

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年11月25日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	世界6資産分散ファンド
【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】	2兆円を上限とします。
【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】

世界6資産分散ファンド

（以下「ファンド」といいます。なお、ファンドの愛称を「コアシックス」とします。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託・受益権(以下「受益権」といいます。)

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】

2兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（５）【申込手数料】

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

(6) 【申込単位】

1口単位または1円単位 (当初元本1口 = 1円)

分配金を再投資する場合には1口単位となります。

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】

2020年11月26日から2021年11月29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】

販売会社の定める期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。

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。)の指定する口座を經由して、「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/>

(1 1) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

国内及び外国（新興国を含みます。）の各株式、国内及び外国（新興国を含みます。）の各債券を実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長を目的に運用を行なうことを基本とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」を親投資信託（「マザーファンド」といいます。）とするファミリーファンド方式で運用します。「実質的な主要投資対象」とは、マザーファンドを通じて投資する、主要な投資対象という意味です。

信託金の限度額

受益権の信託金限度額は、1兆円です。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。

（世界6資産分散ファンド）

《商品分類表》

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

《属性区分表》

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

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

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。

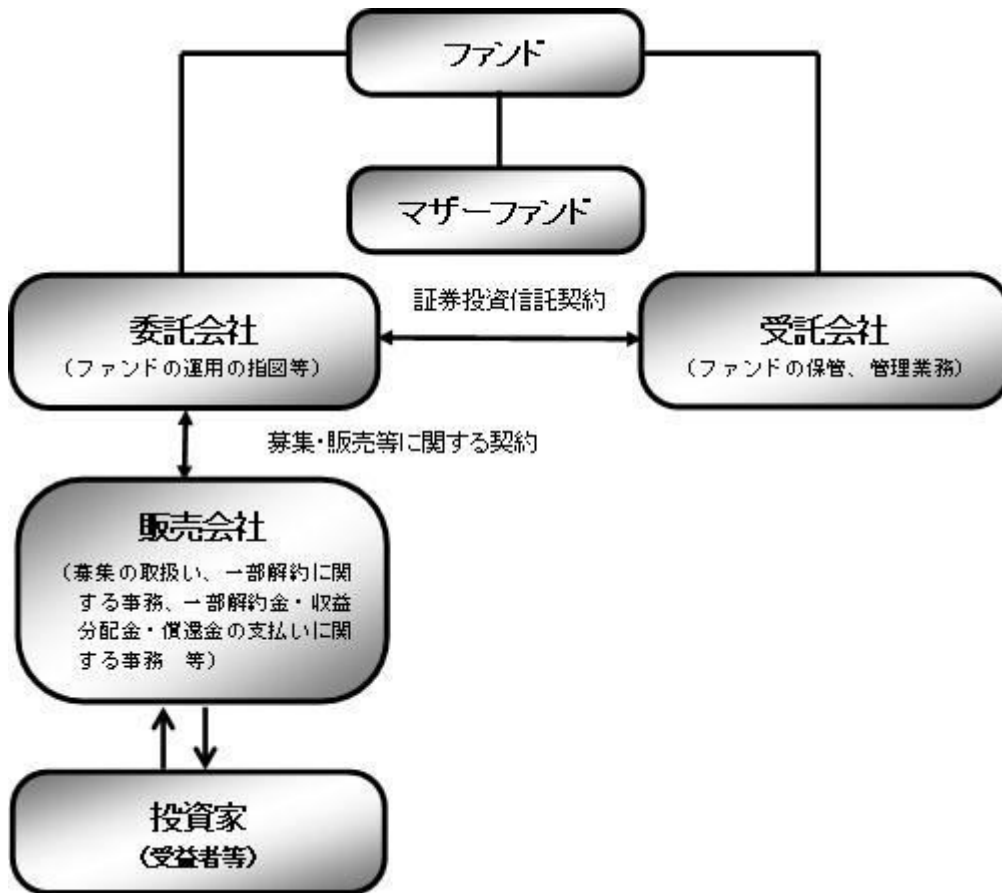
[特殊型]

- (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】

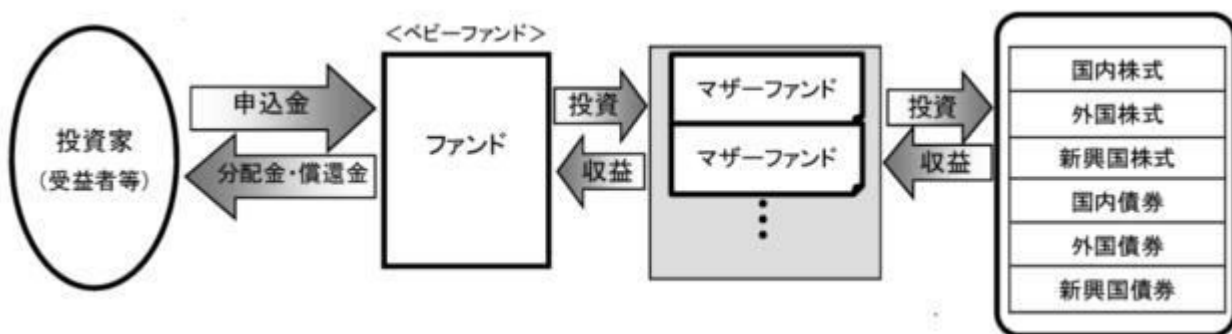
2018年5月15日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



《ファミリーファンド方式について》

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



ファンド	世界6資産分散ファンド
マザーファンド (親投資信託)	国内株式マザーファンド
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド
	新興国株式マザーファンド
	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド
	外国債券マザーファンド
	新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド
委託会社(委託者)	野村アセットマネジメント株式会社

受託会社(受託者)

野村信託銀行株式会社

委託会社の概況(2020年10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】

ファンドにおける各マザーファンドへの投資比率は、以下を基本（「基本投資割合」といいます。）とし、原則として毎月、リバランスを行ない、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの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	基本投資割合	主要投資対象	対象指数
国内株式マザーファンド	1/6	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	1/6	外国の株式	MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし） ^{*1}
新興国株式マザーファンド	1/6	新興国の株式（DR（預託証券）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） ^{*2}
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	1/6	わが国の公社債	NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）
外国債券マザーファンド	1/6	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	1/6	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・ディバースファイド（円換算ベース） ^{*3}

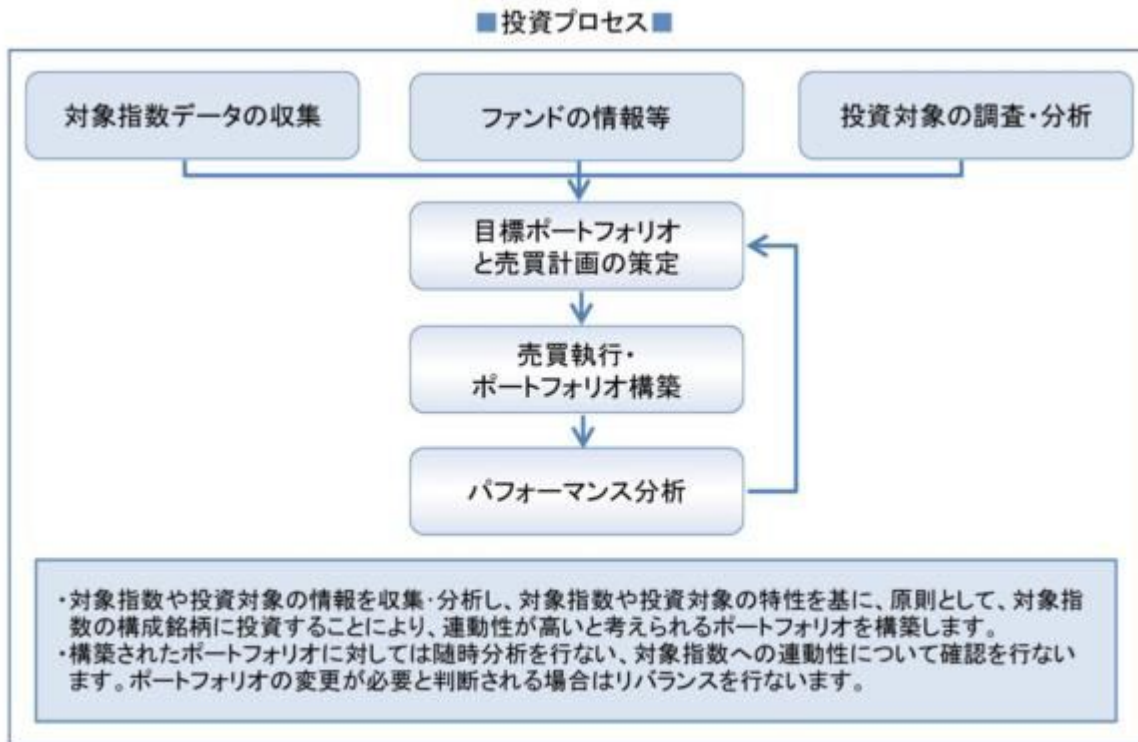
Depositary Receipt（預託証券）の略で、ある国の株式発行会社の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいいます。DRは、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。

*1 MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

*2 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。

です。

- *3 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。



* 上記の投資プロセスは、今後変更となる場合があります。

合成指数の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、有価証券指数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場合があります。

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ないません。

各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について

東証株価指数（TOPIX）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

NOMURA-BPI総合

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、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及びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。

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

当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、index.research@jpmorgan.com宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、www.morganmarkets.comもご覧ください。

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

各マザーファンドへの投資を通じて、国内及び外国（新興国を含みます。）の各株式、国内及び外国（新興国を含みます。）の各債券を実質的な主要投資対象とします。

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。）
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

投資の対象とする資産の種類(信託約款)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲等(信託約款)

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

1. 株券または新株引受権証券
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、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあ

らかじめ明確にしているもの、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を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」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ブリファード 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¹
4. 為替先渡取引²
5. 直物為替先渡取引³

- 1 「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。
- 2 「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。以下この項において同じ。）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。以下この項において同じ。）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。
- 3 「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

(参考)各マザーファンドの概要

（国内株式マザーファンド）

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

（外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド）

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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）

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

（国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド）

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

（外国債券マザーファンド）

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。

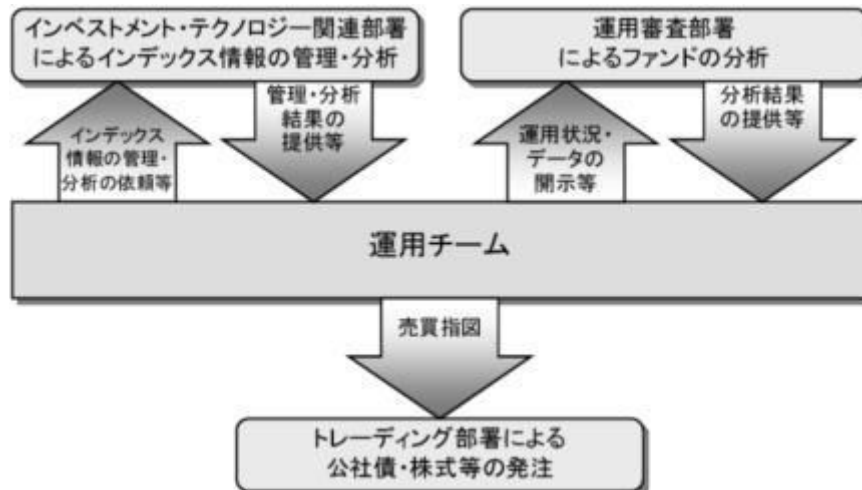
外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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。

