	LINK REIT	414,000	26,703,000.00	
	小計	銘柄数：2	884,000	30,204,500.00
	組入時価比率：0.0%			1.7%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	620,040	1,705,110.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,044,221	2,234,632.94	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	490,000	877,100.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	570,329	935,339.56	
	小計	銘柄数：4	2,724,590	5,752,182.50
	組入時価比率：0.0%			1.9%
合計			30,116,091,732	(30,116,091,732)



(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 6月22日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	14,943,524,226	-	14,982,129,527	38,605,301
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	2,571,904,326	-	2,598,819,430	26,915,104
米ドル	1,444,175,798	-	1,460,357,400	16,181,602
カナダドル	93,419,595	-	94,863,600	1,444,005
ユーロ	483,116,211	-	487,767,400	4,651,189
英ポンド	82,801,000	-	83,556,500	755,500
スイスフラン	167,644,240	-	169,223,160	1,578,920
スウェーデンクローナ	66,815,000	-	67,198,500	383,500
ノルウェークローネ	6,841,440	-	6,904,850	63,410
デンマーククローネ	43,933,542	-	44,367,000	433,458
豪ドル	65,823,240	-	66,293,990	470,750
シンガポールドル	58,408,260	-	59,030,580	622,320
新シェケル	58,926,000	-	59,256,450	330,450
合計	-	-	-	65,520,405

### (注) 時価の算定方法

#### 1 先物取引

##### 外国先物取引について

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

#### 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 新興国株式マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(2022年 6月22日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	2,965,263,633
コール・ローン	360,113,501
株式	68,010,971,150
投資信託受益証券	3,386,163,348
投資証券	80,423,882
派生商品評価勘定	56,833,984
未収入金	21,168,080
未収配当金	225,980,599
差入委託証拠金	941,027,777
流動資産合計	76,047,945,954
資産合計	76,047,945,954
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	109,192
未払金	59,229,079
未払解約金	20,126,530
未払利息	264
その他未払費用	2,319,100
流動負債合計	81,784,165
負債合計	81,784,165
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	47,212,801,225
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	28,753,360,564
元本等合計	75,966,161,789
純資産合計	75,966,161,789
負債純資産合計	76,047,945,954

### 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
--------------------	----

	<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	<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 6月22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	1.6090円
(10,000口当たり純資産額)	(16,090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 6月23日

至 2022年 6月22日

## 1. 金融商品に対する取組方針

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

## 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

当ファンドは、信託財産に属する資産の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。

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

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

## 市場リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

2022年 6月22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 6月22日現在

期首	2021年 6月23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	41,493,863,678円
同期中における追加設定元本額	10,566,516,940円
同期中における一部解約元本額	4,847,579,393円
期末元本額	47,212,801,225円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	20,131,497円
野村資産設計ファンド2020	21,403,534円
野村資産設計ファンド2025	37,649,330円
野村資産設計ファンド2030	56,197,079円
野村資産設計ファンド2035	47,700,610円
野村資産設計ファンド2040	89,956,763円
野村資産設計ファンド2045	18,383,580円
野村インデックスファンド・新興国株式 ネクストコア	3,626,130,031円 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	485,034,952円
野村資産設計ファンド2050	22,484,625円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	6,408,587円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	3,753,517円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	2,918,056円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	2,527,147円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,533,989円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,129,809円
インデックス・ブレンド(タイプ )	8,762,868円
インデックス・ブレンド(タイプ )	3,283,159円
インデックス・ブレンド(タイプ )	13,436,048円
野村つみたて外国株投信	4,455,563,912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)	1,071,042,981円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	1,913,353,619円
世界6資産分散ファンド	108,902,167円
野村資産設計ファンド2060	16,286,704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 ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	1,254,943,747円 1,461,507,669円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	4,248,902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)	445,887,959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)	784,932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)	31,818,669,656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	17,586,449円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	16,040,875円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	12,364,680円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	8,250,544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)	54,527,353円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年6月22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	20,300	12.18	247,254.00	
		INNER MONGOLIA YITAI COAL CO LTD	85,000	1.58	134,300.00	
		LUKOIL PJSC-SPON ADR	32,050	0.00	0.00	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	7,000	0.00	0.00	
		PJSC GAZPROM-ADR	456,300	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	
		PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	12,100	0.00	0.00	
		QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	11,579	93.59	1,083,678.61	
		CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	21,600	7.53	162,648.00	
		NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	10,300	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-REG S-GDR	4,710	0.00	0.00	
		SEVERSTAL-GDR REG S	15,800	0.00	0.00	
		SOUTHERN COPPER CORP	6,300	55.32	348,516.00	
		ZTO EXPRESS CAYMAN INC	34,600	24.14	835,244.00	
		LI AUTO INC - ADR	43,200	35.75	1,544,400.00	
		NIO INC ADR	105,000	22.66	2,379,300.00	
		XPENG INC ADR	33,700	30.09	1,014,033.00	
		HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR	14,300	32.80	469,040.00	
		TRIP.COM GROUP LTD-ADR	43,200	23.07	996,624.00	
		YUM CHINA HOLDINGS INC	34,700	41.67	1,445,949.00	
		OZON HOLDINGS PLC - ADR	5,300	0.00	0.00	
		PINDUODUO INC ADR	35,580	63.05	2,243,319.00	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	41,400	10.75	445,050.00			
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	12.85	91,235.00
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	56,300	2.29	128,927.00
BEIGENE, LTD ADR	3,560	152.67	543,505.20
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	4,500	47.58	214,110.00
ZAI LAB LTD - ADR	7,090	29.05	205,964.50
HUTCHMED CHINA-ADR	7,800	11.73	91,494.00
BANCO DE CHILE-ADR	18,100	19.67	356,027.00
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	13,800	17.83	246,054.00
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	10,030	35.51	356,165.30
CREDICORP LTD	5,670	126.54	717,481.80
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	811,000	0.00	0.00
STATE BANK OF INDIA-GDR	13,800	57.50	793,500.00
TCS GROUP HOLDING-REG S	9,300	0.00	0.00
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	87,890	0.00	0.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	29,000	4.09	118,842.00
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4,100	67.00	274,700.00
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	28,650	0.00	0.00
ENEL AMERICAS S.A-ADR	29,900	4.78	142,922.00
ENEL CHILE SA-ADR	42,900	1.24	53,196.00
INTER RAO UES PJSC	3,660,000	0.00	0.00
360 DIGITECH INC-ADR	6,000	16.84	101,040.00
LUFAX HOLDING LTD	67,100	6.82	457,622.00
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	133,000	0.00	0.00
TAL EDUCATION GROUP-ADR	29,730	4.77	141,812.10
KE HOLDINGS INC ADR	27,600	17.14	473,064.00
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	87,648	0.94	82,476.76
IQIYI INC-ADR	21,400	4.62	98,868.00
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	59,400	4.68	277,992.00
AUTOHOME INC-ADR	7,500	34.24	256,800.00
JOYY INC	4,250	31.08	132,090.00
KANZHUN LTD	8,400	24.37	204,708.00
VK CO LTD GDR	7,000	0.00	0.00
WEIBO CORP-SPON ADR	4,500	22.58	101,610.00
YANDEX NV-A	23,640	0.00	0.00

	小計	銘柄数：63			20,011,562.27 (2,731,378,134)	
		組入時価比率：3.6%				4.0%
メキシコペソ		ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	93,958	48.39	4,546,627.62	
		CEMEX SAB - CPO	1,121,985	7.35	8,246,589.75	
		GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	254,983	91.03	23,211,102.49	
		INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	208.73	1,755,419.30	
		ALFA S.A.B.-A	218,000	13.59	2,962,620.00	
		GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	75.76	2,644,024.00	
		GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	18,900	415.58	7,854,462.00	
		GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	30,400	287.87	8,751,248.00	
		PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,400	144.12	2,363,568.00	
		WALMART DE MEXICO-SER V	408,000	68.64	28,005,120.00	
		ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	32,000	128.91	4,125,120.00	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	38,000	115.00	4,370,000.00	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	156,800	138.91	21,781,088.00	
		GRUMA S.A.B.-B	15,600	221.36	3,453,216.00	
		GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	107,000	61.70	6,601,900.00	
		KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	110,000	26.74	2,941,400.00	
		GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	213,200	118.77	25,321,764.00	
		GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	169,000	33.40	5,644,600.00	
		AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,244,000	19.93	44,722,920.00	
		GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	178,000	34.38	6,119,640.00	
	小計	銘柄数：20			215,422,429.16 (1,457,268,106)	
		組入時価比率：1.9%				2.1%
リアル		COSAN SA	86,800	18.44	1,600,592.00	
		PETRO RIO SA	65,300	22.73	1,484,269.00	
		PETROBRAS - PETROLEO BRAS	302,000	29.87	9,020,740.00	
		PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	383,000	27.07	10,367,810.00	
		ULTRAPAR PARTICIPACOES	48,000	12.18	584,640.00	
		BRASKEM SA-PREF A	13,200	37.19	490,908.00	
		KLABIN SA-UNIT	61,000	20.10	1,226,100.00	
		CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	16.74	773,388.00	
		GERDAU SA PFD NPV	95,000	23.86	2,266,700.00	



VALE SA	323,652	76.00	24,597,552.00
SUZANO SA	62,960	48.63	3,061,744.80
WEG SA	134,748	25.30	3,409,124.40
LOCALIZA RENT A CAR	45,660	49.70	2,269,302.00
RUMO SA	96,000	16.75	1,608,000.00
CCR SA	121,000	12.53	1,516,130.00
AMERICANAS SA	60,039	13.37	802,721.43
LOJAS RENNER S.A.	69,074	23.11	1,596,300.14
MAGAZINE LUIZA SA	230,000	2.51	577,300.00
VIBRA ENERGIA SA	83,600	17.03	1,423,708.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	29,600	16.27	481,592.00
RAIA DROGASIL SA	78,200	18.81	1,470,942.00
AMBEV SA	389,956	13.17	5,135,720.52
BRF SA	63,000	12.47	785,610.00
JBS SA	74,600	32.38	2,415,548.00
NATURA &CO HOLDING SA	62,500	13.83	864,375.00
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	328,987	5.72	1,881,805.64
REDE D'OR SAO LUIZ SA	29,800	30.27	902,046.00
HYPERA SA	33,000	37.50	1,237,500.00
BANCO BRADESCO S.A.	122,153	15.42	1,883,599.26
BANCO BRADESCO SA - PREF	410,342	18.64	7,648,774.88
BANCO DO BRASIL SA	72,800	32.98	2,400,944.00
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	30.70	749,080.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	394,991	24.21	9,562,732.11
ITAUSA SA	352,817	8.82	3,111,845.94
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	67,000	25.31	1,695,770.00
TOTVS SA	40,000	24.03	961,200.00
TELEFONICA BRASIL S.A.	41,605	47.05	1,957,515.25
TIM SA	82,952	12.64	1,048,513.28
CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	18,000	43.50	783,000.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	84,000	44.00	3,696,000.00
CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	90,587	10.65	964,751.55
CPFL ENERGIA SA	18,400	32.35	595,240.00
ENERGISA SA-UNITS	10,200	43.49	443,598.00