(3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。

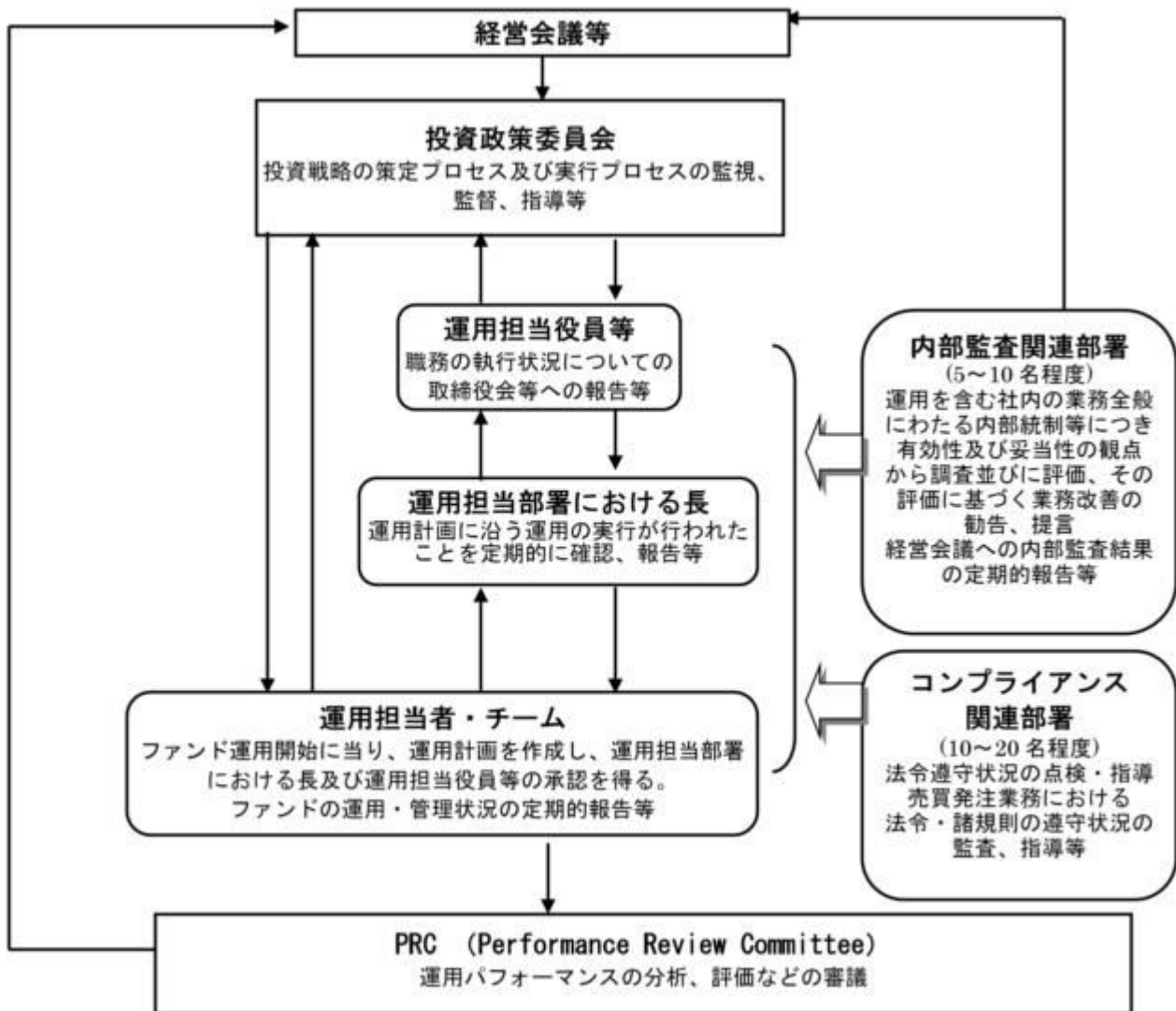


運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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

す。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

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

収益分配金額は、上記の範囲内で基準価額水準等を勘案し、委託者が決定します。

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

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

ファンドの決算日

原則として**毎年9月6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。
- ・ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ・ 同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ・ 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。
- ・ 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券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号のものを除きます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図(信託約款)

()委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引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るときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

公社債の借入れ(信託約款)

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

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

直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

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

資金の借入れ(信託約款)

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

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

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

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

3【投資リスク】

基準価額の変動要因

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

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

[株価変動リスク]

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

[債券価格変動リスク]

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

[為替変動リスク]

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

響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいものになることも想定されます。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

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

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

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

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

ファンドの基準価額と対象指数（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。

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

ファンドが実質的に投資する新興国においては、政治、経済、社会情勢の変化が金融市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、当局による海外からの投資規制などが緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により、金融市場が著しい悪影響を被る可能性や運用上の制約を大きく受ける可能性があります。

金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、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（実質的な投資対象国における非常事態による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、投資信託約款の規定に従い、委託会社の判断でファンドの購入・換金の各受付けを中止すること、および既に受付けた購入・換金の各受付けを取り消す場合があります。ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

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

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

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

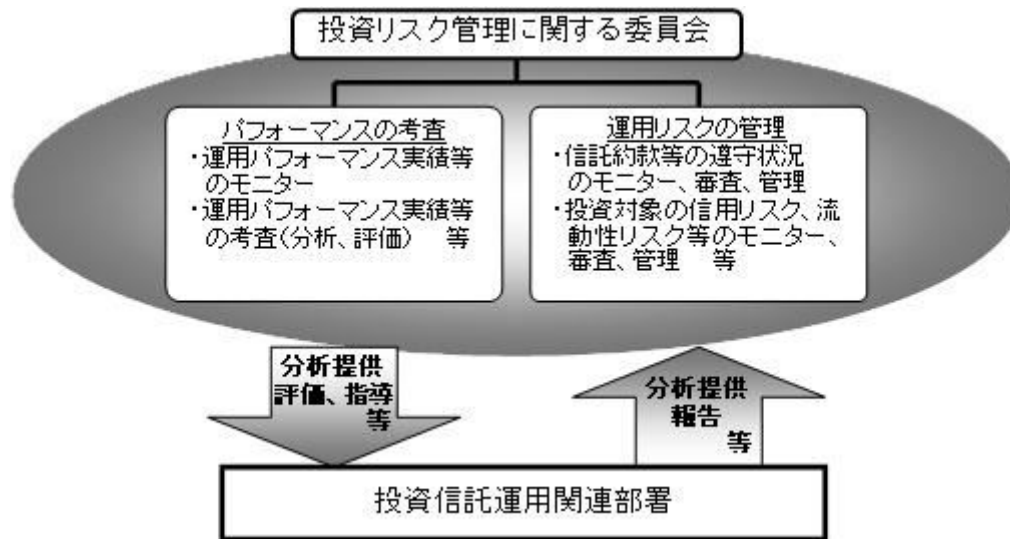
パフォーマンスの考査

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

運用リスクの管理

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

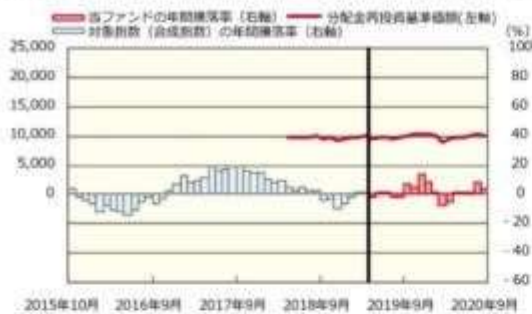
リスク管理体制図



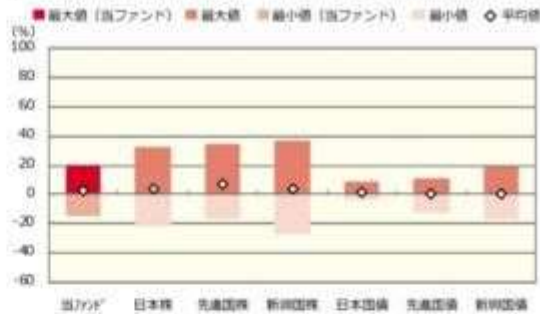
投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

■ リスクの定量的比較 (2015年10月末～2020年9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 (%)	19.8	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 14.4	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	2.5	4.2	6.6	3.5	1.6	0.7	0.5

- ※ 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- ※ 年間騰落率は、2015年10月から2020年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2019年4月までは、対象指数（合成指数）の騰落率を表示しております。

- ※ 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- ※ 2015年10月から2020年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象指数（合成指数）を用いて算出しております。決算日に対応した数値とは異なります。
- ※ 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

<代表的な資産クラスの指数>

- 日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
- 先進国株：MSCI-KOKUSA1指数（配当込み、円ベース）
- 新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
- 日本国債：NOMURA-BPI 国債
- 先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）
- 新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）

■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数額の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
 - MSCI-KOKUSA1 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-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
 - NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
 - FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
 - JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンプライアレーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や価値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「JPMS LLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての推奨、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての取組、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
- JPMS LLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities Pl.C., またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当

する率）（税抜1.0%）以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

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

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年0.5445%（税抜年0.495%）の率（「信託報酬率」といいます。）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。

< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
年0.23%	年0.23%	年0.035%

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

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

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

ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額 をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

なお、配当控除は適用されません。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

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

損益通算について

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

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

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

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

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

法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

〔個人の投資家の場合〕

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

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

〔法人の投資家の場合〕

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

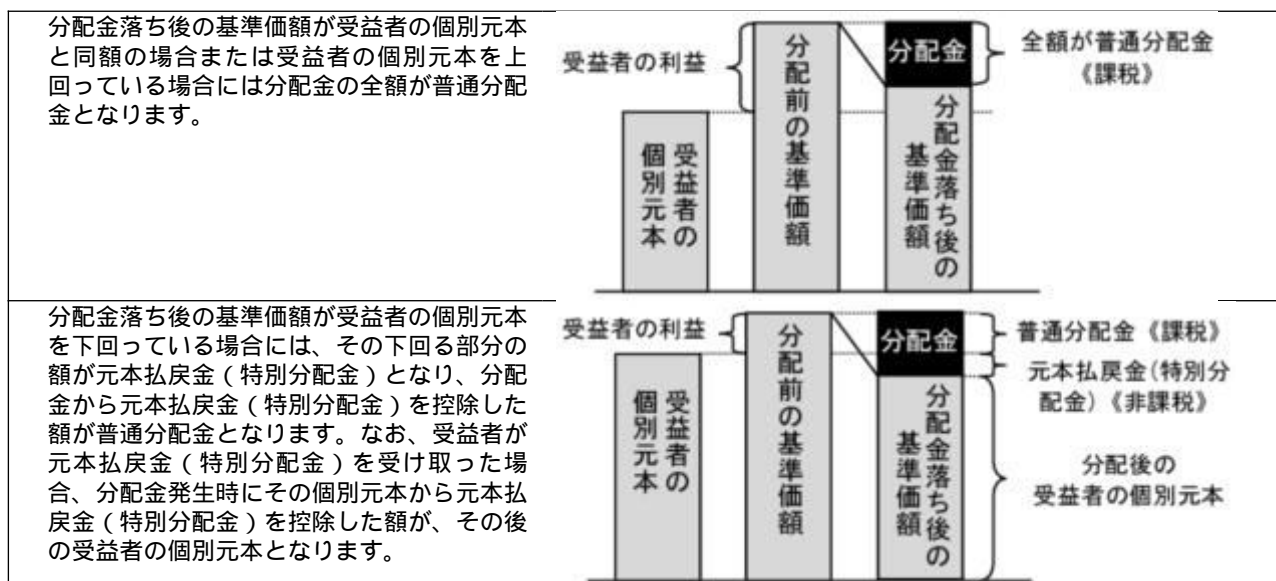
個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

分配金の課税について

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



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

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

* 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2020年9月末現在）が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は2020年9月30日現在の運用状況であります。

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

(1)【投資状況】

世界6資産分散ファンド

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	1,040,123,733	99.97
現金・預金・その他資産(負債控除後)		281,300	0.02
合計(純資産総額)		1,040,405,033	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	444,782,313,435	97.76
現金・預金・その他資産(負債控除後)		10,182,773,960	2.23
合計(純資産総額)		454,965,087,395	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	9,314,115,000	2.04

(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	481,518,064,234	69.17
	カナダ	23,072,584,687	3.31
	ドイツ	21,950,931,972	3.15

	イタリア	4,997,258,526	0.71
	フランス	23,778,239,419	3.41
	オランダ	10,205,907,230	1.46
	スペイン	5,115,096,283	0.73
	ベルギー	2,033,600,711	0.29
	オーストリア	356,237,769	0.05
	ルクセンブルグ	277,734,516	0.03
	フィンランド	2,411,790,542	0.34
	アイルランド	1,613,878,591	0.23
	ポルトガル	374,716,253	0.05
	イギリス	29,905,406,926	4.29
	スイス	23,762,567,814	3.41
	スウェーデン	7,648,646,469	1.09
	ノルウェー	1,279,814,821	0.18
	デンマーク	5,819,870,007	0.83
	オーストラリア	14,181,380,666	2.03
	ニュージーランド	703,738,980	0.10
	香港	6,637,439,101	0.95
	シンガポール	1,981,784,315	0.28
	イスラエル	665,704,048	0.09
	小計	670,292,393,880	96.29
投資証券	アメリカ	13,669,836,290	1.96
	カナダ	111,835,036	0.01
	フランス	309,741,444	0.04
	イギリス	379,662,248	0.05
	オーストラリア	1,077,424,985	0.15
	香港	332,915,310	0.04
	シンガポール	384,856,963	0.05
	小計	16,266,272,276	2.33
現金・預金・その他資産（負債控除後）		9,516,818,486	1.36
合計（純資産総額）		696,075,484,642	100.00

その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	6,842,588,548	0.98
	買建	カナダ	321,237,980	0.04
	買建	ドイツ	1,010,199,931	0.14
	買建	イギリス	415,471,878	0.05
	買建	スイス	328,554,240	0.04
	買建	オーストラリア	212,815,743	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	7,448,447,121	16.83
	メキシコ	663,192,371	1.49
	ブラジル	1,931,177,472	4.36
	チリ	103,350,214	0.23
	コロンビア	36,285,180	0.08
	ギリシャ	50,129,254	0.11
	イギリス	34,376,334	0.07
	トルコ	142,815,852	0.32
	チェコ	38,173,667	0.08
	ハンガリー	79,972,011	0.18
	ポーランド	277,434,733	0.62
	香港	9,583,992,035	21.66
	マレーシア	738,489,069	1.66
	タイ	775,629,730	1.75
	フィリピン	316,870,219	0.71
	インドネシア	543,946,215	1.22
	韓国	5,205,173,115	11.76
	台湾	5,443,225,525	12.30
	インド	3,547,563,567	8.01
	パキスタン	10,223,270	0.02
	カタール	339,872,293	0.76
	エジプト	46,993,704	0.10
	南アフリカ	1,490,773,658	3.36
アラブ首長国連邦	239,042,515	0.54	
サウジアラビア	1,195,130,357	2.70	
小計		40,282,279,481	91.04
投資信託受益証券	アメリカ	1,820,322,538	4.11
投資証券	メキシコ	16,992,613	0.03
	南アフリカ	14,468,250	0.03
	小計	31,460,863	0.07
現金・預金・その他資産（負債控除後）		2,110,435,313	4.76
合計（純資産総額）		44,244,498,195	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	1,773,495,247	4.00

買建	シンガポール	301,787,094	0.68
----	--------	-------------	------

(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	553,800,992,260	79.38
地方債証券	日本	48,193,016,342	6.90
特殊債券	日本	59,739,867,024	8.56
社債券	日本	29,668,661,150	4.25
現金・預金・その他資産(負債控除後)		6,248,497,407	0.89
合計(純資産総額)		697,651,034,183	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	259,209,773,470	43.50
	カナダ	11,248,664,816	1.88
	メキシコ	4,355,600,575	0.73
	ドイツ	41,274,373,560	6.92
	イタリア	57,784,834,251	9.69
	フランス	59,974,262,801	10.06
	オランダ	9,980,079,561	1.67
	スペイン	40,095,737,390	6.72
	ベルギー	14,639,499,547	2.45
	オーストリア	8,252,426,506	1.38
	フィンランド	2,684,102,097	0.45
	アイルランド	7,188,898,700	1.20
	イギリス	38,888,270,569	6.52
	スウェーデン	1,821,082,830	0.30
	ノルウェー	1,224,874,674	0.20
	デンマーク	3,173,444,296	0.53
	ポーランド	3,753,166,882	0.62
	オーストラリア	14,292,663,805	2.39
	シンガポール	2,644,207,825	0.44
マレーシア	2,966,352,900	0.49	
イスラエル	2,339,849,735	0.39	
	小計	587,792,166,790	98.65
現金・預金・その他資産(負債控除後)		8,017,702,197	1.34
合計(純資産総額)		595,809,868,987	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	716,682,808	9.49
	ブラジル	636,434,813	8.43
	チリ	200,528,016	2.65
	コロンビア	403,216,220	5.34
	ペルー	242,890,317	3.21
	ウルグアイ	10,366,293	0.13
	ドミニカ共和国	14,806,234	0.19
	トルコ	163,830,235	2.17
	チェコ	325,489,122	4.31
	ハンガリー	267,985,426	3.55
	ポーランド	612,587,483	8.12
	ロシア	567,705,947	7.52
	ルーマニア	225,471,965	2.98
	マレーシア	549,171,210	7.27
	タイ	661,026,603	8.76
	フィリピン	27,572,858	0.36
	インドネシア	716,799,572	9.50
	南アフリカ	537,554,478	7.12
	中国	486,687,867	6.45
	小計	7,366,807,467	97.64
現金・預金・その他資産（負債控除後）		177,291,927	2.35
合計（純資産総額）		7,544,099,394	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

世界６資産分散ファンド

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	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	71,503,854	2.4845	177,653,036	2.4733	176,850,482	16.99
2	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	105,293,171	1.6497	173,702,145	1.6796	176,850,410	16.99
3	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA - B P I 総 合 マザーファンド	132,769,211	1.3261	176,069,322	1.3299	176,569,773	16.97
4	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	133,560,385	1.3296	177,588,683	1.2884	172,079,200	16.53
5	日本	親投資信託 受益証券	外国株式M S C I - K O K U S A I マザーファンド	56,240,562	3.0831	173,397,254	3.0075	169,143,490	16.25

6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	133,104,727	1.3051	173,728,280	1.2669	168,630,378	16.20
---	----	---------------	--------------	-------------	--------	-------------	--------	-------------	-------

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.97
合計	99.97

(参考)国内株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	2,179,000	6,656.43	14,504,367,219	6,932.00	15,104,828,000	3.31
2	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,520,500	4,700.96	7,147,822,422	6,469.00	9,836,114,500	2.16
3	日本	株式	ソニー	電気機器	1,223,400	7,067.70	8,646,630,464	8,032.00	9,826,348,800	2.15
4	日本	株式	キーエンス	電気機器	177,000	40,041.88	7,087,414,084	48,980.00	8,669,460,000	1.90
5	日本	株式	任天堂	その他製品	119,700	43,669.98	5,227,296,606	59,660.00	7,141,302,000	1.56
6	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,624,800	3,764.63	6,116,778,252	3,744.00	6,083,251,200	1.33
7	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,336,800	3,313.56	4,429,567,172	4,160.00	5,561,088,000	1.22
8	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,561,600	2,420.11	6,199,354,768	2,150.00	5,507,440,000	1.21
9	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	13,176,000	423.65	5,582,037,300	416.10	5,482,533,600	1.20
10	日本	株式	第一三共	医薬品	1,676,600	2,550.58	4,276,318,388	3,229.00	5,413,741,400	1.18
11	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,370,300	3,077.73	4,217,426,772	3,885.00	5,323,615,500	1.17
12	日本	株式	ダイキン工業	機械	248,800	14,090.55	3,505,728,840	19,300.00	4,801,840,000	1.05
13	日本	株式	日本電産	電気機器	470,000	6,260.47	2,942,423,933	9,805.00	4,608,350,000	1.01
14	日本	株式	HOYA	精密機器	387,400	9,738.33	3,772,629,042	11,860.00	4,594,564,000	1.00
15	日本	株式	信越化学工業	化学	328,400	12,125.77	3,982,102,868	13,685.00	4,494,154,000	0.98
16	日本	株式	三井住友フィナンシャル・グループ	銀行業	1,332,100	2,817.14	3,752,713,809	2,917.50	3,886,401,750	0.85
17	日本	株式	村田製作所	電気機器	573,700	6,056.33	3,474,521,484	6,773.00	3,885,670,100	0.85
18	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,537,600	2,614.29	4,019,734,794	2,473.50	3,803,253,600	0.83
19	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,397,100	3,158.92	4,413,340,100	2,656.00	3,710,697,600	0.81
20	日本	株式	ファナック	電気機器	183,600	17,845.38	3,276,411,768	20,120.00	3,694,032,000	0.81
21	日本	株式	花王	化学	467,600	8,446.53	3,949,600,275	7,887.00	3,687,961,200	0.81
22	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,345,300	2,236.00	3,008,097,943	2,685.00	3,612,130,500	0.79
23	日本	株式	SMC	機械	61,300	51,160.27	3,136,124,551	58,460.00	3,583,598,000	0.78
24	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,617,310	1,233.91	3,229,550,049	1,310.50	3,429,984,755	0.75
25	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	123,900	22,770.24	2,821,232,736	27,330.00	3,386,187,000	0.74
26	日本	株式	日立製作所	電気機器	938,400	3,267.96	3,066,659,616	3,543.00	3,324,751,200	0.73
27	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,261,100	2,415.13	3,045,725,220	2,512.50	3,168,513,750	0.69
28	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	681,000	4,507.66	3,069,719,567	4,600.00	3,132,600,000	0.68

29	日本	株式	三井物産	卸売業	1,665,400	1,638.72	2,729,127,218	1,803.00	3,002,716,200	0.65
30	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	198,500	14,272.69	2,833,130,272	14,740.00	2,925,890,000	0.64

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.14
		建設業	2.40
		食料品	3.68
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.21
		化学	7.13
		医薬品	6.35
		石油・石炭製品	0.38
		ゴム製品	0.53
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.54
		非鉄金属	0.63
		金属製品	0.55
		機械	5.35
		電気機器	15.15
		輸送用機器	6.89
		精密機器	2.68
		その他製品	2.73
		電気・ガス業	1.39
		陸運業	3.65
		海運業	0.14
		空運業	0.32
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	9.92
		卸売業	4.60
		小売業	4.94
銀行業	4.62		
証券、商品先物取引業	0.76		
保険業	1.81		
その他金融業	1.11		
不動産業	1.89		
サービス業	5.60		
合計			97.76

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	2,726,220	6,800.77	18,540,404,590	12,070.72	32,907,443,731	4.72
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,132,800	17,015.08	19,274,684,752	21,928.10	24,840,160,742	3.56
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	66,667	209,720.94	13,981,466,007	332,728.30	22,181,997,843	3.18
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	378,100	17,682.47	6,685,745,051	27,697.38	10,472,380,134	1.50
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	47,570	121,802.16	5,794,129,203	155,455.11	7,394,999,773	1.06
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	47,180	121,776.17	5,745,399,946	155,104.91	7,317,849,937	1.05
7	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	414,300	14,104.98	5,843,696,956	15,558.94	6,446,072,156	0.92
8	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	468,300	11,498.16	5,384,590,493	12,619.88	5,909,893,550	0.84
9	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	389,300	12,197.14	4,748,346,716	14,522.10	5,653,456,644	0.81
10	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	265,300	17,560.24	4,658,733,516	21,100.75	5,598,029,506	0.80
11	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	96,830	29,018.59	2,809,870,168	55,971.37	5,419,708,145	0.77
12	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	116,810	11,713.36	1,368,238,002	44,337.60	5,179,075,757	0.74
13	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術 サービス	140,730	26,910.53	3,787,119,055	35,573.13	5,006,207,148	0.71
14	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売 り	169,400	20,852.56	3,532,424,168	28,789.23	4,876,896,917	0.70

15	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	219,000	19,437.62	4,256,840,432	22,264.55	4,875,936,888	0.70
16	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	479,800	9,890.48	4,745,454,957	10,088.03	4,840,236,794	0.69
17	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア・プロ バイダー/ ヘルスケア・サー ビス	149,300	26,676.19	3,982,755,303	32,179.07	4,804,335,151	0.69
18	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気 通信サー ビス	651,800	5,801.05	3,781,130,265	6,267.59	4,085,216,466	0.58
19	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	110,660	35,557.98	3,934,846,818	36,835.80	4,076,250,513	0.58
20	アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフト ウェア	75,890	33,944.24	2,576,028,969	51,771.11	3,928,909,842	0.56
21	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	284,500	10,608.48	3,018,113,345	13,267.32	3,774,552,540	0.54
22	アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフト ウェア	141,700	16,820.18	2,383,419,541	26,180.21	3,709,735,757	0.53
23	アメリカ	株式	NETFLIX INC	娯楽	69,290	39,407.12	2,730,519,583	52,210.18	3,617,643,649	0.51
24	アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	情報技術 サービス	175,700	10,413.35	1,829,625,902	20,578.10	3,615,572,170	0.51
25	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・ 半導体製 造装置	667,000	5,866.81	3,913,167,138	5,415.90	3,612,406,634	0.51
26	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	717,600	3,766.06	2,702,528,598	4,887.96	3,507,600,096	0.50
27	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	397,700	8,152.72	3,242,339,656	8,665.02	3,446,078,454	0.49
28	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気 通信サー ビス	1,123,000	3,194.35	3,587,258,831	2,994.14	3,362,419,220	0.48
29	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	875,300	3,462.74	3,030,936,661	3,826.78	3,349,585,786	0.48
30	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	642,900	4,768.54	3,065,697,825	5,175.73	3,327,480,674	0.47

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	3.98
		メディア	1.12
		娯楽	1.51
		不動産管理・開発	0.41
		エネルギー設備・サービス	0.10