	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	91,000	23.79	2,164,890.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	33,600	40.40	1,357,440.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	475,799	11.49	5,466,930.51	
	BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT	90,000	21.63	1,946,700.00	
	ENGIE BRASIL SA	12,000	41.74	500,880.00	
小計	銘柄数：48			132,791,573.71	
	組入時価比率：4.7%			(3,534,101,663)	5.2%
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	25,900	6,753.60	174,918,240.00	
	EMPRESAS CMPC SA	71,951	1,456.00	104,760,656.00	
	CIA SUD AMERICANA VAPORES	1,226,200	86.50	106,066,300.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	50,200	2,045.80	102,699,160.00	
	CENCOSUD SA	126,000	1,235.00	155,610,000.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	3,396	29,066.00	98,708,136.00	
小計	銘柄数：6			742,762,492.00	
	組入時価比率：0.2%			(115,940,768)	0.2%
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	15,900	38,500.00	612,150,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,800	21,200.00	716,560,000.00	
小計	銘柄数：2			1,328,710,000.00	
	組入時価比率：0.1%			(45,122,991)	0.1%
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	8,000	15.20	121,600.00	
	FF GROUP	2,030	0.00	0.00	
	OPAP SA	20,200	13.96	281,992.00	
	JUMBO SA	6,732	14.32	96,402.24	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	206,500	0.89	183,785.00	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS	180,800	0.90	164,166.40	
	NATIONAL BANK OF GREECE	43,700	3.22	140,888.80	
	HELLENIC TELECOM	18,000	16.50	297,000.00	
	PUBLIC POWER CORP	20,000	5.55	111,100.00	
小計	銘柄数：9			1,396,934.44	
	組入時価比率：0.3%			(200,404,214)	0.3%
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	12,700	267.30	3,394,710.00	

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,000	28.70	3,329,200.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	41,460	24.18	1,002,502.80	
	KOC HLDGS	53,000	39.80	2,109,400.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	88,000	22.62	1,990,560.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	44,000	51.90	2,283,600.00	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	6,200	302.70	1,876,740.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	45,000	83.30	3,748,500.00	
	AKBANK T.A.S	205,000	9.13	1,871,650.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	81,000	20.12	1,629,720.00	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	203,995	4.90	999,575.50	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	117,000	18.05	2,111,850.00	
小計	銘柄数：12			26,348,008.30	
				(207,337,746)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	703.00	3,550,150.00	
	MONETA MONEY BANK AS	42,000	78.60	3,301,200.00	
	CEZ AS	12,500	1,185.00	14,812,500.00	
小計	銘柄数：3			21,663,850.00	
				(125,901,630)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
フロント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	37,500	3,030.00	113,625,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	9,200	7,210.00	66,332,000.00	
	OTP BANK NYRT	16,200	8,760.00	141,912,000.00	
小計	銘柄数：3			321,869,000.00	
				(117,061,180)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	25,900	69.42	1,797,978.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	175,000	5.85	1,023,750.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	9,900	129.50	1,282,050.00	
	LPP SA	94	9,655.00	907,570.00	
	ALLEGRO.EU SA	29,400	22.48	661,059.00	
	DINO POLSKA SA	3,820	295.20	1,127,664.00	
	BANK PEKAO SA	15,700	83.34	1,308,438.00	
	MBANK	1,100	247.20	271,920.00	
	PKO BANK POLSKI SA	63,000	28.68	1,806,840.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,100	245.20	760,120.00	

	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,500	30.26	1,528,130.00	
	ORANGE POLSKA SA	39,150	5.80	227,148.30	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	51,730	11.02	570,064.60	
	CYFROWY POLSAT SA	18,900	20.20	381,780.00	
	CD PROJEKT RED SA	4,960	91.37	453,195.20	
小計	銘柄数：15			14,107,707.10	
				(436,616,605)	
	組入時価比率：0.6%			0.6%	
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY	367,000	0.00	0.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	130,000	7.82	1,016,600.00	
	CHINA COAL ENERGY CO-H	150,000	6.44	966,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,930,900	3.53	6,816,077.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	283,000	24.85	7,032,550.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	129,000	4.12	531,480.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,700,000	3.85	6,545,000.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	138,000	23.95	3,305,100.00	
	DONGYUE GROUP LTD	108,000	10.38	1,121,040.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	107,000	32.60	3,488,200.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	309,000	8.10	2,502,900.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	176,000	5.13	902,880.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	280,000	3.12	873,600.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	160,000	9.16	1,465,600.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	240,000	4.24	1,017,600.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD	31,640	81.00	2,562,840.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	11.82	1,158,360.00	
	MMG LTD	312,000	3.13	976,560.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LTD	36,000	13.88	499,680.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H	94,000	7.06	663,640.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO-H	489,000	10.02	4,899,780.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	118,000	6.61	779,980.00	
	AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	202,000	4.19	846,380.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	92,000	11.06	1,017,520.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	3.45	601,680.00	

CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	134,000	17.04	2,283,360.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	290,000	4.96	1,438,400.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	153,250	8.11	1,242,857.50
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	55,984	13.76	770,339.84
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	55,200	33.05	1,824,360.00
CITIC LTD	473,000	7.77	3,675,210.00
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	225,940	6.87	1,552,207.80
CRRC CORP LTD-H	320,000	3.18	1,017,600.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	57,000	20.05	1,142,850.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	77,000	7.57	582,890.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	50,000	10.82	541,000.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	149,800	12.54	1,878,492.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H	116,000	4.14	480,240.00
BOC AVIATION LTD	15,000	63.30	949,500.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	281,000	4.59	1,289,790.00
AIR CHINA LIMITED-H	102,000	5.76	587,520.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	4.17	442,020.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	273,000	11.72	3,199,560.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	10,500	238.80	2,507,400.00
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	98,000	4.58	448,840.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	106,000	13.40	1,420,400.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	182,000	5.69	1,035,580.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	7.69	522,920.00
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	79,000	7.77	613,830.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	6.86	782,040.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	43,600	40.55	1,767,980.00
MINH GROUP LTD	54,000	19.04	1,028,160.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	218,000	2.74	597,320.00
BYD CO LTD-H	65,000	299.60	19,474,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	184,000	5.65	1,039,600.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	454,000	15.06	6,837,240.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	248,000	15.88	3,938,240.00

GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	285,890	7.57	2,164,187.30	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	86,000	15.20	1,307,200.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	192,000	27.25	5,232,000.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	101,600	88.55	8,996,680.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	204,000	4.24	864,960.00	
LI NING CO LTD	191,000	66.60	12,720,600.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	63,700	94.50	6,019,650.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	105,000	13.22	1,388,100.00	
HAILILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD.	111,000	15.52	1,722,720.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS	57,000	18.16	1,035,120.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	125,600	15.96	2,004,576.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	1,206,780	105.80	127,677,324.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	290,000	5.56	1,612,400.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	368,000	3.12	1,148,160.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	97,000	62.70	6,081,900.00	
JD.COM, INC.	159,417	256.80	40,938,285.60	
MEITUAN-CLASS B	325,300	201.20	65,450,360.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	36,600	22.70	830,820.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LIMITED	42,000	25.70	1,079,400.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	44,600	36.10	1,610,060.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	112,000	6.58	736,960.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	55,000	57.40	3,157,000.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	7,000	118.89	832,230.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	129,333	51.80	6,699,449.40	
NONGFU SPRING LTD	139,400	43.60	6,077,840.00	
TSING TAO BREWERY CO-H	42,000	70.75	2,971,500.00	
CHINA FEIHE LTD	292,000	8.53	2,490,760.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.00	0.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	261,000	37.10	9,683,100.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	4.00	446,000.00	
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	168,000	12.54	2,106,720.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	125,000	6.25	781,250.00	

WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	349,000	7.26	2,533,740.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	31,000	23.80	737,800.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	133,000	20.55	2,733,150.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	23,000	18.44	424,120.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	60,000	36.85	2,211,000.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	47,000	20.65	970,550.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	180,000	8.28	1,490,400.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO	25,200	49.15	1,238,580.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	86,000	6.46	555,560.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	12.94	658,646.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	96,400	19.06	1,837,384.00	
3SBIO, INC	77,000	6.51	501,270.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	104,000	30.60	3,182,400.00	
CANSINO BIOLOGICS INC	5,800	80.60	467,480.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	98,000	11.92	1,168,160.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	248,000	4.14	1,026,720.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	707,520	7.44	5,263,948.80	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	84,000	14.26	1,197,840.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	34,500	31.00	1,069,500.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	868,500	4.54	3,942,990.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,160,000	2.95	6,372,000.00	
BANK OF CHINA LTD-H	6,440,000	3.11	20,028,400.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	745,790	5.30	3,952,687.00	
CHINA CITIC BANK-H	810,000	3.85	3,118,500.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	7,644,000	5.65	43,188,600.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	257,000	2.56	657,920.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	307,192	49.55	15,221,363.60	
CHINA MINSHENG BANKING-H	589,800	2.78	1,639,644.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,480,000	4.60	20,608,000.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	681,000	5.97	4,065,570.00	
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	6.64	1,022,560.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	582,000	13.18	7,670,760.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	198,000	18.62	3,686,760.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	9.50	982,984.00	

NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	59,100	22.00	1,300,200.00	
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	587,000	2.59	1,520,330.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	550,420	8.30	4,568,486.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	511,000	52.55	26,853,050.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	35,800	25.20	902,160.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LIMITED	194,000	7.21	1,398,740.00	
GDS HOLDINGS LIMITED	52,000	29.75	1,547,000.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	66,000	13.58	896,280.00	
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	219,000	17.96	3,933,240.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS	57,000	12.38	705,660.00	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	51,500	20.55	1,058,325.00	
ZTE CORP-H	76,052	17.76	1,350,683.52	
LEGEND HLDS CORP-RTS	18,100	0.00	0.00	
LENOVO GROUP LTD	604,000	7.43	4,487,720.00	
XIAOMI CORPORATION	1,250,000	12.00	15,000,000.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	52,000	17.72	921,440.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	60,000	30.25	1,815,000.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	65,000	9.55	620,750.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	54,700	116.10	6,350,670.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	28,000	29.25	819,000.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	46,000	27.00	1,242,000.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	398,000	12.84	5,110,320.00	
CHINA TOWER CORP LTD	3,610,000	0.94	3,393,400.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	26.85	966,600.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	247,000	11.58	2,860,260.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	68,000	35.40	2,407,200.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	61,500	120.80	7,429,200.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	316,000	6.15	1,943,400.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	405,000	2.29	927,450.00	
GUANGDONG INVESTMENT	240,000	8.93	2,143,200.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	1.33	824,600.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	4.43	1,178,380.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO	102,800	15.94	1,638,632.00	