石油・ガス・消耗燃料	2.50
化学	2.22
建設資材	0.24
容器・包装	0.28
金属・鉱業	1.52
紙製品・林産品	0.10
航空宇宙・防衛	1.41
建設関連製品	0.56
建設・土木	0.25
電気設備	0.80
コングロマリット	1.08
機械	1.70
商社・流通業	0.29
商業サービス・用品	0.45
航空貨物・物流サービス	0.71
旅客航空輸送業	0.05
海運業	0.06
陸運・鉄道	1.11
運送インフラ	0.16
自動車部品	0.23
自動車	1.30
家庭用耐久財	0.36
レジャー用品	0.07
繊維・アパレル・贅沢品	1.47
ホテル・レストラン・レジャー	1.51
販売	0.05
インターネット販売・通信販売	3.87
複合小売り	0.51
専門小売り	1.75
食品・生活必需品小売り	1.52
飲料	1.74
食品	1.92
タバコ	0.71
家庭用品	1.47
パーソナル用品	0.72
ヘルスケア機器・用品	3.17

	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.89
	バイオテクノロジー	2.06
	医薬品	5.34
	銀行	4.83
	各種金融サービス	0.93
	保険	2.96
	情報技術サービス	4.82
	ソフトウェア	7.54
	通信機器	0.65
	コンピュータ・周辺機器	4.96
	電子装置・機器・部品	0.53
	半導体・半導体製造装置	4.03
	各種電気通信サービス	1.71
	無線通信サービス	0.28
	電力	2.01
	ガス	0.16
	総合公益事業	0.97
	水道	0.11
	消費者金融	0.33
	資本市場	2.85
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07
	ヘルスケア・テクノロジー	0.17
	ライフサイエンス・ツール/サービス	1.01
	専門サービス	0.76
投資証券		2.33
合 計		98.63

(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	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インター ネット販 売・通信販 売	119,740	21,520.76	2,576,896,477	29,299.19	3,508,285,490	7.92

2	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	364,900	5,758.05	2,101,113,190	6,900.07	2,517,837,367	5.69
3	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	1,568,000	1,088.06	1,706,088,337	1,568.84	2,459,941,120	5.55
4	アメリカ	投資信託受益証券	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF		500,300	2,980.75	1,491,269,726	3,638.46	1,820,322,538	4.11
5	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	303,960	4,442.07	1,350,213,049	5,284.56	1,606,294,858	3.63
6	香港	株式	MEITUAN DIANPING B	インターネット販売・通信販売	227,100	1,802.00	409,235,073	3,202.29	727,240,059	1.64
7	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	182,600	2,258.27	412,361,619	3,255.32	594,421,889	1.34
8	南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インターネット販売・通信販売	27,940	18,715.75	522,918,055	18,502.93	516,972,074	1.16
9	アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	インターネット販売・通信販売	54,520	5,212.66	284,194,734	7,951.92	433,539,115	0.97
10	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	6,146,000	84.25	517,840,476	68.38	420,303,429	0.94
11	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	378,000	1,074.70	406,237,983	1,084.49	409,938,165	0.92
12	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	219,700	985.85	216,593,219	1,463.05	321,432,085	0.72
13	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	35,170	7,709.98	271,160,207	7,627.20	268,248,624	0.60
14	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信サービス	395,000	805.26	318,078,743	668.16	263,926,163	0.59
15	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	105,800	2,464.30	260,722,979	2,483.99	262,806,671	0.59
16	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	238,121	928.19	221,022,331	1,095.22	260,797,144	0.58
17	アメリカ	株式	NETEASE INC-ADR	娯楽	5,260	39,539.04	207,975,365	47,690.40	250,851,546	0.56

18	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	53,150	3,806.18	202,298,702	4,585.40	243,714,010	0.55
19	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インタラクティブ・メディアおよびサービス	17,700	10,752.20	190,313,992	12,968.96	229,550,663	0.51
20	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・機器・部品	803,649	279.41	224,549,496	280.28	225,246,742	0.50
21	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,910,000	69.75	272,733,448	54.46	212,952,285	0.48
22	台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	95,538	1,496.67	142,989,701	2,220.39	212,132,575	0.47
23	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術サービス	58,400	2,774.62	162,038,347	3,608.18	210,717,712	0.47
24	韓国	株式	NAVER CORP	インタラクティブ・メディアおよびサービス	7,780	19,431.20	151,174,736	26,922.20	209,454,716	0.47
25	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	673,300	282.45	190,180,014	301.80	203,203,223	0.45
26	アメリカ	株式	TAL EDUCATION GROUP-ADR	各種消費者サービス	24,830	5,933.10	147,318,882	7,906.43	196,316,756	0.44
27	香港	株式	XIAOMI CORPORATION	コンピュータ・周辺機器	680,000	159.04	108,153,238	273.68	186,104,100	0.42
28	韓国	株式	LG CHEMICALS LTD	化学	3,000	33,359.65	100,078,976	59,383.20	178,149,600	0.40
29	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガス・消耗燃料	382,000	535.49	204,560,473	450.49	172,089,625	0.38
30	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	5,139,000	39.68	203,943,760	32.62	167,652,167	0.37

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	7.55
		メディア	0.23
		娯楽	1.16
		不動産管理・開発	2.01
		エネルギー設備・サービス	0.06
		石油・ガス・消耗燃料	5.10

化学	2.16
建設資材	0.86
容器・包装	0.04
金属・鉱業	3.09
紙製品・林産品	0.17
航空宇宙・防衛	0.07
建設関連製品	0.03
建設・土木	0.44
電気設備	0.23
コングロマリット	0.94
機械	0.33
商社・流通業	0.02
商業サービス・用品	0.25
航空貨物・物流サービス	0.21
旅客航空輸送業	0.10
海運業	0.09
陸運・鉄道	0.22
運送インフラ	0.56
自動車部品	0.38
自動車	2.05
家庭用耐久財	0.26
レジャー用品	0.09
繊維・アパレル・贅沢品	0.81
ホテル・レストラン・レジャー	0.67
インターネット販売・通信販売	12.43
複合小売り	0.42
専門小売り	0.46
食品・生活必需品小売り	1.32
飲料	0.70
食品	1.69
タバコ	0.28
家庭用品	0.47
パーソナル用品	0.62
ヘルスケア機器・用品	0.43
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.46
バイオテクノロジー	0.66

	医薬品	1.27
	銀行	10.40
	各種金融サービス	0.47
	保険	2.82
	情報技術サービス	1.73
	ソフトウェア	0.28
	通信機器	0.13
	コンピュータ・周辺機器	5.38
	電子装置・機器・部品	1.94
	半導体・半導体製造装置	7.65
	各種電気通信サービス	1.18
	無線通信サービス	1.97
	電力	0.73
	ガス	0.46
	総合公益事業	0.04
	水道	0.16
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.61
	消費者金融	0.17
	資本市場	0.93
	各種消費者サービス	0.97
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.37
	ヘルスケア・テクノロジー	0.20
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.66
	専門サービス	0.04
	その他の業種	0.00
投資信託受益証券		4.11
投資証券		0.07
合 計		95.23

（参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （%）	償還期限	投資 比率 （%）
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	7,500,000,000	100.40	7,530,375,000	100.29	7,521,975,000	0.1	2021/12/20	1.07

2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	6,600,000,000	103.07	6,802,950,000	102.72	6,779,982,000	0.6	2024/6/20	0.97
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 52回	6,600,000,000	101.47	6,697,657,000	101.40	6,692,598,000	0.1	2028/9/20	0.95
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 3回	6,200,000,000	100.62	6,238,440,000	100.47	6,229,388,000	0.1	2022/9/20	0.89
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	6,000,000,000	102.98	6,179,135,000	102.55	6,153,000,000	0.8	2023/6/20	0.88
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	5,900,000,000	101.40	5,983,005,000	101.23	5,972,983,000	0.1	2026/6/20	0.85
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 50回	5,850,000,000	101.64	5,946,349,500	101.46	5,935,761,000	0.1	2028/3/20	0.85
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	5,800,000,000	101.50	5,887,058,000	101.29	5,874,936,000	0.1	2026/9/20	0.84
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 51回	5,600,000,000	101.57	5,688,088,000	101.43	5,680,472,000	0.1	2028/6/20	0.81
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	5,400,000,000	102.69	5,545,260,000	102.35	5,527,386,000	0.6	2023/12/20	0.79
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 58回	5,470,000,000	100.93	5,521,335,100	100.99	5,524,371,800	0.1	2030/3/20	0.79
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 47回	5,400,000,000	101.67	5,490,218,000	101.42	5,476,734,000	0.1	2027/6/20	0.78
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	5,300,000,000	102.47	5,430,910,000	102.17	5,415,487,000	0.3	2025/12/20	0.77
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 49回	5,300,000,000	101.45	5,377,102,000	101.45	5,377,062,000	0.1	2027/12/20	0.77
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 59回	5,300,000,000	100.63	5,333,618,000	100.87	5,346,269,000	0.1	2030/6/20	0.76
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,250,000,000	102.19	5,365,395,000	101.81	5,345,445,000	0.6	2023/3/20	0.76
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 1回	5,300,000,000	100.47	5,325,014,000	100.35	5,319,027,000	0.1	2022/3/20	0.76
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 53回	5,100,000,000	101.40	5,171,502,000	101.36	5,169,513,000	0.1	2028/12/20	0.74
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 55回	5,100,000,000	101.15	5,158,905,000	101.22	5,162,424,000	0.1	2029/6/20	0.73
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 39回	5,000,000,000	102.73	5,136,630,000	102.44	5,122,100,000	0.4	2025/6/20	0.73
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	5,000,000,000	102.58	5,129,264,000	102.38	5,119,000,000	0.4	2025/3/20	0.73
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	5,000,000,000	101.59	5,079,650,000	101.31	5,065,750,000	0.1	2026/12/20	0.72
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 3回	4,970,000,000	101.00	5,019,928,700	101.03	5,021,340,100	0.1	2025/3/20	0.71
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 47回	4,200,000,000	118.53	4,978,554,000	118.56	4,979,688,000	1.6	2033/12/20	0.71

25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 46回	4,900,000,000	101.68	4,982,712,000	101.36	4,966,983,000	0.1	2027/3/20	0.71
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 8回	4,900,000,000	100.82	4,940,180,000	100.75	4,937,191,000	0.1	2023/12/20	0.70
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 56回	4,800,000,000	100.98	4,847,420,000	101.12	4,853,904,000	0.1	2029/9/20	0.69
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	4,600,000,000	102.83	4,730,180,000	102.51	4,715,598,000	0.5	2024/9/20	0.67
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 48回	4,600,000,000	101.81	4,683,352,000	101.43	4,666,194,000	0.1	2027/9/20	0.66
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 4回	4,500,000,000	100.90	4,540,515,000	101.01	4,545,855,000	0.1	2025/6/20	0.65

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.38
地方債証券	6.90
特殊債券	8.56
社債券	4.25
合計	99.10

(参考)外国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	72,200,000	13,960.64	10,079,582,150	13,798.63	9,962,613,637	6	2026/2/15	1.67
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	80,800,000	10,994.02	8,883,172,247	10,904.42	8,810,775,497	2.5	2022/1/15	1.47
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	48,000,000	14,673.40	7,043,232,960	14,596.26	7,006,207,869	5.25	2028/11/15	1.17
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,500,000	13,140.27	6,767,242,355	13,202.68	6,799,381,512	2.5	2046/2/15	1.14
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	46,200,000	14,780.59	6,828,632,624	14,699.58	6,791,209,425	5.5	2028/8/15	1.13
6	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	31,800,000	19,369.17	6,159,398,711	20,281.92	6,449,653,040	5.75	2032/7/30	1.08
7	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,550,000	20,041.03	5,721,716,349	21,331.16	6,090,047,408	3.25	2045/5/25	1.02
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,600,000	11,642.10	5,890,905,431	11,643.78	5,891,755,282	2.25	2025/11/15	0.98
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	50,500,000	11,837.60	5,977,991,856	11,516.08	5,815,621,092	8	2021/11/15	0.97
10	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	27,450,000	21,672.33	5,949,055,272	21,083.06	5,787,300,739	3.25	2044/1/22	0.97
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,100,000	14,186.10	5,263,043,950	14,276.38	5,296,539,763	3	2044/11/15	0.88
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,900,000	11,025.51	5,281,222,353	10,979.22	5,259,050,640	1.75	2023/1/31	0.88

13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,900,000	13,069.87	5,214,878,281	13,163.00	5,252,040,012	2.5	2045/2/15	0.88
14	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	15,277.25	5,209,544,279	15,292.77	5,214,837,025	3.5	2026/4/25	0.87
15	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000	16,145.76	4,827,582,459	17,376.34	5,195,528,591	5.25	2029/11/1	0.87
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	11,511.53	5,191,702,350	11,472.68	5,174,182,063	2.375	2024/8/15	0.86
17	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	18,692.77	5,047,049,333	18,831.84	5,084,597,670	5.5	2029/4/25	0.85
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	31,700,000	15,749.80	4,992,686,674	15,649.30	4,960,830,492	5.375	2031/2/15	0.83
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,507.40	4,902,153,506	11,436.31	4,871,871,788	2.75	2023/11/15	0.81
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,700,000	11,421.44	4,876,954,921	11,394.99	4,865,660,771	2.125	2024/9/30	0.81
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,000,000	11,346.22	4,878,875,737	11,299.93	4,858,972,112	2.25	2023/12/31	0.81
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,662.93	4,913,219,750	12,439.76	4,826,628,857	6.25	2023/8/15	0.81
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,100,000	11,437.14	4,700,666,614	11,362.75	4,670,091,850	2.75	2023/7/31	0.78
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,000,000	11,932.25	4,534,257,375	11,952.92	4,542,109,618	2.375	2027/5/15	0.76
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	12,578.37	4,339,539,664	12,637.31	4,359,873,260	2.25	2046/8/15	0.73
26	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	31,400,000	13,861.41	4,352,483,949	13,882.20	4,359,012,684	5.5	2022/11/1	0.73
27	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000	21,080.61	4,237,203,429	21,503.74	4,322,253,385	5.75	2032/10/25	0.72
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	28,200,000	14,780.25	4,168,033,082	14,696.28	4,144,351,313	5.25	2029/2/15	0.69
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	11,900.16	4,105,556,621	11,858.69	4,091,248,531	2.875	2025/4/30	0.68
30	イギリス	国債証券	UK TREASURY	18,440,000	22,789.76	4,202,433,125	22,115.98	4,078,187,800	3.5	2045/1/22	0.68

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.65
合計	98.65

(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	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	6,100,000	2,995.47	182,724,078	3,013.72	183,837,286	2.5	2027/7/25	2.43
2	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000	1,678.16	167,816,277	1,650.25	165,025,662	3.6	2030/5/21	2.18
3	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000	1,673.87	167,387,775	1,621.34	162,134,706	3.48	2027/6/29	2.14

4	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	4,510,000,000	3.45	156,001,982	3.50	158,066,552	9.85	2027/6/28	2.09
5	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000	2,130.95	129,993,722	2,127.27	129,763,904	10	2023/1/1	1.72
6	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,500,000	1,590.71	119,303,568	1,580.25	118,519,369	3.03	2024/6/24	1.57
7	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000	2,945.41	117,816,712	2,956.81	118,272,615	2.5	2024/4/25	1.56
8	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000	3,081.62	117,101,572	3,090.72	117,447,360	3.25	2025/7/25	1.55
9	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	23,600,000	444.03	104,792,799	469.06	110,699,293	1	2026/6/26	1.46
10	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	19,000,000	584.65	111,084,662	569.42	108,190,881	8	2030/1/31	1.43
11	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,900,000	708.31	105,539,509	725.73	108,134,031	10.5	2026/12/21	1.43
12	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000	2,841.43	105,132,978	2,837.07	104,971,923	2.25	2022/4/25	1.39
13	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	12,230,000,000	0.82	100,893,837	0.81	99,503,280	9	2029/3/15	1.31
14	メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	17,800,000	508.47	90,508,234	518.28	92,254,609	8	2023/12/7	1.22
15	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	411,000	2,215.23	91,046,915	2,161.74	88,847,836	10	2025/1/1	1.17
16	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,100,000	542.57	81,929,187	559.45	84,477,988	8.5	2029/5/31	1.11
17	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,900,000	1,665.11	81,590,850	1,696.74	83,140,643		2022/7/1	1.10
18	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,900,000	343.45	82,085,915	343.26	82,039,686	1.45	2024/12/17	1.08
19	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000	2,701.57	78,345,639	2,749.19	79,726,729	3.733	2028/6/15	1.05
20	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	5,000,000	1,599.45	79,972,608	1,541.31	77,065,714		2024/1/1	1.02
21	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,850,000	495.21	68,587,342	526.04	72,857,748	7.5	2027/6/3	0.96
22	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	47,700,000	148.32	70,753,354	148.72	70,941,630	7.95	2026/10/7	0.94
23	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000	2,697.55	70,136,342	2,723.37	70,807,782	4.181	2024/7/15	0.93
24	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000	2,285.62	73,145,464	2,169.93	69,438,026	10	2027/1/1	0.92
25	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	8,800,000,000	0.74	65,599,560	0.78	68,732,928	8.125	2024/5/15	0.91
26	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	14,000,000	449.41	62,918,023	459.83	64,376,676	0.45	2023/10/25	0.85
27	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000	2,840.66	62,494,543	2,894.69	63,683,259	2.5	2023/1/25	0.84
28	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	17,700,000	357.66	63,305,925	356.78	63,151,385	2.125	2026/12/17	0.83
29	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	3,900,000	1,615.95	63,022,360	1,595.71	62,232,869		2023/7/1	0.82
30	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,900,000	548.94	59,835,541	562.07	61,266,336	10	2024/12/5	0.81

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.64
合計	97.64

【投資不動産物件】

世界6資産分散ファンド

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）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。

【その他投資資産の主要なもの】

世界6資産分散ファンド

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(2020年12月限)	買建	573	日本円	9,310,354,835	9,314,115,000	2.04

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
----	----------	-----	----	-----------	----	----	------	-------------	-----	------------	-----------------

株価指数先物取引	アメリカ	シカゴマーカンタイル取引所	E-mini S&P500株価指数先物(2020年12月限)	買建	388	米ドル	65,311,505	6,909,957,228	64,674,750	6,842,588,548	0.98
	カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2020年12月限)	買建	21	カナダドル	4,079,790	322,425,802	4,064,760	321,237,980	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	ユーロ50株価指数先物(2020年12月限)	買建	254	ユーロ	8,342,255	1,035,857,804	8,135,620	1,010,199,931	0.14
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200株価指数先物(2020年12月限)	買建	19	豪ドル	2,811,150	212,213,712	2,819,125	212,815,743	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(2020年12月限)	買建	52	英ポンド	3,124,725	425,243,824	3,052,920	415,471,878	0.05
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SMI株価指数先物(2020年12月限)	買建	28	スイスフラン	2,921,480	336,087,063	2,856,000	328,554,240	0.04

(参考) 新興国株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額(円)	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	E-mini MSCI Emerging Markets 株価指数先物(2020年12月限)	買建	313	米ドル	17,202,715	1,820,047,247	16,762,715	1,773,495,247	4.00
	シンガポール	シンガポール取引所	SGX FTSE China A50 指数先物(2020年10月限)	買建	188	米ドル	2,842,090	300,693,122	2,852,430	301,787,094	0.68

(参考) 国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

世界6資産分散ファンド

2020年9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 9月 6日)	640	640	0.9607	0.9607
第2計算期間	(2019年 9月 6日)	1,402	1,402	0.9713	0.9713
第3計算期間	(2020年 9月 7日)	1,054	1,054	1.0290	1.0290
	2019年 9月末日	1,416		0.9806	
	10月末日	1,464		1.0109	
	11月末日	1,404		1.0198	
	12月末日	1,313		1.0449	
	2020年 1月末日	1,181		1.0327	
	2月末日	1,139		0.9955	
	3月末日	1,041		0.9029	
	4月末日	1,092		0.9378	
	5月末日	1,158		0.9679	
	6月末日	1,122		0.9874	
	7月末日	1,109		0.9983	
	8月末日	1,066		1.0314	
	9月末日	1,040		1.0168	

【分配の推移】

世界6資産分散ファンド

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2018年 5月15日～2018年 9月 6日	0.0000円
第2計算期間	2018年 9月 7日～2019年 9月 6日	0.0000円
第3計算期間	2019年 9月 7日～2020年 9月 7日	0.0000円

【収益率の推移】

世界6資産分散ファンド

	計算期間	収益率
第1計算期間	2018年 5月15日～2018年 9月 6日	3.9%
第2計算期間	2018年 9月 7日～2019年 9月 6日	1.1%
第3計算期間	2019年 9月 7日～2020年 9月 7日	5.9%

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

（４）【設定及び解約の実績】

世界６資産分散ファンド

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2018年 5月15日～2018年 9月 6日	667,408,902	1,020,180	666,388,722
第2計算期間	2018年 9月 7日～2019年 9月 6日	817,734,446	40,350,052	1,443,773,116
第3計算期間	2019年 9月 7日～2020年 9月 7日	243,512,195	662,198,528	1,025,086,783

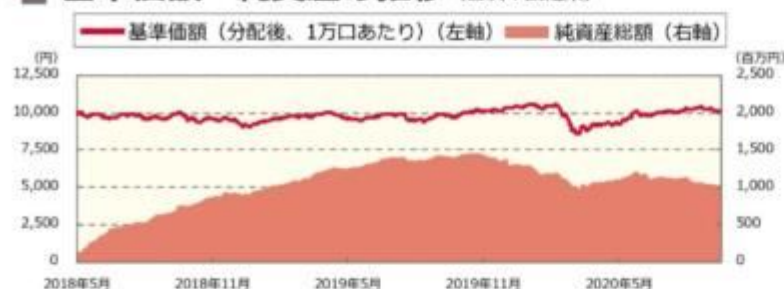
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報



運用実績（2020年9月30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）

2020年9月	0 円
2019年9月	0 円
2018年9月	0 円
--	--
--	--
設定来累計	0 円

■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

	投資比率 (%)
国内株式マザーファンド	17.0
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	16.3
新興国株式マザーファンド	16.2
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	17.0
外国債券マザーファンド	17.0
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	16.5

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.6
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.4
3	ソニー	電気機器	0.4
4	キーエンス	電気機器	0.3
5	任天堂	その他製品	0.3

・「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	0.8
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	0.5
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.2
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.2

・「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	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネット販売・通信販売	1.3
2	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.9
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.9
4	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	—	0.7
5	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.6

・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	国庫債券 利付（5年）第130回	国債証券	0.2
2	国庫債券 利付（10年）第334回	国債証券	0.2
3	国庫債券 利付（10年）第352回	国債証券	0.2
4	国庫債券 利付（5年）第133回	国債証券	0.2
5	国庫債券 利付（10年）第329回	国債証券	0.1

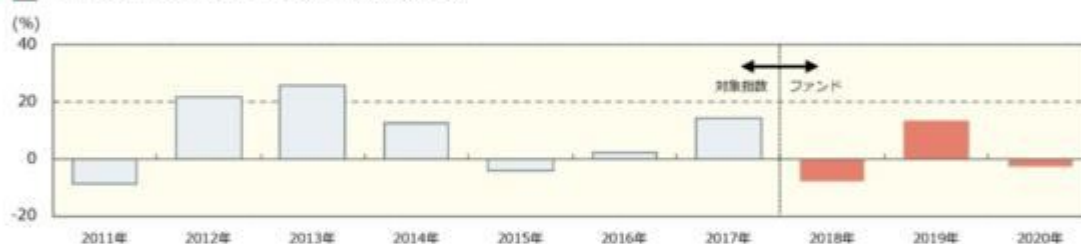
・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	US TREASURY BOND	国債証券	0.3
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.2
3	US TREASURY BOND	国債証券	0.2
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.2
5	US TREASURY BOND	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	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4
2	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4
3	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4
4	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.3
5	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.3

■ 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。
- ・2011年から2017年は対象指数（合成指数）の年間収益率。（出所：MSCI他）
- ・2018年は設定日（2018年5月15日）から年末までのファンドの収益率。
- ・2020年は年初から運用実績作成基準日までのファンドの収益率。

●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。●対象指数（合成指数）の情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。●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。
- ・ 販売会社の営業日であっても、下記の条件に該当する日（「申込不可日」といいます。）には、原則として取得の申込みができません。

申込日当日あるいは申込日の翌営業日が、以下のいずれかの休業日に該当する場合

- ・ ニューヨーク証券取引所
- ・ ニューヨークの銀行

申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・ 販売の単位は、1口単位または1円単位(当初元本1口 = 1円) (分配金を再投資する場合には1口単位) 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。
- ・ 販売会社の定める期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。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

- ・ 金融商品取引所（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、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（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、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（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取り消す場合があります。

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

2【換金（解約）手続等】

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口換金には制限を設ける場合があります。
- ・解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して7営業日目から販売会社において支払います。ただし、金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、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（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）により、投資対象資産の売却や売却代金の入金が遅延したとき等は、一部解約金の支払いを延期する場合があります。
- ・金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、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（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付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付が中止された場合には、受益者は当該受付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、当該受付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
株式	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 ¹ における以下のいずれかの価額で評価します。 ² 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く) 価格情報会社の提供する価額
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行いません。