LTD-H				
CITIC SECURITIES CO LTD-H	190,050	17.50	3,325,875.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	10.18	840,868.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	268,000	5.64	1,511,520.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	102,000	11.66	1,189,320.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY	109,400	16.50	1,805,100.00	
CGN POWER CO LTD-H	980,000	1.89	1,852,200.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	284,000	15.34	4,356,560.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	490,000	4.70	2,303,000.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	150,000	14.80	2,220,000.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	410,000	3.78	1,549,800.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	98,000	27.70	2,714,600.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	8,000	86.40	691,200.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD	14,400	71.90	1,035,360.00	
WUXI APPTec CO LTD	30,500	100.00	3,050,000.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	288,000	71.10	20,476,800.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	70,000	12.64	884,800.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	410,000	2.01	824,100.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	320,000	24.00	7,680,000.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	85,000	8.53	725,050.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	256,444	34.60	8,872,962.40	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	52,200	38.55	2,012,310.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	128,000	17.90	2,291,200.00	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	80,000	9.50	760,000.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	257,712	3.57	920,031.84	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	718,380	4.70	3,376,386.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	173,000	33.00	5,709,000.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	56,000	15.10	845,600.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO.LTD.	128,000	8.44	1,080,320.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	52,800	12.72	671,616.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	154,000	34.05	5,243,700.00	
SEAZEN GROUP LTD	168,000	3.69	619,920.00	
WHARF(HOLDING)	117,000	26.15	3,059,550.00	

	YUEXIU PROPERTY CO LTD	100,000	9.03	903,000.00	
	CHINA LITERATURE LTD	28,400	36.80	1,045,120.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	870,000	0.78	678,600.00	
	BILIBILI INC	12,020	215.80	2,593,916.00	
	KINGSOFT CORP LTD	91,000	30.80	2,802,800.00	
	NETEASE, INC.	165,950	142.70	23,681,065.00	
	BAIDU INC-CLASS A	177,360	143.10	25,380,216.00	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	139,000	85.85	11,933,150.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	497,200	381.00	189,433,200.00	
小計	銘柄数：197			1,070,860,286.60	
				(18,622,260,383)	
	組入時価比率：24.5%			27.3%	
リング	DIALOG GROUP BHD	313,044	2.10	657,392.40	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	30,000	21.06	631,800.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	190,000	9.50	1,805,000.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	248,000	4.74	1,175,520.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	7.44	251,472.00	
	SIME DARBY BERHAD	220,000	2.16	475,200.00	
	MISC BHD	99,960	7.12	711,715.20	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	121,460	6.49	788,275.40	
	GENTING BHD	187,000	4.61	862,070.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	229,000	2.84	650,360.00	
	MR DIY GROUP M BHD	125,000	2.98	372,500.00	
	IOI CORP	247,000	3.93	970,710.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG	42,400	23.44	993,856.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	4,400	134.50	591,800.00	
	PPB GROUP BERHAD	51,740	15.84	819,561.60	
	QL RESOURCES BHD	60,000	5.10	306,000.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	4.42	637,806.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,000	2.94	343,980.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	428,000	1.08	462,240.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	156,000	6.49	1,012,440.00	
	AMMB HOLDING	125,000	3.85	481,250.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	508,000	4.96	2,519,680.00	
	HONG LEONG BANK	60,960	20.90	1,274,064.00	

	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	18.58	249,380.76	
	MALAYAN BANKING	379,000	8.65	3,278,350.00	
	PUBLIC BANK BHD	1,177,000	4.47	5,261,190.00	
	RHB BANK BHD	125,023	5.74	717,632.02	
	INARI AMERTRON BHD	271,000	2.65	718,150.00	
	TELEKOM MALAYSIA	62,000	5.05	313,100.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	195,000	2.78	542,100.00	
	DIGI.COM BERHAD	286,000	3.25	929,500.00	
	MAXIS BHD	146,200	3.29	480,998.00	
	TENAGA NASIONAL	182,000	8.18	1,488,760.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	63,000	16.50	1,039,500.00	
小計	銘柄数：34			33,813,353.38	
				(1,048,998,424)	
	組入時価比率：1.4%			1.5%	
パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	113,000	163.00	18,419,000.00	
	PTT PCL-NVDR	764,000	33.75	25,785,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	83,000	51.00	4,233,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	110,967	48.25	5,354,157.75	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	151,994	44.75	6,801,731.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	58,700	363.00	21,308,100.00	
	SCG PACKAGING PLC-NVDR	89,700	52.25	4,686,825.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	476,000	8.45	4,022,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	361,000	69.75	25,179,750.00	
	BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	447,100	8.95	4,001,545.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	700,000	4.90	3,430,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	270,978	34.50	9,348,741.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	155,025	34.50	5,348,362.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	579,997	13.20	7,655,960.40	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	258,000	26.25	6,772,500.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	33.00	2,432,100.00	
	CP ALL PCL-NVDR	482,000	60.00	28,920,000.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	20,900	104.50	2,184,050.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	112,000	33.50	3,752,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	279,000	26.25	7,323,750.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	199,800	17.40	3,476,520.00	

	BANGKOK DUSIT MED SERVI -NVDR	782,000	24.80	19,393,600.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,200	175.00	5,635,000.00	
	KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	15.60	4,165,980.00	
	SCB X PCL-NVDR	81,000	105.00	8,505,000.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	26,300	312.00	8,205,600.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	920,000	4.76	4,379,200.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	94,600	201.00	19,014,600.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR	140,000	68.00	9,520,000.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	51,000	74.75	3,812,250.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	68,000	57.50	3,910,000.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	43.00	2,107,000.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	63,000	48.75	3,071,250.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSET-NVDR	154,000	17.70	2,725,800.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	34,000	35.50	1,207,000.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	17,300	172.50	2,984,250.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	134,000	84.25	11,289,500.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	59,000	65.50	3,864,500.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	261,000	47.50	12,397,500.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	43,000	37.75	1,623,250.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	185,000	59.75	11,053,750.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	620,000	8.25	5,115,000.00	
小計	銘柄数：42			344,415,323.15	
				(1,325,998,994)	
	組入時価比率：1.7%			1.9%	
フィリピン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	49.20	7,183,200.00	
	AYALA CORPORATION	21,102	630.00	13,294,260.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,465	488.00	2,666,920.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	255,005	49.90	12,724,749.50	
	SM INVESTMENTS CORP	22,100	774.00	17,105,400.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	93,000	195.10	18,144,300.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	43,000	196.80	8,462,400.00	
	MONDE NISSIN CORP	330,000	13.44	4,435,200.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	67,000	97.00	6,499,000.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	145,999	92.60	13,519,507.40	
	BDO UNIBANK INC	168,998	123.00	20,786,754.00	

	METROPOLITAN BANK & TRUST	127,695	50.35	6,429,443.25	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	3.62	2,707,036.00	
	CONVERGE ICT SOLUTIONS INC	180,000	19.32	3,477,600.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,070	2,100.00	4,347,000.00	
	PLDT INC	4,970	1,790.00	8,896,300.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	371.00	6,269,900.00	
	AC ENERGY CORP	617,479	7.35	4,538,470.65	
	AYALA LAND LTD	608,000	27.65	16,811,200.00	
	SM PRIME HLDGS	919,975	36.45	33,533,088.75	
小計	銘柄数：20			211,831,729.55	
				(532,756,799)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	
ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	839,200	3,030.00	2,542,776,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	147,050	29,150.00	4,286,507,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,880,000	770.00	2,217,600,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	176,000	7,150.00	1,258,400,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	650,000	1,760.00	1,144,000,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	760,000	2,150.00	1,634,000,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,115,813	4,600.00	5,132,739,800.00	
	VALE INDONESIA TBK	198,000	7,050.00	1,395,900,000.00	
	INDAH KIAT PULP&PAPER	240,000	7,775.00	1,866,000,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,660,000	6,850.00	11,371,000,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	1,320,000	1,830.00	2,415,600,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	178,000	9,150.00	1,628,700,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	420,000	6,875.00	2,887,500,000.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	700,000	5,325.00	3,727,500,000.00	
	GUDANG GARAM TBK	29,200	31,050.00	906,660,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	523,500	5,050.00	2,643,675,000.00	
	KALBE FARMA PT	1,540,000	1,625.00	2,502,500,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	4,380,000	7,650.00	33,507,000,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	368,000	9,450.00	3,477,600,000.00	
	BANK MANDIRI	1,570,000	8,250.00	12,952,500,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	499,000	8,450.00	4,216,550,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,530,028	4,380.00	24,221,522,640.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,479,000	950.00	1,405,050,000.00	

	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,800,000	4,110.00	15,618,000,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	553,000	2,940.00	1,625,820,000.00	
小計	銘柄数：25			146,585,100,940.00	
				(1,348,582,928)	
	組入時価比率：1.8%			2.0%	
ウォン	HD HYUNDAI CO LTD	2,985	61,200.00	182,682,000.00	
	S-OIL CORPORATION	3,930	109,500.00	430,335,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,942	220,000.00	867,240,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	10,300	38,250.00	393,975,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	1,490	146,000.00	217,540,000.00	
	LG CHEM LTD - PREFERRED	630	271,000.00	170,730,000.00	
	LG CHEMICALS LTD	3,936	568,000.00	2,235,648,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,610	194,000.00	312,340,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	900	93,700.00	84,330,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,490	109,000.00	271,410,000.00	
	SKC CO LTD	1,450	161,000.00	233,450,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	2,241	124,500.00	279,004,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,399	34,000.00	251,566,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	592	520,000.00	307,840,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	6,250	250,500.00	1,565,625,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,000	53,600.00	375,200,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,220	32,850.00	138,627,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	6,900	39,350.00	271,515,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	14,400	21,350.00	307,440,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	31,900	16,650.00	531,135,000.00	
	ECOPRO BM CO LTD	855	523,000.00	447,165,000.00	
	LG ENERGY SOLUTION	1,620	413,000.00	669,060,000.00	
	CJ CORP	1,100	78,900.00	86,790,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	3,600	42,750.00	153,900,000.00	
	LG CORP	6,554	77,600.00	508,590,400.00	
	SAMSUNG C&T CORP	6,720	112,000.00	752,640,000.00	
	SK INC	3,370	227,000.00	764,990,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	3,350	30,150.00	101,002,500.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	1,410	141,500.00	199,515,000.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	3,210	91,600.00	294,036,000.00	

SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	63,000	5,930.00	373,590,000.00	
S-1 CORPORATION	1,450	61,600.00	89,320,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,810	184,000.00	333,040,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	12,600	26,050.00	328,230,000.00	
HMM COMPANY LIMITED	20,600	26,100.00	537,660,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	14,890	6,780.00	100,954,200.00	
CJ LOGISTICS	780	111,500.00	86,970,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	5,320	34,000.00	180,880,000.00	
HANON SYSTEMS	11,650	9,640.00	112,306,000.00	
HYUNDAI MOBIS	5,510	201,000.00	1,107,510,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	11,360	172,500.00	1,959,600,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,640	84,700.00	223,608,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	85,100.00	125,097,000.00	
KIA CORP	20,260	77,300.00	1,566,098,000.00	
COWAY CO LTD	4,970	63,100.00	313,607,000.00	
LG ELECTRONICS INC	8,280	91,000.00	753,480,000.00	
HLB INC	7,400	33,400.00	247,160,000.00	
F&F CO LTD / NEW	1,600	141,000.00	225,600,000.00	
KANGWON LAND INC	7,900	27,100.00	214,090,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	800	103,000.00	82,400,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,960	71,000.00	139,160,000.00	
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	177,000.00	85,845,000.00	
E-MART CO	1,181	103,500.00	122,233,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	820	372,000.00	305,040,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,800	104,000.00	187,200,000.00	
KT & G CORP	9,410	83,100.00	781,971,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,460	141,000.00	346,860,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	40,300.00	61,256,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	806	623,000.00	502,138,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	323,500.00	33,644,000.00	
SD BIOSENSOR INC	3,500	37,750.00	132,125,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	7,570	61,300.00	464,041,000.00	
ALTEOGEN INC	2,130	60,700.00	129,291,000.00	
CELLTRION INC	7,940	154,000.00	1,222,760,000.00	
GREEN CROSS CORP	410	164,500.00	67,445,000.00	

SEEGENE, INC.	2,720	37,050.00	100,776,000.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	1,950	100,500.00	195,975,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,081	74,300.00	80,318,300.00
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	499	298,000.00	148,702,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,770	70,500.00	124,785,000.00
YUHAN CORPORATION	3,991	55,400.00	221,101,400.00
HANA FINANCIAL HOLDINGS	23,700	42,200.00	1,000,140,000.00
INDUSTRIAL BK OF KOREA	26,100	10,300.00	268,830,000.00
KAKAOBANK CORP	9,500	36,100.00	342,950,000.00
KB FINANCIAL GROUP INC	30,700	50,800.00	1,559,560,000.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP	35,600	39,600.00	1,409,760,000.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	42,300	13,300.00	562,590,000.00
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,360	27,150.00	91,224,000.00
DB INSURANCE CO LTD	2,850	61,300.00	174,705,000.00
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	4,230	35,100.00	148,473,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	2,510	195,500.00	490,705,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	6,500	67,000.00	435,500,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	2,570	135,500.00	348,235,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS	379,650	58,500.00	22,209,525,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	64,800	53,300.00	3,453,840,000.00
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,150	77,000.00	165,550,000.00
L&F CO LTD	1,660	245,400.00	407,364,000.00
LG INNOTEK CO LTD	1,260	363,500.00	458,010,000.00
LG.DISPLAY CO LTD	16,200	15,450.00	250,290,000.00
SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	4,800	138,000.00	662,400,000.00
SAMSUNG SDI CO,LTD	4,474	572,000.00	2,559,128,000.00
SK HYNIX INC	42,980	95,200.00	4,091,696,000.00
SK SQUARE CO LTD	8,699	41,500.00	361,008,500.00
LG UPLUS CORP	13,300	13,350.00	177,555,000.00
SK TELECOM CO LTD	2,520	52,600.00	132,552,000.00
KOREA ELECTRIC POWER	19,600	21,800.00	427,280,000.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,140	61,500.00	193,110,000.00
MERITZ SECURITIES	24,500	4,935.00	120,907,500.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	24,737	6,750.00	166,974,750.00
NH INVESTMENT & SECURITIES CO	7,730	9,630.00	74,439,900.00



	LTD				
	SAMSUNG SECURITIES	3,565	35,350.00	126,022,750.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,559	821,000.00	1,279,939,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,900	24,200.00	142,780,000.00	
	CJ ENM CO LTD	657	101,700.00	66,816,900.00	
	HYBE CO LTD	1,220	149,500.00	182,390,000.00	
	KAKAO GAMES CORP	2,810	55,800.00	156,798,000.00	
	KRAFTON INC	1,630	268,500.00	437,655,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,296	411,500.00	533,304,000.00	
	NETMARBLE CORP	1,470	71,400.00	104,958,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	2,860	54,200.00	155,012,000.00	
	KAKAO CORP	25,240	70,500.00	1,779,420,000.00	
	NAVER CORP	10,450	239,500.00	2,502,775,000.00	
	小計 銘柄数：112			78,031,362,100.00	
				(8,232,308,701)	
	組入時価比率：10.8%			12.1%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	88,360	93.90	8,297,004.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	289,998	81.20	23,547,837.60	
	FORMOSA PLASTIC	309,424	108.50	33,572,504.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	399,726	83.70	33,457,066.20	
	ASIA CEMENT	208,980	43.05	8,996,589.00	
	TAIWAN CEMENT	395,294	39.45	15,594,348.30	
	CHINA STEEL	914,544	31.85	29,128,226.40	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	5,000	1,410.00	7,050,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	192,000	40.40	7,756,800.00	
	WALSIN LIHWA CORP-RIGHTS	13,429	7.40	99,374.60	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	234,454	31.10	7,291,519.40	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	10,464	1,000.00	10,464,000.00	
	CHINA AIRLINES LTD	219,000	24.00	5,256,000.00	
	EVA AIRWAYS CORP	202,000	31.55	6,373,100.00	
	EVERGREEN MARINE	202,375	110.00	22,261,250.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	42,900	123.50	5,298,150.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	143,000	109.50	15,658,500.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	143,000	27.70	3,961,100.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	142,036	34.95	4,964,158.20	

NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	310.50	3,105,000.00	
GIANT MANUFACTURING	18,752	248.00	4,650,496.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	14,443	475.00	6,860,425.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,815	202.50	6,645,037.50	
POU CHEN CORP	175,468	30.65	5,378,094.20	
MOMO.COM INC	3,000	783.00	2,349,000.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	23,000	587.00	13,501,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	42,816	263.00	11,260,608.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	378,836	64.70	24,510,689.20	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	359,013	17.60	6,318,628.80	
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,514,212	26.45	40,050,907.40	
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	979,063	29.50	28,882,358.50	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	877,943	26.40	23,177,695.20	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	686,374	23.05	15,820,920.70	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	858,380	35.60	30,558,328.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	759,549	16.95	12,874,355.55	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	871,051	17.10	14,894,972.10	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	743,020	27.10	20,135,842.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	291,574	53.10	15,482,579.40	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	102,571	224.50	23,027,189.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	759,152	23.50	17,840,072.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	647,035	54.20	35,069,297.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	1,269,789	15.30	19,427,771.70	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	587,775	63.20	37,147,380.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	1,030,113	9.14	9,415,232.82	
ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION	36,000	252.00	9,072,000.00	
ACER INC	256,767	26.95	6,919,870.65	
ADVANTECH CO.,LTD.	30,750	338.00	10,393,500.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	53,805	332.00	17,863,260.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	54,840	164.50	9,021,180.00	
COMPAL ELECTRONICS	354,590	22.95	8,137,840.50	
INVENTEC CO.,LTD	251,911	24.95	6,285,179.45	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	189,897	57.90	10,995,036.30	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	52,000	128.50	6,682,000.00	

PEGATRON CORP	159,692	69.10	11,034,717.20
QUANTA COMPUTER INC	224,684	80.60	18,109,530.40
WIWYNN CORP	7,000	761.00	5,327,000.00
AUO CORP	717,008	16.75	12,009,884.00
DELTA ELECTRONICS INC	149,681	232.50	34,800,832.50
E INK HOLDINGS INC	66,000	199.00	13,134,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	997,649	112.00	111,736,688.00
INNOLUX CORP	837,322	13.25	11,094,516.50
LARGAN PRECISION CO LTD	8,040	1,660.00	13,346,400.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORPORATION	16,000	314.00	5,024,000.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	122,566	54.90	6,728,873.40
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	100,000	169.50	16,950,000.00
WPG HOLDINGS CO LTD	120,387	55.40	6,669,439.80
YAGEO CORPORATION	34,377	353.00	12,135,081.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	64,410	106.00	6,827,460.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	262,658	99.40	26,108,205.20
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,230.00	2,460,000.00
EMEMORY TECHNOLOGY INC	5,000	1,270.00	6,350,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	17,000	521.00	8,857,000.00
MEDIATEK INC	119,538	868.00	103,758,984.00
NANYA TECHNOLOGY CO	100,000	60.00	6,000,000.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	43,058	346.00	14,898,068.00
PARADE TECHNOLOGIES LTD	6,000	1,300.00	7,800,000.00
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	211,000	48.45	10,222,950.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	35,417	419.00	14,839,723.00
SILERGY CORP	6,000	2,410.00	14,460,000.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,962,000	505.00	990,810,000.00
UNITED MICROELECTRONICS CORP	963,500	49.30	47,500,550.00
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	69,000	89.40	6,168,600.00
WIN SEMICONDUCTORS CORP	24,000	211.00	5,064,000.00
WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	24.30	5,880,600.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	312,065	126.50	39,476,222.50
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	144,000	82.50	11,880,000.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	128,200	108.50	13,909,700.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	113,112	74.40	8,415,532.80

小計	銘柄数：88			2,392,569,833.47	
				(10,984,288,105)	
	組入時価比率：14.5%			16.2%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	70,000	301.20	21,084,000.00	
	COAL INDIA LTD	142,000	184.80	26,241,600.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	64,380	218.40	14,060,592.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	179,000	105.75	18,929,250.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	219,000	139.10	30,462,900.00	
	PETRONET LNG LTD	77,000	206.20	15,877,400.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	242,500	2,584.10	626,644,250.00	
	ASIAN PAINTS LTD	29,800	2,678.35	79,814,830.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	19,000	585.45	11,123,550.00	
	PI INDUSTRIES LTD	7,000	2,548.00	17,836,000.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,400	2,100.60	26,047,440.00	
	SRF LTD	11,000	2,226.25	24,488,750.00	
	UPL LTD	43,200	654.20	28,261,440.00	
	ACC LIMITED	6,000	2,086.25	12,517,500.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	57,000	358.90	20,457,300.00	
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	23,300	1,334.10	31,084,530.00	
	SHREE CEMENT LIMITED	880	18,551.35	16,325,188.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	8,130	5,418.90	44,055,657.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	117,000	339.25	39,692,250.00	
	JINDAL STEEL&POWER LTD	32,000	326.90	10,460,800.00	
	JSW STEEL LTD	66,000	576.20	38,029,200.00	
	TATA STEEL LIMITED	56,200	884.80	49,725,760.00	
	VEDANTA LTD	59,000	236.05	13,926,950.00	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	84,800	230.25	19,525,200.00	
	LARSEN&TOUBRO LIMITED	53,700	1,500.30	80,566,110.00	
	HAVELLS INDIA LTD	17,700	1,105.95	19,575,315.00	
	SIEMENS LIMITED	7,000	2,346.60	16,426,200.00	
	ADANI ENTERPRISES LTD	23,600	2,161.80	51,018,480.00	
	INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,200	599.85	13,316,670.00	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	9,400	1,627.60	15,299,440.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,380	624.50	7,731,310.00		
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC	42,600	689.10	29,355,660.00		

ZONE				
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,000	2,072.20	14,505,400.00	
BHARAT FORGE LIMITED	12,700	646.85	8,214,995.00	
MRF LTD	200	68,091.55	13,618,310.00	
SAMVARDHANA INTERNATIONAL LTD	MOTHEERSON 106,000	118.75	12,587,500.00	
BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	3,645.25	20,376,947.50	
EICHER MOTORS LTD	11,600	2,702.80	31,352,480.00	
HERO MOTOCORP LTD	9,300	2,499.20	23,242,560.00	
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	73,700	997.95	73,548,915.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,620	7,780.60	74,849,372.00	
TATA MOTORS LTD	134,000	397.60	53,278,400.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	530	39,232.40	20,793,172.00	
TITAN CO LTD	26,900	2,078.10	55,900,890.00	
JUBILANT FOODWORKS LIMITED	36,000	517.85	18,642,600.00	
ZOMATO LTD	143,000	66.05	9,445,150.00	
TRENT LTD	15,000	1,050.25	15,753,750.00	
AVENUE SUPERMARTS LTD	13,690	3,519.55	48,182,639.50	
UNITED SPIRITS LTD	22,600	753.75	17,034,750.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	7,600	3,429.30	26,062,680.00	
MARICO LIMITED	46,000	484.90	22,305,400.00	
NESTLE INDIA LIMITED	2,890	16,971.80	49,048,502.00	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	45,300	727.25	32,944,425.00	
ITC LTD	221,100	269.90	59,674,890.00	
COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)	10,200	1,499.75	15,297,450.00	
DABUR INDIA LTD	45,900	505.90	23,220,810.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,200	762.00	20,726,400.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	65,100	2,205.00	143,545,500.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	8,770	3,808.20	33,397,914.00	
BIOCON LTD	31,000	325.00	10,075,000.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	534.05	9,986,735.00	
CIPLA LIMITED	34,500	938.20	32,367,900.00	
DR.REDDYS LABORATORIES	9,140	4,268.65	39,015,461.00	
LUPIN LTD	14,900	629.85	9,384,765.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	70,800	817.45	57,875,460.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,270	2,823.60	9,233,172.00	

AU SMALL FINANCE BANK LTD	12,600	611.75	7,708,050.00	
AXIS BANK LIMITED	176,200	636.50	112,151,300.00	
BANDHAN BANK LTD	56,000	282.05	15,794,800.00	
ICICI BANK LTD	404,900	696.10	281,850,890.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	43,500	1,681.50	73,145,250.00	
YES BANK LTD	839,000	12.60	10,571,400.00	
BAJAJ FINSERV LTD	3,160	11,749.90	37,129,684.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,927	1,645.30	13,042,293.10	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	76,300	564.45	43,067,535.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY	16,000	1,141.00	18,256,000.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	33,200	502.40	16,679,680.00	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	36,500	1,096.35	40,016,775.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	84,900	986.60	83,762,340.00	
INFOSYS LTD	267,400	1,449.90	387,703,260.00	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	4,000	4,118.45	16,473,800.00	
MINDTREE LIMITED	4,880	2,882.30	14,065,624.00	
MPHASIS LTD	6,200	2,285.15	14,167,930.00	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	72,247	3,211.95	232,053,751.65	
TECH MAHINDRA LTD	49,700	1,000.10	49,704,970.00	
WIPRO LTD	106,000	425.15	45,065,900.00	
TATA ELXSI LTD	2,700	7,551.60	20,389,320.00	
INDUS TOWERS LTD	61,000	208.20	12,700,200.00	
BHARTI AIRTEL LIMITED	175,000	654.30	114,502,500.00	
ADANI TRANSMISSION LTD	23,600	2,215.05	52,275,180.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	261,966	210.35	55,104,548.10	
TATA POWER COMPANY LIMITED	106,000	204.55	21,682,300.00	
ADANI TOTAL GAS LTD	23,400	2,382.90	55,759,860.00	
GAIL INDIA LTD	94,600	136.35	12,898,710.00	
INDRAPRASTHA GAS LTD	13,500	355.35	4,797,225.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	135,600	2,174.70	294,889,320.00	
BAJAJ FINANCE LTD	20,940	5,549.15	116,199,201.00	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	28,600	625.80	17,897,880.00	
MUTHOOT FINANCE LTD	10,000	1,022.50	10,225,000.00	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	13,100	720.90	9,443,790.00	

	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	15,700	1,173.95	18,431,015.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	24,900	1,809.10	45,046,590.00	
	ADANI POWER LIMITED	61,000	254.05	15,497,050.00	
	NTPC LIMITED	309,000	139.95	43,244,550.00	
	DIVIS LABORATORIES LTD	9,700	3,599.50	34,915,150.00	
	DLF LIMITED	58,000	315.10	18,275,800.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	9,300	1,209.90	11,252,070.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	6,670	3,675.00	24,512,250.00	
小計	銘柄数：108			5,097,802,558.85	
				(8,972,132,503)	
	組入時価比率：11.8%			13.2%	
カタールリヤル	QATAR FUEL CO	34,700	17.88	620,436.00	
	QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	220,000	3.80	836,220.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING	305,000	2.51	767,075.00	
	INDUSTRIES QATAR	143,000	15.61	2,232,230.00	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	184,000	6.83	1,256,720.00	
	MASRAF AL RAYAN	381,000	4.25	1,619,250.00	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	47,000	10.62	499,140.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	132,000	21.03	2,775,960.00	
	QATAR NATIONAL BANK	368,000	19.67	7,238,560.00	
	OOREDOO QSC	43,100	7.77	334,887.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	34,400	17.40	598,560.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	195,000	3.32	647,400.00	
小計	銘柄数：12			19,426,438.00	
				(724,994,666)	
	組入時価比率：1.0%			1.1%	
エジプトポンド	EASTERN TOBACCO	51,525	10.50	541,012.50	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	121,733	38.85	4,729,327.05	
	EFG-HERMES HOLDING SAE	50,000	12.45	622,500.00	
小計	銘柄数：3			5,892,839.55	
				(42,902,818)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,600	203.37	3,986,052.00	
	SASOL LTD	43,800	397.62	17,415,756.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,000	219.57	1,536,990.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,110	1,465.51	6,023,246.10	

ANGLOGOLD ASHANTI LTD	35,000	260.82	9,128,700.00	
GOLD FIELDS LTD	71,600	158.71	11,363,636.00	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	40,800	53.26	2,173,008.00	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	65,200	179.28	11,689,056.00	
KUMBA IRON ORE LTD	3,900	522.90	2,039,310.00	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	26,700	168.07	4,487,469.00	
SIBANYE STILLWATER LTD	205,000	43.58	8,933,900.00	
BIDVEST GROUP LTD	25,500	216.11	5,510,805.00	
NASPERS LTD-N SHS	16,790	1,846.25	30,998,537.50	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	94,000	57.14	5,371,160.00	
MR PRICE GROUP LTD	16,700	192.17	3,209,239.00	
PEPKOR HOLDINGS LTD	96,000	21.02	2,017,920.00	
THE FOSCHINI GROUP LTD	32,000	130.00	4,160,000.00	
BID CORP LTD	27,300	321.93	8,788,689.00	
CLICKS GROUP LTD	18,300	291.30	5,330,790.00	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	39,600	218.63	8,657,748.00	
SPAR GROUP LIMITED/THE	15,300	141.30	2,161,890.00	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	31,500	135.99	4,283,685.00	
ABSA GROUP LTD	68,400	167.77	11,475,468.00	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	7,290	2,113.50	15,407,415.00	
NEDBANK GROUP LTD	35,779	224.54	8,033,816.66	
STANDARD BANK GROUP LTD	105,800	163.35	17,282,430.00	
FIRSTRAND LTD	410,000	66.54	27,281,400.00	
REMGRO LTD	47,300	132.17	6,251,641.00	
DISCOVERY LTD	46,907	135.90	6,374,661.30	
OLD MUTUAL LTD	434,000	11.44	4,964,960.00	
SANLAM LIMITED	149,000	54.59	8,133,910.00	
MTN GROUP LTD	133,000	142.57	18,961,810.00	
VODACOM GROUP	51,700	136.81	7,073,077.00	
REINET INVESTMENTS SCA	8,790	274.14	2,409,690.60	
NEPI ROCKCASTLE S.A.	41,900	90.60	3,796,140.00	
MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	117.13	3,122,685.80	
小計 銘柄数：36			299,836,691.96	
			(2,569,600,450)	
組入時価比率：3.4%				3.8%



UAEディールハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	179,000	4.09	732,110.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	237,870	9.34	2,221,705.80	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	128,000	7.90	1,011,200.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	214,029	5.77	1,234,947.33	
	EMIRATES NBD PJSC	165,000	13.55	2,235,750.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	357,125	19.04	6,799,660.00	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	274,900	27.92	7,675,208.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	277,000	4.67	1,293,590.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	349,000	5.28	1,842,720.00	
	小計	銘柄数：9			25,046,891.13
	組入時価比率：1.2%				1.4%
クウェートディナール	AGILITY	112,000	1.01	114,016.00	
	BOUBYAN BANK K.S.C	83,951	0.75	62,963.25	
	GULF BANK	128,000	0.30	39,424.00	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	421,300	0.81	342,516.90	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	555,450	1.03	572,668.95	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	189,000	0.60	113,589.00	
	MABANEE CO SAKC	40,449	0.74	30,013.15	
	小計	銘柄数：7			1,275,191.25
	組入時価比率：0.7%				0.8%
サウジアラビアリヤル	RABIGH REFINING & PETRO-RTS	8,712	7.25	63,162.00	
	RABIGH REFINING AND PETROCHE	14,239	17.24	245,480.36	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	196,400	37.50	7,365,000.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	10,833	52.50	568,732.50	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	28,000	16.56	463,680.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	16,600	141.00	2,340,600.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	29,300	50.80	1,488,440.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	75,200	104.60	7,865,920.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	29,368	27.15	797,341.20	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	67,000	15.64	1,047,880.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	19,900	50.60	1,006,940.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	70,200	55.00	3,861,000.00	

JARIR MARKETING CO	3,730	159.80	596,054.00	
ALMARAI CO	18,000	52.70	948,600.00	
SAVOLA	16,600	34.90	579,340.00	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	7,800	200.00	1,560,000.00	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,400	219.00	744,600.00	
AL RAJHI BANK	162,000	85.90	13,915,800.00	
ALINMA BANK	81,000	34.00	2,754,000.00	
ARAB NATIONAL BANK	47,800	30.05	1,436,390.00	
BANK AL - JAZIRA	34,100	24.26	827,266.00	
BANK ALBILAD	42,666	46.30	1,975,435.80	
BANQUE SAUDI FRANSI	49,200	47.45	2,334,540.00	
RIYAD BANK	111,800	32.60	3,644,680.00	
SAUDI BRITISH BANK	73,600	39.20	2,885,120.00	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	39,000	19.90	776,100.00	
THE SAUDI NATIONAL BANK	181,800	65.50	11,907,900.00	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	3,900	161.00	627,900.00	
ELM CO	1,900	261.00	495,900.00	
SAUDI TELECOM CO	48,100	99.50	4,785,950.00	
ETIHAD ETISALAT CO	34,300	37.10	1,272,530.00	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS COMPANY	29,000	11.20	324,800.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	58,200	23.32	1,357,224.00	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	2,900	181.00	524,900.00	
ACWA POWER CO	6,400	149.20	954,880.00	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	53,000	14.20	752,600.00	
EMAAR ECONOMIC CITY	35,000	10.48	366,800.00	
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	2,800	202.00	565,600.00	
小計 銘柄数：38			86,029,085.86	
			(3,134,899,888)	
組入時価比率：4.1%			4.6%	
合計			68,010,971,150	
			(68,010,971,150)	