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

(2) 【保管】

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

(3) 【信託期間】

無期限とします(2018年5月15日設定)。

(4) 【計算期間】

原則として、毎年9月7日から翌年9月6日までとします。

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

(5) 【その他】

(a) ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託期間中において、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。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- () 上記()の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- () 上記()の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- () 上記()から()までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記()から()までに規定するこの信託契約の解約の手続を行なうことが困難な場合には適用しません。
- () 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- () 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「(d) 信託約款の変更等」の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(c) 運用報告書

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

(d) 信託約款の変更等

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

者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

(e)公告

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

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

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

(f)受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

(g)反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

(h)他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

(i)関係法人との契約の更新に関する手続

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

なお、運用の外部委託を行なう場合は、委託者と運用の委託先との間で締結する「運用指図に関する

権限の委託契約」は、契約終了の3ヵ月前までに当事者の一方から更新しない旨を書面によって通知がない限り、1年毎に自動的に更新されるものとします。但し、当該契約はファンドの償還日に終了するものとします。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

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

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

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

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

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

(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3期計算期間(2019年9月7日から2020年9月7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】

【世界6資産分散ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2019年 9月 6日現在)	第3期 (2020年 9月 7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,900,011	3,444,356
親投資信託受益証券	1,401,983,204	1,054,475,203
未収入金	-	11,108,940
流動資産合計	1,405,883,215	1,069,028,499
資産合計	1,405,883,215	1,069,028,499
負債の部		
流動負債		
未払解約金	99	11,164,899
未払受託者報酬	246,064	214,909
未払委託者報酬	3,233,903	2,824,549
未払利息	6	4
その他未払費用	21,028	18,361
流動負債合計	3,501,100	14,222,722
負債合計	3,501,100	14,222,722
純資産の部		
元本等		
元本	1,443,773,116	1,025,086,783
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	41,391,001	29,718,994
(分配準備積立金)	29,291,452	52,529,696
元本等合計	1,402,382,115	1,054,805,777
純資産合計	1,402,382,115	1,054,805,777
負債純資産合計	1,405,883,215	1,069,028,499

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期		第3期	
	自	2018年 9月 7日	自	2019年 9月 7日
	至	2019年 9月 6日	至	2020年 9月 7日
営業収益				
有価証券売買等損益		15,118,686		92,835,765
営業収益合計		15,118,686		92,835,765
営業費用				
支払利息		1,351		3,358
受託者報酬		411,791		470,809
委託者報酬		5,411,968		6,187,731
その他費用		35,174		40,235
営業費用合計		5,860,284		6,702,133
営業利益又は営業損失()		9,258,402		86,133,632
経常利益又は経常損失()		9,258,402		86,133,632
当期純利益又は当期純損失()		9,258,402		86,133,632
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()		696,227		30,491,246
期首剰余金又は期首欠損金()		26,211,422		41,391,001
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,488,617		17,729,201
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,488,617		17,729,201
剰余金減少額又は欠損金増加額		25,230,371		2,261,592
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		25,230,371		2,261,592
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		41,391,001		29,718,994

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2019年 9月 7日から2020年 9月 7日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第2期 2019年 9月 6日現在	第3期 2020年 9月 7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,443,773,116口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,025,086,783口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 41,391,001円	
3. 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 0.9713円 (10,000口当たり純資産額) (9,713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 1.0290円 (10,000口当たり純資産額) (10,290円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2018年 9月 7日 至 2019年 9月 6日	第3期 自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7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>25,780,122円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>7,667,360円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>3,511,330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>36,958,812円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,443,773,116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>255円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	25,780,122円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	7,667,360円	分配準備積立金額	D	3,511,330円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	36,958,812円	当ファンドの期末残存口数	F	1,443,773,116口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	255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>23,926,961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>11,441,514円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>9,628,718円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>17,161,221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>62,158,414円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,025,086,783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>606円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	23,926,961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	11,441,514円	収益調整金額	C	9,628,718円	分配準備積立金額	D	17,161,221円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	62,158,414円	当ファンドの期末残存口数	F	1,025,086,783口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	606円
項目																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	25,780,122円																																															
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																															
収益調整金額	C	7,667,360円																																															
分配準備積立金額	D	3,511,330円																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	36,958,812円																																															
当ファンドの期末残存口数	F	1,443,773,116口																																															
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	255円																																															
項目																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	23,926,961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	11,441,514円																																															
収益調整金額	C	9,628,718円																																															
分配準備積立金額	D	17,161,221円																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	62,158,414円																																															
当ファンドの期末残存口数	F	1,025,086,783口																																															
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	606円																																															

10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2018年 9月 7日 至 2019年 9月 6日	第3期 自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7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、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</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>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第2期 2019年 9月 6日現在	第3期 2020年 9月 7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>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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2期 自 2018年 9月 7日 至 2019年 9月 6日	第3期 自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7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2期 自 2018年 9月 7日 至 2019年 9月 6日	第3期 自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7日
期首元本額 666,388,722円	期首元本額 1,443,773,116円
期中追加設定元本額 817,734,446円	期中追加設定元本額 243,512,195円
期中一部解約元本額 40,350,052円	期中一部解約元本額 662,198,528円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2018年 9月 7日 至 2019年 9月 6日	第3期 自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7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	13,478,363	58,949,294
合計	13,478,363	58,949,294

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年9月7日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2020年9月7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	106,227,074	175,232,181	
		外国債券マザーファンド	71,557,875	177,821,319	
		外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	56,271,397	173,557,869	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	132,823,222	176,136,874	
		新興国株式マザーファンド	133,271,018	174,011,968	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	133,600,205	177,714,992	
	小計	銘柄数:6 組入時価比率:100.0%	633,750,791	1,054,475,203 100.0%	
合計			1,054,475,203		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2020年9月7日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	19,941,389,856
株式	442,397,201,860
派生商品評価勘定	77,058,035
未収入金	6,287,540
未収配当金	235,158,176
未収利息	1,484,014

その他未収収益	12,123,997
差入委託証拠金	131,519,304
流動資産合計	462,802,222,782
資産合計	462,802,222,782
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	24,523,724
未払金	2,335,970
未払解約金	576,912,948
未払利息	28,431
有価証券貸借取引受入金	14,925,473,751
流動負債合計	15,529,274,824
負債合計	15,529,274,824
純資産の部	
元本等	
元本	271,147,518,306
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	176,125,429,652
元本等合計	447,272,947,958
純資産合計	447,272,947,958
負債純資産合計	462,802,222,782

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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。

(貸借対照表に関する注記)

2020年 9月 7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	1.6496円
(10,000口当たり純資産額)	(16,496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	
	14,045,889,160円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月 7日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p> 株式</p> <p> (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p> 派生商品評価勘定</p> <p> デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p> コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p> これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 9月 7日現在		2019年 9月 7日
期首		2019年 9月 7日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額		260,061,369,573円
同期中における追加設定元本額		69,108,712,087円
同期中における一部解約元本額		58,022,563,354円
期末元本額		271,147,518,306円
期末元本額の内訳*		
バランスセレクト30		165,633,805円
バランスセレクト50		374,822,633円
バランスセレクト70		475,973,260円
野村世界6資産分散投信（安定コース）		2,668,933,871円
野村世界6資産分散投信（分配コース）		3,486,145,441円
野村世界6資産分散投信（成長コース）		7,981,282,111円
野村資産設計ファンド2015		46,652,104円
野村資産設計ファンド2020		46,663,780円
野村資産設計ファンド2025		84,477,722円
野村資産設計ファンド2030		110,027,011円
野村資産設計ファンド2035		86,577,188円
野村資産設計ファンド2040		175,511,227円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）		88,060,549,360円
のむラップ・ファンド（保守型）		2,751,919,288円
のむラップ・ファンド（普通型）		9,146,243,852円
のむラップ・ファンド（積極型）		2,543,178,902円
野村資産設計ファンド2045		27,101,764円
野村インデックスファンド・TOPIX		1,796,541,174円
マイ・ロード		3,714,198,817円
ネクストコア		33,098,538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		1,533,035,318円
野村TOPIXインデックス（野村SMA・EW向け）		3,512,619,769円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）		1,672,032,580円
野村資産設計ファンド2050		45,016,008円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		14,658,725円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		7,295,008円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		5,709,757円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		3,753,087円
のむラップ・ファンド（やや保守型）		334,813,031円
のむラップ・ファンド（やや積極型）		343,386,405円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		4,124,983円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		4,673,838円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		19,307,973円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		6,105,087円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		22,438,457円
野村6資産均等バランス		1,499,753,285円
世界6資産分散ファンド		106,227,074円

野村資産設計ファンド2060	16,403,936円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	467,042,735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)	409,463,053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)	267,582,978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)	643,013,487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)	753,597,612円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	4,354,333円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	9,427,029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)	889,302円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,833,507,226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)	11,412,094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)	106,366,237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)	86,820,590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)	30,826,179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)	102,279,842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)	262,582,432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)	4,619,669,766円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	74,888,677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)	171,546,849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)	2,093,838,933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)	406,286,621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)	1,160,246,121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)	1,365,356円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	7,762,454円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	29,777,465円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	37,656,400円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	127,918,004円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	10,027,582,680円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	25,880,651,489円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	27,987,453,723円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)	31,949,890,481円
マイバランスDC30	3,368,496,024円
マイバランスDC50	5,365,546,215円
マイバランスDC70	5,088,657,607円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	9,957,906,335円
野村DC運用戦略ファンド	523,718,310円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	42,663,097円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	996,510,719円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	760,795,579円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	631,550,068円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	7,848,097円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	3,758,196円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	51,127,727円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	12,972,007円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	9,891,677円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	9,576,784円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	304,006,620円

マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	242,991,001円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	126,745,405円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	145,700,860円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	4,469,661円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年9月7日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	9,300	2,702.00	25,128,600	
		日本水産	266,400	454.00	120,945,600	貸付有価証券 200株
		マルハニチロ	38,500	2,336.00	89,936,000	
		カネコ種苗	8,100	1,395.00	11,299,500	
		サカタのタネ	31,800	3,475.00	110,505,000	
		ホクト	20,300	2,152.00	43,685,600	貸付有価証券 3,900株(1,300株)
		ホクリヨウ	4,100	648.00	2,656,800	
		住石ホールディングス	53,800	118.00	6,348,400	貸付有価証券 200株
		日鉄鉱業	6,100	4,210.00	25,681,000	
		三井松島ホールディングス	10,300	764.00	7,869,200	
		国際石油開発帝石	979,500	640.10	626,977,950	貸付有価証券 444,400株
		石油資源開発	34,800	1,801.00	62,674,800	
		K&Oエナジーグループ	12,900	1,514.00	19,530,600	貸付有価証券 100株
		ヒノキヤグループ	6,600	1,749.00	11,543,400	
		ショーボンドホールディングス	41,500	5,080.00	210,820,000	貸付有価証券 1,300株
		ミライト・ホールディングス	79,200	1,506.00	119,275,200	
タマホーム	14,300	1,272.00	18,189,600	貸付有価証券 6,100株(500株)		

サンヨーホームズ	2,300	636.00	1,462,800	
日本アクア	10,600	622.00	6,593,200	貸付有価証券 2,200株
ファーストコーポレーション	8,100	619.00	5,013,900	
ベストセラ	4,600	983.00	4,521,800	貸付有価証券 2,100株（1,200株）
TATERU	49,400	175.00	8,645,000	貸付有価証券 200株
キャンディル	4,400	749.00	3,295,600	貸付有価証券 400株（400株）
スペースバリューホールディングス	32,500	385.00	12,512,500	
ダイセキ環境ソリューション	5,100	682.00	3,478,200	
第一カッター興業	3,300	2,218.00	7,319,400	
明豊ファシリティワークス	8,600	650.00	5,590,000	
安藤・間	158,600	706.00	111,971,600	
東急建設	78,000	477.00	37,206,000	
コムシスホールディングス	94,400	2,842.00	268,284,800	貸付有価証券 1,300株
ピーアールホールディングス	29,000	710.00	20,590,000	貸付有価証券 200株
高松コンストラクショングループ	16,600	2,208.00	36,652,800	
東建コーポレーション	8,200	7,020.00	57,564,000	
ソネック	2,700	845.00	2,281,500	貸付有価証券 1,200株
ヤマウラ	11,600	815.00	9,454,000	貸付有価証券 500株
大成建設	205,100	3,595.00	737,334,500	
大林組	615,100	998.00	613,869,800	
清水建設	624,200	798.00	498,111,600	貸付有価証券 300株
飛島建設	17,600	1,070.00	18,832,000	
長谷工コーポレーション	238,100	1,443.00	343,578,300	貸付有価証券 12,700株
松井建設	24,200	670.00	16,214,000	
銭高組	2,700	3,645.00	9,841,500	
鹿島建設	482,900	1,299.00	627,287,100	貸付有価証券