(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6月22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	4,550,000	24,808,875.00		
	小計	銘柄数：1	4,550,000	24,808,875.00		
		組入時価比率：4.5%			(3,386,163,348)	97.6%
	合計			3,386,163,348	(3,386,163,348)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	234,000	4,361,760.00		
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	111,000	2,631,810.00		
	小計	銘柄数：2	345,000	6,993,570.00		
		組入時価比率：0.1%			(47,309,402)	1.4%
	ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	300,000	3,864,000.00		
		小計	銘柄数：1	300,000	3,864,000.00	
		組入時価比率：0.0%			(33,114,480)	1.0%
	合計			80,423,882	(80,423,882)	
合計				3,466,587,230	(3,466,587,230)	

(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 6月22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	4,335,619,181	-	4,387,899,628	52,280,447
市場取引以外の取引				

為替予約取引					
買建	718,976,367	-	723,396,000	4,419,633	
米ドル	297,352,630	-	300,246,000	2,893,370	
新台幣ドル	229,433,517	-	229,550,000	116,483	
インドルピー	192,190,220	-	193,600,000	1,409,780	
売建	421,623,737	-	421,599,025	24,712	
米ドル	421,623,737	-	421,599,025	24,712	
合計	-	-	-	56,724,792	

## (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。

## J - R E I T インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2022年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,067,685,698
投資証券	40,902,790,100
未収配当金	182,407,215
差入委託証拠金	136,704,600
流動資産合計	42,289,587,613
資産合計	42,289,587,613
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	72,316,080
未払金	40,225,800

(2022年 6月22日現在)

未払解約金	16,484,486
未払利息	783
流動負債合計	129,027,149
負債合計	129,027,149
純資産の部	
元本等	
元本	16,334,598,433
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,825,962,031
元本等合計	42,160,560,464
純資産合計	42,160,560,464
負債純資産合計	42,289,587,613

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</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>取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。</p>
2. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</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>
3. 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 6月22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	2.5811円
(10,000口当たり純資産額)	(25,811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 6月23日 至 2022年 6月22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、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、REITの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。</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。</p> <p style="padding-left: 2em;">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。</p> <p style="padding-left: 2em;">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。</p> <p style="padding-left: 2em;">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>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 6月22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 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。</p>

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 6月22日現在	
期首	2021年 6月23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	16,978,856,832円
同期中における追加設定元本額	4,235,545,718円
同期中における一部解約元本額	4,879,804,117円

期末元本額	16,334,598,433円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,693,856,837円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,188,420,462円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	920,889,582円
野村資産設計ファンド2015	13,561,033円
野村資産設計ファンド2020	14,378,126円
野村資産設計ファンド2025	18,125,978円
野村資産設計ファンド2030	20,064,749円
野村資産設計ファンド2035	20,549,034円
野村資産設計ファンド2040	37,517,074円
野村資産設計ファンド2045	4,750,666円
野村インデックスファンド・J-REIT	3,172,948,286円
ネクストコア	3,840,933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	1,147,588,730円
野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）	1,630,957,567円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	650,813,298円
野村資産設計ファンド2050	4,784,369円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,241,009円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	856,970円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	6,380,621円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,493,829円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,891,011円
野村6資産均等バランス	2,297,777,611円
野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	89,169,797円
野村資産設計ファンド2060	3,157,382円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	356,971,108円
ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT（適格機関投資家専用）	86,791,056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）	13,554,486円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,690,577,326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）	26,237,585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）	454,316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）	11,379,921円
野村DC運用戦略ファンド	118,075,090円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	9,100,585円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	9,724,312円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	4,484,108円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	10,553,418円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	6,271,546円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	6,682,953円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	2,626,187円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,599,480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）	31,500,002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6月22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6月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	783	88,322,400	
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,231	118,668,400	
		S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	1,808	248,961,600	
		東海道リート投資法人 投資証券	298	34,568,000	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	1,342	864,248,000	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,570	674,989,000	
		産業ファンド投資法人 投資証券	5,517	945,613,800	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,886	1,342,613,000	
		ケネディクス・レジデンシャル・ネ クスト投資法人 投資証券	2,781	566,211,600	
		アクティブ・プロパティーズ投資 法人 投資証券	2,071	830,471,000	
		G L P 投資法人 投資証券	12,587	2,005,109,100	
		コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	1,808	576,752,000	
		日本プロロジスリート投資法人 投 資証券	6,359	2,015,803,000	
		星野リゾート・リート投資法人 投 資証券	661	417,091,000	
		O n e リート投資法人 投資証券	674	175,307,400	
イオンリート投資法人 投資証券	4,571	677,422,200			
ヒューリックリート投資法人 投資 証券	3,626	562,392,600			



日本リート投資法人 投資証券	1,199	435,237,000	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,797	897,751,700	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	812	105,478,800	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,552	413,142,400	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	952	146,036,800	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	880	112,288,000	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,568	2,083,774,400	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	644	58,668,400	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,758	766,513,800	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	4,016	238,952,000	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	455	61,698,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,531	746,362,500	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	627	42,510,600	
投資法人みらい 投資証券	4,708	227,161,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	912	111,628,800	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,129	492,808,500	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,505	279,629,000	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	627	78,375,000	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,533	171,849,300	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,515	216,493,500	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,531	3,040,301,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3,886	2,319,942,000	

日本都市ファンド投資法人 投資証券	19,609	1,962,860,900	
オリックス不動産投資法人 投資証券	7,744	1,414,828,800	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,656	1,049,120,000	
N T T都市開発リート投資法人	3,725	534,537,500	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,606	487,843,200	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,663	274,821,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,749	1,234,483,900	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,778	382,252,800	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	17,106	672,265,800	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,362	709,602,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	2,649	366,621,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,620	779,450,000	
福岡リート投資法人 投資証券	2,010	324,012,000	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,202	796,926,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	3,185	261,807,000	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	822	547,452,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,755	251,842,500	
スターツプロシード投資法人 投資証券	605	139,513,000	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,835	1,732,411,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	11,906	763,174,600	
大和証券リビング投資法人 投資証券	5,251	592,312,800	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,565	433,504,000	
小計	銘柄数：61	227,113	40,902,790,100

	組入時価比率：97.0%		100.0%
合計			40,902,790,100

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年 6月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	1,325,410,600	-	1,253,168,000	72,316,080
合計	1,325,410,600	-	1,253,168,000	72,316,080

(注) 時価の算定方法

### 1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 海外REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(2022年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	492,377,547
コール・ローン	314,950,591
投資証券	53,218,626,160
派生商品評価勘定	8,945,111
未収入金	45,253,966
未収配当金	144,843,813
差入委託証拠金	116,586,299
流動資産合計	54,341,583,487
資産合計	54,341,583,487
負債の部	
流動負債	
未払金	599,040,038
未払解約金	1,655,164
未払利息	231
その他未払費用	198,000
流動負債合計	600,893,433
負債合計	600,893,433

(2022年 6月22日現在)

純資産の部	
元本等	
元本	17,104,124,713
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	36,636,565,341
元本等合計	53,740,690,054
純資産合計	53,740,690,054
負債純資産合計	54,341,583,487

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 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	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 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。 為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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 6月22日現在

1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額

1口当たり純資産額	3,1420円
(10,000口当たり純資産額)	(31,420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 6月23日

至 2022年 6月22日

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 6月22日現在

1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2.時価の算定方法

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 6月22日現在	
期首	2021年 6月23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	14,458,368,180円
同期中における追加設定元本額	6,007,672,723円
同期中における一部解約元本額	3,361,916,190円
期末元本額	17,104,124,713円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,394,351,518円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	1,801,467,112円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	758,058,966円
野村資産設計ファンド2015	11,165,820円
野村資産設計ファンド2020	11,835,809円
野村資産設計ファンド2025	14,920,977円
野村資産設計ファンド2030	16,516,989円
野村資産設計ファンド2035	16,915,628円
野村資産設計ファンド2040	30,883,460円
野村資産設計ファンド2045	3,910,743円
野村インデックスファンド・外国REIT	1,623,228,438円
ネクストコア	2,032,656円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	462,836,238円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	714,645,176円
野村資産設計ファンド2050	3,938,499円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,301,862円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,294,303円
インデックス・ブレンド(タイプ )	8,923,273円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,715,984円
インデックス・ブレンド(タイプ )	10,259,824円
野村6資産均等バランス	1,891,487,316円
野村資産設計ファンド2060	2,599,098円
NEXT FUNDS 外国REIT・S&P先進国REIT指数(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信	4,650,516,398円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	2,728,578,381円
ノムラ海外REITインデックス・ファンドVA(適格機関投資家専用)	761,323,090円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国REIT(適格機関投資家専用)	58,677,789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)	374,003円
野村DC運用戦略ファンド	63,171,328円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	4,380,630円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	8,005,064円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	3,691,733円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	8,687,375円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	5,162,619円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	5,501,279円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	2,161,828円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	1,316,662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)	17,286,845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6月22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6月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	27,800	437,572.00	
		AGREE REALTY CORP	22,000	1,526,800.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	21,300	382,548.00	
		ALEXANDERS INC	620	134,899.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	43,790	5,763,639.80	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,700	47,439.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	15,400	449,834.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	41,200	2,641,332.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	87,300	2,901,852.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	78,800	2,226,888.00	
		APARTMENT INCOME REIT CO	45,900	1,854,360.00	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	43,000	252,410.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	62,300	924,532.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	20,000	256,200.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	9,200	52,716.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	41,200	7,885,680.00	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	7,900	205,321.00	
		BOSTON PROPERTIES	42,100	3,789,000.00	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	16,000	75,680.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	50,000	476,500.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	88,700	1,745,616.00	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	49,500	1,012,770.00	
		BRT APARTMENTS CORP	3,500	77,455.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	31,430	4,097,529.10	

CARETRUST REIT INC	28,400	496,432.00	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,200	186,912.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	3,200	85,760.00	
CENTERSPACE	4,500	349,875.00	
CHATHAM LODGING TRUST	14,700	150,822.00	
CITY OFFICE REIT INC	12,400	146,692.00	
CLIPPER REALTY INC	4,000	30,320.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	6,600	221,760.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	32,800	869,200.00	
COUSINS PROPERTIES INC	43,300	1,266,092.00	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP	5,200	38,584.00	
CTO REALTY GROWTH INC	1,600	95,616.00	
CUBESMART	66,300	2,685,150.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	62,000	518,940.00	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	100,000	89,500.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	83,850	10,744,539.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	68,000	127,840.00	
DOUGLAS EMMETT INC	51,200	1,136,640.00	
DUKE REALTY CORP	113,300	5,958,447.00	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	100,000	0.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	26,600	492,898.00	
EASTGROUP PROPERTIES	12,200	1,846,836.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	42,000	289,800.00	
EPR PROPERTIES	21,800	988,194.00	
EQUINIX INC	26,800	17,156,824.00	
EQUITY COMMONWEALTH	33,600	932,400.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	51,100	3,554,516.00	
EQUITY RESIDENTIAL	100,800	7,183,008.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	38,400	803,712.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,270	4,922,906.90	
EXTRA SPACE STORAGE INC	39,580	6,404,835.60	
FARMLAND PARTNERS INC	9,200	134,136.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	21,200	2,008,912.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	38,600	1,792,584.00	



FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	23,500	606,770.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	25,000	104,500.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	69,500	3,147,655.00	
GETTY REALTY CORP	11,700	302,211.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,300	206,112.00	
GLADSTONE LAND CORP	8,700	199,404.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	17,200	189,544.00	
GLOBAL NET LEASE INC	29,700	399,465.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	44,400	1,173,936.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	67,800	1,878,060.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	159,200	3,960,896.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9,600	90,432.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	31,300	1,056,062.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	211,000	3,475,170.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	44,600	706,018.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	64,600	1,326,884.00	
INDUS REALTY TRUST INC	1,800	107,730.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	19,700	262,601.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	8,140	883,759.80	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	19,600	520,772.00	
INVITATION HOMES INC	179,900	6,121,997.00	
IRON MOUNTAIN INC	85,700	4,044,183.00	
JBG SMITH PROPERTIES	33,000	794,640.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	210,000	142,800.00	
KILROY REALTY CORP	30,700	1,571,533.00	
KIMCO REALTY CORP	182,400	3,469,248.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	65,100	1,139,250.00	
LIFE STORAGE INC	24,700	2,623,140.00	
LTC PROPERTIES INC	11,900	449,701.00	
LXP INDUSTRIAL TRUST	84,000	874,440.00	
MACERICH CO /THE	62,000	554,280.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	539,515	310,221.12	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	175,600	2,574,296.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	34,030	5,570,030.40	

NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	52,000	2,150,200.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	24,600	1,145,130.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	13,500	793,800.00	
NETSTREIT CORP	14,000	262,360.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	6,800	396,168.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	14,300	274,846.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	69,800	1,920,198.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,800	121,728.00	
ORION OFFICE REIT INC	15,500	182,125.00	
PARAMOUNT GROUP INC	47,000	345,450.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	68,700	978,288.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	37,900	663,629.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	1,000	3,900.00	
PHILLIPS EDISON & CO INC	33,900	1,113,615.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	65,900	1,107,120.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	35,400	460,554.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	11,700	209,430.00	
POSTAL REALTY TRUST INC-A	5,500	78,925.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	14,900	372,202.00	
PRIME US REIT	170,000	113,900.00	
PROLOGIS INC	217,900	24,483,244.00	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	6,000	1,116,000.00	
PUBLIC STORAGE	44,970	13,584,987.30	
REALTY INCOME CORP	177,200	11,601,284.00	
REGENCY CENTERS CORP	45,400	2,649,998.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	36,300	565,554.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	48,300	2,757,447.00	
RLJ LODGING TRUST	49,600	546,592.00	
RPT REALTY	23,700	225,861.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	16,400	1,249,844.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	67,600	934,908.00	
SAFEHOLD INC	4,500	153,270.00	
SAUL CENTERS INC	3,900	169,767.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	46,000	232,760.00	

	SIMON PROPERTY GROUP INC	96,700	9,340,253.00	
	SITE CENTERS CORP	52,500	679,350.00	
	SL GREEN REALTY CORP	18,900	912,303.00	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	39,300	1,467,855.00	
	STAG INDUSTRIAL INC	52,400	1,601,344.00	
	STORE CAPITAL CORP	73,900	1,905,881.00	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	30,000	213,600.00	
	SUN COMMUNITIES INC	35,860	5,545,749.00	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	63,000	630,000.00	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	30,900	434,763.00	
	TERRENO REALTY CORP	22,000	1,230,020.00	
	THE NECESSITY RETAIL REIT WHERE AMERICA	38,000	265,240.00	
	UDR INC	88,300	3,894,030.00	
	UMH PROPERTIES INC	14,800	248,196.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,700	187,331.00	
	URBAN EDGE PROPERTIES	32,100	480,216.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	8,400	134,400.00	
	VENTAS INC	117,800	5,719,190.00	
	VERIS RESIDENTIAL INC	23,500	324,535.00	
	VICI PROPERTIES INC	283,700	8,471,282.00	
	VORNADO REALTY TRUST	47,200	1,334,344.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	25,600	548,608.00	
	WELLTOWER INC	133,700	10,519,516.00	
	WHITESTONE REIT	13,000	139,490.00	
	WP CAREY INC	56,900	4,776,186.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	33,500	479,385.00	
小計	銘柄数：152	7,668,855	298,215,149.62 (40,703,385,771)	
	組入時価比率：75.7%		76.4%	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	18,300	630,069.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	18,000	219,420.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST	6,000	78,480.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	6,800	289,476.00	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	15,000	54,600.00	

	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	25,100	1,109,671.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	47,000	646,250.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	15,400	245,630.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	233,600.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	36,000	440,640.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,700	131,655.00	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,000	42,570.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	30,800	458,304.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,400	746,266.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	42,000	522,480.00	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	4,000	30,240.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	20,800	253,760.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	15,900	271,890.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,000	72,400.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	5,800	95,526.00	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	8,000	81,600.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	33,000	403,260.00	
	PLAZA RETAIL REIT	12,000	51,360.00	
	PRIMARIS REIT	15,925	201,929.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	45,400	926,160.00	
	SLATE GROCERY REIT	8,000	113,360.00	
	SLATE OFFICE REIT	12,000	56,400.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	21,100	576,663.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	28,100	468,708.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	14,000	88,480.00	
小計	銘柄数：30	551,125	9,540,847.00	
			(1,005,700,682)	
	組入時価比率：1.9%		1.9%	
ユ-口	AEDIFICA	10,700	1,013,825.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,000	48,560.00	
	ALTAREA	1,220	157,380.00	
	BEFIMMO S.C.A.	7,200	339,840.00	
	CARE PROPERTY INVEST	8,000	193,200.00	
	CARMILA	13,000	193,180.00	

	COFINIMMO	8,570	971,838.00	
	COIMA RES SPA	6,000	59,340.00	
	COVIVIO	13,800	788,670.00	
	CROMWELL REIT EUR	94,000	184,240.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	11,754	258,117.84	
	GECINA SA	16,100	1,569,750.00	
	HAMBORNER REIT AG	20,000	170,000.00	
	ICADE	9,400	458,156.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	18,000	63,990.00	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	81,000	520,425.00	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	6,800	174,760.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	120,000	151,680.00	
	KLEPIERRE	57,500	1,188,525.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	16,000	79,280.00	
	MERCIALYS	16,000	134,720.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	97,000	943,810.00	
	MONTEA	3,100	286,750.00	
	NSI NV	5,400	184,950.00	
	RETAIL ESTATES	3,300	213,180.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	34,200	1,856,376.00	
	VASTNED RETAIL NV	5,200	116,220.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	41,300	1,305,906.00	
	WERELDHAVE NV	11,400	166,554.00	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	6,200	256,060.00	
小計	銘柄数：30	746,144	14,049,282.84	
			(2,015,510,116)	
	組入時価比率：3.8%		3.8%	
英ボンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED	110,000	86,020.00	
	AEW UK REIT PLC	48,000	56,832.00	
	ASSURA PLC	860,000	573,620.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	51,600	650,676.00	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	230,000	264,040.00	
	BRITISH LAND	278,000	1,401,120.00	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	248,000	372,992.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	190,000	152,190.00	

	CUSTODIAN REIT PLC	139,000	144,282.00	
	DERWENT LONDON PLC	33,100	905,616.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	172,000	146,200.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	75,000	462,000.00	
	HAMMERSON PLC	1,040,000	221,104.00	
	HOME REIT PLC	170,000	192,440.00	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	105,750	129,649.50	
	INTU PROPERTIES PLC	184,000	0.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	221,000	1,589,432.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	291,000	675,702.00	
	LXI REIT PLC	273,000	375,102.00	
	NEWRIVER REIT PLC	100,000	91,400.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	170,000	159,630.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	390,000	542,490.00	
	PRS REIT PLC/THE	170,000	183,600.00	
	REGIONAL REIT LTD	120,000	92,400.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	62,900	661,079.00	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	160,000	86,080.00	
	SEGRO PLC	352,900	3,476,065.00	
	SHAFTESBURY PLC	85,000	475,575.00	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	360,000	464,400.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	120,000	104,640.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	547,000	1,029,454.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	240,000	188,640.00	
	UNITE GROUP PLC	116,800	1,257,936.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	40,000	250,200.00	
小計	銘柄数：34	7,754,050	17,462,606.50	
			(2,918,350,798)	
	組入時価比率：5.4%		5.5%	
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	117,000	313,560.00	
	ARENA REIT	106,000	431,420.00	
	BWP TRUST	145,000	564,050.00	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	190,000	366,700.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	153,000	442,170.00	
	CENTURIA OFFICE REIT	139,000	244,640.00	

	CHARTER HALL GROUP	139,000	1,551,240.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	182,000	788,060.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	152,000	589,760.00	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	93,000	300,390.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	410,000	293,150.00	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	60,000	162,000.00	
	DEXUS/AU	317,000	2,900,550.00	
	GDI PROPERTY GROUP	160,000	152,000.00	
	GOODMAN GROUP	501,100	8,784,283.00	
	GPT GROUP	560,000	2,352,000.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	89,000	305,270.00	
	HEALTHCO REIT	73,000	108,040.00	
	HOME CONSORTIUM LTD	57,000	256,500.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	430,000	567,600.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	56,000	176,400.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	105,000	405,300.00	
	IRONGATE GROUP	164,000	309,140.00	
	MIRVAC GROUP	1,153,000	2,352,120.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	318,000	715,500.00	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	100,000	82,000.00	
	RURAL FUNDS GROUP	116,000	307,400.00	
	SCENTRE GROUP	1,534,000	4,019,080.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	327,000	895,980.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	698,000	2,547,700.00	
	VICINITY CENTRES	1,147,000	2,156,360.00	
	WAYPOINT REIT	214,000	483,640.00	
小計	銘柄数：32	10,005,100	35,924,003.00	
			(3,402,362,324)	
	組入時価比率：6.3%		6.4%	
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	240,000	284,400.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	310,000	613,800.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	480,000	468,000.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	390,000	522,600.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	136,000	365,840.00	
小計	銘柄数：5	1,556,000	2,254,640.00	