				100株
不動テトラ	16,100	1,469.00	23,650,900	
大末建設	7,100	883.00	6,269,300	
鉄建建設	13,400	2,026.00	27,148,400	
西松建設	47,400	1,987.00	94,183,800	
三井住友建設	148,600	427.00	63,452,200	
大豊建設	13,800	2,806.00	38,722,800	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
前田建設工業	154,100	729.00	112,338,900	
佐田建設	13,200	419.00	5,530,800	
ナカノフドー建設	16,800	373.00	6,266,400	
奥村組	29,000	2,487.00	72,123,000	
東鉄工業	26,400	2,649.00	69,933,600	
イチケン	4,400	1,562.00	6,872,800	
富士ピー・エス	9,100	634.00	5,769,400	貸付有価証券 1,500株
浅沼組	6,900	4,265.00	29,428,500	
戸田建設	255,400	676.00	172,650,400	貸付有価証券 8,900株
熊谷組	28,500	2,656.00	75,696,000	
北野建設	3,700	2,488.00	9,205,600	
植木組	2,700	2,639.00	7,125,300	貸付有価証券 1,200株
矢作建設工業	27,200	852.00	23,174,400	
ピーエス三菱	20,200	590.00	11,918,000	貸付有価証券 200株
日本ハウスホールディングス	42,000	264.00	11,088,000	
大東建託	67,100	9,404.00	631,008,400	
新日本建設	26,200	843.00	22,086,600	
N I P P O	50,900	2,709.00	137,888,100	
東亜道路工業	3,800	3,350.00	12,730,000	
前田道路	54,300	1,932.00	104,907,600	
日本道路	5,900	7,500.00	44,250,000	
東亜建設工業	19,200	1,612.00	30,950,400	貸付有価証券 7,500株(2,700株)
日本国土開発	59,800	593.00	35,461,400	
若築建設	11,100	1,198.00	13,297,800	

東洋建設	69,000	400.00	27,600,000	
五洋建設	243,800	685.00	167,003,000	貸付有価証券 5,500株
世紀東急工業	29,500	803.00	23,688,500	
福田組	7,100	4,880.00	34,648,000	
住友林業	155,800	1,652.00	257,381,600	貸付有価証券 4,500株
日本基礎技術	20,700	421.00	8,714,700	
巴コーポレーション	27,300	351.00	9,582,300	
大和ハウス工業	608,600	2,837.00	1,726,598,200	
ライト工業	35,200	1,591.00	56,003,200	貸付有価証券 100株
積水ハウス	667,100	2,052.00	1,368,889,200	貸付有価証券 56,800株
日特建設	16,000	790.00	12,640,000	
北陸電気工事	10,600	1,029.00	10,907,400	
ユアテック	35,200	615.00	21,648,000	
日本リーテック	12,900	2,635.00	33,991,500	貸付有価証券 200株（200株）
四電工	3,300	2,200.00	7,260,000	
中電工	24,800	2,246.00	55,700,800	
関電工	87,500	831.00	72,712,500	貸付有価証券 100株
きんでん	146,100	1,752.00	255,967,200	
東京エネシス	20,400	735.00	14,994,000	
トーエネック	6,200	3,525.00	21,855,000	
住友電設	17,400	2,285.00	39,759,000	
日本電設工業	33,700	2,150.00	72,455,000	
協和エクシオ	93,300	2,650.00	247,245,000	貸付有価証券 700株
新日本空調	16,300	2,017.00	32,877,100	
九電工	43,200	2,988.00	129,081,600	
三機工業	44,300	1,165.00	51,609,500	
日揮ホールディングス	189,400	1,136.00	215,158,400	貸付有価証券 2,800株
中外炉工業	6,600	1,468.00	9,688,800	
ヤマト	19,700	637.00	12,548,900	
太平電業	14,900	2,215.00	33,003,500	

高砂熱学工業	51,800	1,496.00	77,492,800	
三晃金属工業	2,700	2,045.00	5,521,500	
朝日工業社	4,100	2,767.00	11,344,700	
明星工業	39,800	790.00	31,442,000	
大気社	29,900	2,877.00	86,022,300	
ダイダン	14,700	2,591.00	38,087,700	
日比谷総合設備	19,800	1,750.00	34,650,000	
フィル・カンパニー	3,500	1,847.00	6,464,500	貸付有価証券 1,000株（800株）
OSJBホールディングス	97,000	236.00	22,892,000	貸付有価証券 13,400株
レイズネクスト	33,000	1,268.00	41,844,000	貸付有価証券 3,300株
日本製粉	57,600	1,658.00	95,500,800	
日清製粉グループ本社	222,400	1,666.00	370,518,400	貸付有価証券 3,500株
日東富士製粉	1,400	6,080.00	8,512,000	
昭和産業	18,100	3,480.00	62,988,000	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
鳥越製粉	17,400	936.00	16,286,400	
中部飼料	24,000	1,583.00	37,992,000	
フィード・ワン	132,200	181.00	23,928,200	
東洋精糖	3,300	1,246.00	4,111,800	
日本甜菜製糖	10,300	1,755.00	18,076,500	
三井製糖	17,300	1,906.00	32,973,800	
塩水港精糖	21,300	224.00	4,771,200	貸付有価証券 9,500株
日新製糖	9,300	1,789.00	16,637,700	
森永製菓	46,200	3,845.00	177,639,000	
中村屋	5,100	3,895.00	19,864,500	
江崎グリコ	54,200	4,485.00	243,087,000	貸付有価証券 200株
名糖産業	9,500	1,495.00	14,202,500	貸付有価証券 4,400株
井村屋グループ	11,200	2,204.00	24,684,800	
不二家	12,600	2,247.00	28,312,200	
山崎製パン	147,600	1,714.00	252,986,400	
第一屋製パン	3,800	982.00	3,731,600	

モロゾフ	3,400	5,390.00	18,326,000	
亀田製菓	11,200	5,110.00	57,232,000	
寿スピリッツ	19,000	4,740.00	90,060,000	貸付有価証券 1,300株
カルビー	89,700	3,270.00	293,319,000	
森永乳業	36,400	5,020.00	182,728,000	
六甲バター	13,100	1,725.00	22,597,500	
ヤクルト本社	135,400	5,610.00	759,594,000	
明治ホールディングス	130,200	7,970.00	1,037,694,000	貸付有価証券 13,400株
雪印メグミルク	47,400	2,279.00	108,024,600	
プリマハム	30,800	2,972.00	91,537,600	
日本ハム	75,200	4,700.00	353,440,000	
林兼産業	6,500	570.00	3,705,000	
丸大食品	21,000	1,855.00	38,955,000	
S Foods	15,700	2,849.00	44,729,300	
柿安本店	6,800	2,496.00	16,972,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	126,800	680.00	86,224,000	
サッポロホールディングス	67,200	1,814.00	121,900,800	貸付有価証券 3,800株
アサヒグループホールディングス	412,300	3,461.00	1,426,970,300	貸付有価証券 168,700株（9,000株）
キリンホールディングス	834,900	2,004.50	1,673,557,050	貸付有価証券 41,000株
宝ホールディングス	145,900	1,017.00	148,380,300	貸付有価証券 100株
オエノンホールディングス	55,900	413.00	23,086,700	
養命酒製造	6,000	1,801.00	10,806,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	150,700	1,749.00	263,574,300	
サントリー食品インターナショナル	131,700	3,805.00	501,118,500	貸付有価証券 13,400株
ダイドーグループホールディングス	10,100	5,010.00	50,601,000	貸付有価証券 4,300株（3,800株）
伊藤園	59,800	6,410.00	383,318,000	貸付有価証券 8,800株
キーコーヒー	19,300	2,178.00	42,035,400	
ユニカフェ	5,900	970.00	5,723,000	

ジャパンフーズ	2,800	1,220.00	3,416,000	
日清オイリオグループ	25,300	3,115.00	78,809,500	
不二製油グループ本社	48,000	3,045.00	146,160,000	貸付有価証券 700株
かどや製油	2,100	3,590.00	7,539,000	
J - オイルミルズ	10,200	3,735.00	38,097,000	
キッコーマン	141,700	5,740.00	813,358,000	貸付有価証券 8,800株
味の素	434,700	1,978.50	860,053,950	貸付有価証券 1,600株
キューピー	109,600	1,996.00	218,761,600	
ハウス食品グループ本社	73,600	3,460.00	254,656,000	
カゴメ	80,500	3,275.00	263,637,500	
焼津水産化学工業	9,500	918.00	8,721,000	
アリアケジャパン	18,000	7,330.00	131,940,000	
ピエトロ	2,600	1,690.00	4,394,000	
エバラ食品工業	4,800	2,241.00	10,756,800	
やまみ	1,700	2,070.00	3,519,000	
ニチレイ	93,700	2,704.00	253,364,800	
東洋水産	101,300	5,690.00	576,397,000	
イートアンド	6,800	1,901.00	12,926,800	貸付有価証券 3,100株
大冷	2,600	2,255.00	5,863,000	貸付有価証券 1,100株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,900	937.00	10,213,300	貸付有価証券 5,100株
日清食品ホールディングス	83,700	10,180.00	852,066,000	
永谷園ホールディングス	9,600	2,235.00	21,456,000	
一正蒲鉾	7,600	1,021.00	7,759,600	
フジッコ	21,300	1,997.00	42,536,100	
ロック・フィールド	21,200	1,316.00	27,899,200	貸付有価証券 9,900株
日本たばこ産業	1,055,500	1,963.50	2,072,474,250	貸付有価証券 431,100株
ケンコーマヨネーズ	11,000	1,774.00	19,514,000	
わらべや日洋ホールディングス	12,900	1,476.00	19,040,400	
なとり	11,000	1,856.00	20,416,000	貸付有価証券

				4,200株
イフジ産業	3,400	874.00	2,971,600	
ピククルスコーポレーション	4,300	2,576.00	11,076,800	
北の達人コーポレーション	68,700	537.00	36,891,900	貸付有価証券 32,100株(25,200株)
ユーグレナ	85,100	799.00	67,994,900	貸付有価証券 14,100株(2,800株)
ミヨシ油脂	6,900	1,141.00	7,872,900	
理研ビタミン	18,600	2,095.00	38,967,000	
片倉工業	25,700	1,199.00	30,814,300	
グンゼ	14,100	3,815.00	53,791,500	
東洋紡	75,900	1,538.00	116,734,200	
ユニチカ	56,300	376.00	21,168,800	貸付有価証券 8,600株(8,600株)
富士紡ホールディングス	9,300	3,505.00	32,596,500	
倉敷紡績	19,100	1,972.00	37,665,200	
シキボウ	10,100	975.00	9,847,500	
日本毛織	63,200	967.00	61,114,400	
ダイトウボウ	31,100	111.00	3,452,100	貸付有価証券 14,600株
トーア紡コーポレーション	7,600	465.00	3,534,000	
ダイドーリミテッド	25,300	199.00	5,034,700	貸付有価証券 100株
帝国繊維	21,700	2,619.00	56,832,300	
帝人	156,700	1,661.00	260,278,700	
東レ	1,390,900	501.50	697,536,350	貸付有価証券 400株
サカイオーベックス	5,100	1,945.00	9,919,500	
住江織物	4,200	1,766.00	7,417,200	
日本フェルト	10,900	469.00	5,112,100	貸付有価証券 4,800株
イチカワ	2,700	1,288.00	3,477,600	
日東製網	2,200	1,416.00	3,115,200	
アツギ	15,800	509.00	8,042,200	
ダイニック	7,300	780.00	5,694,000	
セーレン	47,200	1,554.00	73,348,800	
ソトー	7,600	954.00	7,250,400	