			(193,808,854)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
香港ドル	CHAMPION REIT	550,000	1,930,500.00	
	FORTUNE REIT	430,000	2,777,800.00	
	LINK REIT	619,000	39,925,500.00	
	PROSPERITY REIT	360,000	860,400.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	290,000	1,044,000.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	689,800	2,090,094.00	
小計	銘柄数：6	2,938,800	48,628,294.00	
			(845,646,032)	
	組入時価比率：1.6%		1.6%	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	130,000	175,500.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	993,762	2,732,845.50	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	569,956	649,749.84	
	CAPITALAND CHINA TRUST	320,279	368,320.85	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,507,694	3,226,465.16	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	260,000	335,400.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	100,000	69,500.00	
	EC WORLD REIT	60,000	33,600.00	
	ESR-LOGOS REIT	1,529,692	627,173.72	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	330,000	207,900.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	356,400	99,792.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	319,838	713,238.74	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	849,746	1,147,157.10	
	IREIT GLOBAL	141,212	87,551.44	
	KEPPEL DC REIT	385,211	743,457.23	
	KEPPEL REIT	590,000	666,700.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	520,000	408,200.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	645,716	1,155,831.64	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	577,900	1,450,529.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	929,980	1,525,167.20	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	630,000	756,000.00	
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	690,216	265,733.16		
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	116,000	557,960.00		



小計	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	140,000	105,700.00	
	SPH REIT	290,000	272,600.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	420,000	243,600.00	
	SUNTEC REIT	640,000	1,030,400.00	
	銘柄数：27	14,043,602	19,656,072.58	(1,933,960,981)
	組入時価比率：3.6%		3.6%	
ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,000	79,600,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	42,000	235,200,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	10,000	54,500,000.00	
	JR GLOBAL REIT RTS	6,524	0.00	
	JR REIT XXVII	34,000	179,860,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	11,445	68,441,100.00	
	LOTTE REIT CO LTD	34,000	192,440,000.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	30,000	135,000,000.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	8,000	41,040,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	18,000	139,860,000.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	8,000	41,360,000.00	
	SK REITS CO LTD	18,000	111,780,000.00	
	銘柄数：12	235,969	1,279,081,100.00	(134,943,056)
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
新シェケル	REIT 1 LTD	56,000	1,027,040.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	64,000	617,280.00	
小計	銘柄数：2	120,000	1,644,320.00	(64,957,546)
	組入時価比率：0.1%		0.1%	
合計			53,218,626,160	(53,218,626,160)

(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 6月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	437,292,121	-	443,150,272	5,858,151
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	294,804,557	-	297,891,517	3,086,960
米ドル	249,773,017	-	252,491,700	2,718,683
カナダドル	3,130,260	-	3,162,120	31,860
英ポンド	16,566,800	-	16,711,300	144,500
豪ドル	12,221,820	-	12,311,741	89,921
ニュージーランドドル	2,565,300	-	2,578,611	13,311
シンガポールドル	7,797,200	-	7,870,744	73,544
新シェケル	2,750,160	-	2,765,301	15,141
合計	-	-	-	8,945,111

## (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。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

2022年7月29日現在

資産総額	258,483,628円
負債総額	247,405円
純資産総額（ - ）	258,236,223円
発行済口数	196,833,377口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3120円

## （参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

2022年7月29日現在

資産総額	884,216,447,699円
負債総額	11,561,521,468円
純資産総額（ - ）	872,654,926,231円
発行済口数	671,177,507,429口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3002円

## （参考）外国債券マザーファンド

2022年7月29日現在

資産総額	680,412,453,909円
負債総額	1,075,516,715円
純資産総額（ - ）	679,336,937,194円
発行済口数	257,205,687,251口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6412円

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2022年7月29日現在

資産総額	6,910,440,570円
負債総額	10,711,277円
純資産総額（ - ）	6,899,729,293円
発行済口数	4,943,994,858口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3956円

## （参考）国内株式マザーファンド

2022年7月29日現在

資産総額	470,484,291,871円
負債総額	20,405,193,784円
純資産総額（ - ）	450,079,098,087円
発行済口数	216,317,808,579口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0806円

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2022年7月29日現在

資産総額	1,352,796,809,678円
負債総額	4,252,548,930円
純資産総額（ - ）	1,348,544,260,748円
発行済口数	292,981,248,205口
1口当たり純資産額（ / ）	4.6028円

## （参考）新興国株式マザーファンド

2022年7月29日現在

資産総額	76,164,765,101円
負債総額	359,222,661円
純資産総額（ - ）	75,805,542,440円
発行済口数	48,242,652,460口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5713円

## （参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2022年7月29日現在

資産総額	48,237,750,335円
負債総額	1,660,712,071円
純資産総額（ - ）	46,577,038,264円
発行済口数	16,852,829,075口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7638円

## （参考）海外REITインデックス マザーファンド

2022年7月29日現在

資産総額	59,107,237,332円
負債総額	37,128,017円
純資産総額（ - ）	59,070,109,315円
発行済口数	17,354,025,992口
1口当たり純資産額（ / ）	3.4038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、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。



### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額

2022年8月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

###### (2)会社の機構

###### (a)会社の意思決定機構

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

###### 株主総会

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

###### 取締役会

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

###### 代表取締役・業務執行取締役

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

###### 監査等委員会

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

## (b)投資信託の運用体制



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2022年7月29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	1,014	39,047,860
単位型株式投資信託	195	741,370
追加型公社債投資信託	14	6,377,672
単位型公社債投資信託	501	1,364,812
合計	1,724	47,531,713

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2021年4月1日から2022年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		4,281	2,006
金銭の信託		35,912	35,894
有価証券		30,400	29,300
前払金		-	11
前払費用		167	454
未収入金		632	694
未収委託者報酬		24,499	27,176
未収運用受託報酬		4,347	4,002
短期貸付金		-	1,835
その他		268	57
貸倒引当金		14	15
流動資産計		100,496	101,417
固定資産			
有形固定資産			
建物	2	1,935	1,219
器具備品	2	731	525
無形固定資産			
ソフトウェア		5,428	5,209
その他		0	0

投資その他の資産			16,487		16,067
投資有価証券		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

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

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金	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		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596
当期変動額									
剰余金の配当							26,268	26,268	26,268
当期純利益							24,904	24,904	24,904
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,364	1,364	1,364
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,030	55,322	86,232

(単位：百万円)

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

## [重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、 売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>						
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法						
3．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法						
4．外貨建の資産又は負債の本邦通貨 への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。						
5．固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table style="margin-left: 40px;"> <tr> <td>建物</td> <td>6年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>6～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によるっております。</p>	建物	6年	附属設備	6～15年	器具備品	4～15年
建物	6年						
附属設備	6～15年						
器具備品	4～15年						
6．引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p>						

## (3) 退職給付引当金

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

## 退職給付見込額の期間帰属方法

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

## 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

## (4) 時効後支払損引当金

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

## 7. 収益及び費用の計上基準

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

## 委託者報酬

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

## 運用受託報酬

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

## 成功報酬

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

## 8. 消費税等の会計処理方法

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

## 9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

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

## [ 会計上の見積りに関する注記 ]

該当事項はありません。

## [ 会計方針の変更 ]

## （収益認識に関する会計基準等の適用）

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

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

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

これによる財務諸表に与える影響は軽微であります。

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

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

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

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

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	26,268百万円
配当の原資	利益剰余金

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

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

2022年5月18日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

## 金融商品関係

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自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

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### (1) 現金・預金

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

### (2) 金銭の信託

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

### (3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

ます。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、

親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

## （２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

## ２．金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

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

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

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

( ) 1 市場価格のない株式等には非上場株式等が含まれております。

2 非上場株式等について、当事業年度において727百万円減損処理を行っております。

## (注)3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

## 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

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

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

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

## (注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

金銭の信託

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

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

デリバティブ取引

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

## 有価証券関係

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(2021年3月31日)

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

区分	前事業年度 (百万円)
子会社株式	9,835
関連会社株式	106

## 4．その他有価証券(2021年3月31日)

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

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

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

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2022年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(2022年3月31日)

該当事項はありません。



## 3．子会社株式及び関連会社株式(2022年3月31日)

## 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額

区分	当事業年度 (百万円)
子会社株式	9,107
関連会社株式	106

## 4．その他有価証券(2022年3月31日)

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

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

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

該当事項はありません。

## デリバティブ取引関係

## 1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

## 前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

## 当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

## 退職給付関係

前事業年度(自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,761 百万円
勤務費用	1,016
利息費用	139
数理計算上の差異の発生額	893
退職給付の支払額	781
その他	28
退職給付債務の期末残高	23,270

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	52%
株式	30%
生保一般勘定	11%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企業年金制度の割引率	0.8%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%
3. 確定拠出制度	
当社の確定拠出制度への要拠出額は、206百万円でした。	

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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



2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率 (調整)	法定実効税率 (調整)
31.0%	31.0%
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
0.0%	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	受取配当金等永久に益金に算入されない項目
3.5%	2.9%
タックスヘイブン税制	タックスヘイブン税制
1.9%	1.8%
外国税額控除	外国税額控除
0.5%	0.5%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税
0.2%	0.4%
その他	その他
0.3%	0.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	税効果会計適用後の法人税等の負担率
29.4%	29.9%

### 資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

#### 1. 当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

#### 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

#### 3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：百万円)

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

### 収益認識に関する注記

#### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当事業年度（自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）

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

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

## 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

[重要な会計方針] 7. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## セグメント情報等

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

### 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### 2. 関連情報

#### (1) 製品・サービスごとの情報

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

#### (2) 地域ごとの情報

##### 売上高

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

##### 有形固定資産

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

#### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

### 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### 2. 関連情報

#### (1) 製品・サービスごとの情報

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

#### (2) 地域ごとの情報

##### 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域

ごとの営業収益の記載を省略しております。

#### 有形固定資産

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

### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 関連当事者情報

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

### 1. 関連当事者との取引

#### (ア) 親会社及び法人主要株主等

(イ) 子会社等  
該当はありません。

#### (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1)	26,722	未払手数料	5,690
							コマーシャル・ペーパーの償還(*2)	20,000	有価証券	-
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

#### (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

### 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

#### (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

## (イ) 子会社等

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

## (ウ) 兄弟会社等

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

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。



## 1 株当たり情報

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

## 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

## 5【その他】

## (1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

## (2)訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託者

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

\* 2022年7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
株式会社ゆうちょ銀行	3,500,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	

\* 2022年7月末現在

## 2【関係業務の概要】

## (1)受託者

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

## (2)販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いを行ない、信託契約の一部解約に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行いません。

## 3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

## (1)受託者

該当事項はありません。

## (2)販売会社

該当事項はありません。

### 第3【その他】

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

## 独立監査人の監査報告書

2022年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

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

#### 監査意見

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

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

#### 監査意見の根拠

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

#### その他の記載内容

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

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

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

## 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の監査報告書

2022年8月26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資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040の2021年6月23日から2022年6月22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、野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040の2022年6月22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。