東海染工	2,600	1,130.00	2,938,000	
小松マテーレ	31,500	793.00	24,979,500	
ワコールホールディングス	47,900	1,842.00	88,231,800	
ホギメディカル	21,900	3,280.00	71,832,000	
クラウディアホールディングス	4,700	300.00	1,410,000	
T S Iホールディングス	58,300	310.00	18,073,000	貸付有価証券 400株
マツオカコーポレーション	5,500	2,071.00	11,390,500	貸付有価証券 800株（800株）
ワールド	27,200	1,509.00	41,044,800	
三陽商会	10,000	601.00	6,010,000	貸付有価証券 4,700株（100株）
ナイガイ	7,000	370.00	2,590,000	
オンワードホールディングス	115,400	271.00	31,273,400	
ルックホールディングス	6,600	848.00	5,596,800	
ゴールドウイン	34,800	7,790.00	271,092,000	貸付有価証券 1,600株
デサント	37,500	1,857.00	69,637,500	
キング	9,100	557.00	5,068,700	
ヤマトインターナショナル	16,900	340.00	5,746,000	貸付有価証券 100株
特種東海製紙	11,800	4,415.00	52,097,000	
王子ホールディングス	803,000	487.00	391,061,000	貸付有価証券 200株
日本製紙	85,000	1,321.00	112,285,000	貸付有価証券 2,500株
三菱製紙	21,800	347.00	7,564,600	
北越コーポレーション	114,500	364.00	41,678,000	
中越パルプ工業	8,100	1,446.00	11,712,600	
巴川製紙所	5,700	804.00	4,582,800	
大王製紙	84,700	1,437.00	121,713,900	貸付有価証券 14,300株
阿波製紙	5,000	470.00	2,350,000	
レンゴー	181,600	783.00	142,192,800	貸付有価証券 2,400株
トーモク	11,800	1,724.00	20,343,200	
ザ・パック	14,500	2,805.00	40,672,500	

クラレ	302,500	1,096.00	331,540,000	貸付有価証券 107,700株
旭化成	1,273,300	928.20	1,181,877,060	貸付有価証券 1,400株
共和レザー	10,400	565.00	5,876,000	
昭和電工	145,900	2,008.00	292,967,200	貸付有価証券 21,100株
住友化学	1,411,300	360.00	508,068,000	貸付有価証券 1,400株
住友精化	8,500	3,375.00	28,687,500	
日産化学	106,700	5,560.00	593,252,000	貸付有価証券 400株
ラサ工業	6,800	1,668.00	11,342,400	
クレハ	16,500	4,615.00	76,147,500	
多木化学	7,500	5,960.00	44,700,000	貸付有価証券 3,000株
テイカ	14,100	1,397.00	19,697,700	
石原産業	34,400	757.00	26,040,800	
片倉コープアグリ	5,000	1,216.00	6,080,000	
日本曹達	28,400	3,035.00	86,194,000	
東ソー	296,900	1,667.00	494,932,300	貸付有価証券 100株
トクヤマ	55,400	2,567.00	142,211,800	貸付有価証券 100株
セントラル硝子	39,300	2,111.00	82,962,300	
東亜合成	120,600	1,056.00	127,353,600	
大阪ソーダ	19,500	2,542.00	49,569,000	
関東電化工業	45,600	757.00	34,519,200	
デンカ	70,100	3,095.00	216,959,500	貸付有価証券 700株
信越化学工業	329,800	13,490.00	4,449,002,000	
日本カーバイド工業	6,800	1,195.00	8,126,000	
堺化学工業	12,400	1,994.00	24,725,600	
第一稀元素化学工業	20,800	779.00	16,203,200	
エア・ウォーター	178,700	1,459.00	260,723,300	貸付有価証券 600株
大陽日酸	184,600	1,769.00	326,557,400	
日本化学工業	6,000	2,255.00	13,530,000	
東邦アセチレン	2,900	1,260.00	3,654,000	

日本パーカライジング	96,900	982.00	95,155,800	
高圧ガス工業	30,500	796.00	24,278,000	
チタン工業	2,400	1,710.00	4,104,000	貸付有価証券 700株
四国化成工業	28,100	1,119.00	31,443,900	
戸田工業	4,500	2,471.00	11,119,500	
ステラ ケミファ	10,500	2,863.00	30,061,500	
保土谷化学工業	7,200	4,875.00	35,100,000	
日本触媒	29,800	5,640.00	168,072,000	貸付有価証券 8,200株（1,600株）
大日精化工業	17,000	2,201.00	37,417,000	
カネカ	49,700	2,823.00	140,303,100	
三菱瓦斯化学	178,700	1,925.00	343,997,500	
三井化学	178,200	2,636.00	469,735,200	
J S R	179,000	2,401.00	429,779,000	
東京応化工業	33,000	5,040.00	166,320,000	貸付有価証券 2,000株
大阪有機化学工業	17,700	2,397.00	42,426,900	貸付有価証券 300株
三菱ケミカルホールディングス	1,284,200	653.50	839,224,700	貸付有価証券 63,500株
K Hネオケム	31,700	2,396.00	75,953,200	貸付有価証券 100株
ダイセル	250,100	787.00	196,828,700	貸付有価証券 800株
住友ベークライト	30,200	3,010.00	90,902,000	
積水化学工業	406,200	1,685.00	684,447,000	貸付有価証券 500株
日本ゼオン	173,200	1,159.00	200,738,800	
アイカ工業	57,600	3,630.00	209,088,000	貸付有価証券 300株
宇部興産	97,000	1,918.00	186,046,000	
積水樹脂	34,600	2,137.00	73,940,200	
タキロンシーアイ	41,600	695.00	28,912,000	
旭有機材	10,900	1,252.00	13,646,800	
ニチバン	10,100	1,634.00	16,503,400	貸付有価証券 4,700株
リケンテクノス	48,300	387.00	18,692,100	
大倉工業	9,100	1,540.00	14,014,000	貸付有価証券

				1,300株
積水化成品工業	25,800	560.00	14,448,000	
群栄化学工業	4,400	2,321.00	10,212,400	
タイガースポリマー	10,100	418.00	4,221,800	
ミライアル	6,800	1,001.00	6,806,800	
ダイキアクシス	6,800	843.00	5,732,400	
ダイキョーニシカワ	40,500	572.00	23,166,000	
竹本容器	6,900	969.00	6,686,100	
森六ホールディングス	10,300	1,690.00	17,407,000	
日本化薬	118,900	979.00	116,403,100	貸付有価証券 55,800株(6,100株)
カーリットホールディングス	20,500	488.00	10,004,000	貸付有価証券 9,200株
日本精化	15,500	1,502.00	23,281,000	
扶桑化学工業	19,500	3,550.00	69,225,000	貸付有価証券 3,800株
トリケミカル研究所	4,300	10,100.00	43,430,000	貸付有価証券 100株
A D E K A	88,400	1,536.00	135,782,400	
日油	72,300	4,060.00	293,538,000	
新日本理化学	31,800	159.00	5,056,200	
ハリマ化成グループ	15,900	955.00	15,184,500	
花王	469,600	7,860.00	3,691,056,000	貸付有価証券 19,600株
第一工業製薬	7,200	4,235.00	30,492,000	
石原ケミカル	5,200	2,037.00	10,592,400	貸付有価証券 2,400株
日華化学	6,500	866.00	5,629,000	
ニイタカ	4,000	2,997.00	11,988,000	貸付有価証券 100株(100株)
三洋化成工業	11,500	4,955.00	56,982,500	
有機合成薬品工業	14,700	334.00	4,909,800	貸付有価証券 6,900株(100株)
大日本塗料	21,700	880.00	19,096,000	貸付有価証券 100株
日本ペイントホールディングス	158,500	9,060.00	1,436,010,000	貸付有価証券 13,200株(6,600株)
関西ペイント	215,800	2,575.00	555,685,000	貸付有価証券 800株
神東塗料	15,100	186.00	2,808,600	

中国塗料	54,700	1,005.00	54,973,500	
日本特殊塗料	14,400	956.00	13,766,400	
藤倉化成	25,900	522.00	13,519,800	
太陽ホールディングス	14,100	5,440.00	76,704,000	
D I C	81,100	2,512.00	203,723,200	貸付有価証券 1,700株
サカタインクス	41,900	1,028.00	43,073,200	貸付有価証券 1,400株
東洋インキ S C ホール ディングス	40,600	1,906.00	77,383,600	貸付有価証券 4,500株
T & K T O K A	14,900	778.00	11,592,200	
富士フイルムホールディ ングス	376,100	4,985.00	1,874,858,500	貸付有価証券 200株
資生堂	389,700	6,013.00	2,343,266,100	貸付有価証券 20,800株
ライオン	255,000	2,195.00	559,725,000	貸付有価証券 300株
高砂香料工業	12,300	2,037.00	25,055,100	
マンダム	44,100	1,775.00	78,277,500	
ミルボン	26,200	5,630.00	147,506,000	貸付有価証券 100株
ファンケル	79,400	3,560.00	282,664,000	貸付有価証券 1,200株
コーセー	36,900	12,230.00	451,287,000	
コタ	11,300	1,220.00	13,786,000	
シーボン	2,500	1,854.00	4,635,000	
ポーラ・オルビスホール ディングス	83,700	1,945.00	162,796,500	貸付有価証券 24,700株（1,100株）
ノエビアホールディング ス	16,600	5,030.00	83,498,000	貸付有価証券 7,800株
アジュバンコスメジャパ ン	4,400	972.00	4,276,800	
エステー	12,600	2,041.00	25,716,600	
アグロ カネショウ	7,300	1,547.00	11,293,100	
コニシ	32,200	1,450.00	46,690,000	
長谷川香料	33,800	2,069.00	69,932,200	
星光 P M C	11,200	643.00	7,201,600	
小林製薬	55,000	9,370.00	515,350,000	貸付有価証券 100株

荒川化学工業	17,600	1,219.00	21,454,400	
メック	13,400	1,790.00	23,986,000	貸付有価証券 700株
日本高純度化学	5,400	2,582.00	13,942,800	
タカラバイオ	51,300	2,796.00	143,434,800	貸付有価証券 16,100株（1,000株）
J C U	23,700	3,370.00	79,869,000	
新田ゼラチン	12,300	681.00	8,376,300	
O A T アグリオ	3,700	1,128.00	4,173,600	
デクセリアルズ	50,700	1,079.00	54,705,300	
アース製薬	13,600	7,740.00	105,264,000	
北興化学工業	18,300	699.00	12,791,700	
大成ラミック	6,400	2,725.00	17,440,000	
クマイ化学工業	81,100	979.00	79,396,900	貸付有価証券 6,800株
日本農薬	34,900	502.00	17,519,800	
アキレス	13,500	1,744.00	23,544,000	
有沢製作所	31,000	931.00	28,861,000	貸付有価証券 500株
日東電工	135,300	6,490.00	878,097,000	貸付有価証券 2,300株
レック	20,900	1,582.00	33,063,800	
三光合成	22,400	265.00	5,936,000	
きもと	33,400	160.00	5,344,000	
藤森工業	17,600	3,925.00	69,080,000	
前澤化成工業	12,500	1,050.00	13,125,000	貸付有価証券 5,800株
未来工業	10,500	1,920.00	20,160,000	
ウェーブロックホールディングス	6,800	768.00	5,222,400	
J S P	11,500	1,600.00	18,400,000	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	21,600	7,970.00	172,152,000	
天馬	13,100	1,951.00	25,558,100	
信越ポリマー	35,200	878.00	30,905,600	
東リ	48,800	242.00	11,809,600	
ニフコ	72,000	2,869.00	206,568,000	
バルカー	15,900	1,860.00	29,574,000	
ユニ・チャーム	415,900	4,456.00	1,853,250,400	貸付有価証券

				17,500株(6,500株)
ショーエイコーポレーション	2,900	1,193.00	3,459,700	貸付有価証券 1,300株
協和キリン	197,300	2,809.00	554,215,700	貸付有価証券 8,400株
武田薬品工業	1,631,900	3,800.00	6,201,220,000	貸付有価証券 500株
アステラス製薬	1,700,600	1,618.50	2,752,421,100	貸付有価証券 12,200株
大日本住友製薬	145,400	1,295.00	188,293,000	貸付有価証券 200株
塩野義製薬	246,700	5,777.00	1,425,185,900	貸付有価証券 2,200株
わかもと製薬	23,300	251.00	5,848,300	
あすか製薬	22,300	1,175.00	26,202,500	
日本新薬	51,300	8,340.00	427,842,000	
ビオフェルミン製薬	3,300	2,386.00	7,873,800	
中外製薬	613,500	4,708.00	2,888,358,000	貸付有価証券 118,300株(300株)
科研製薬	33,600	4,825.00	162,120,000	貸付有価証券 300株
エーザイ	234,800	9,405.00	2,208,294,000	
ロート製薬	100,700	3,440.00	346,408,000	
小野薬品工業	450,400	3,139.00	1,413,805,600	
久光製薬	51,900	4,825.00	250,417,500	貸付有価証券 2,900株
持田製薬	27,200	3,850.00	104,720,000	
参天製薬	365,500	1,958.00	715,649,000	
扶桑薬品工業	6,900	2,694.00	18,588,600	
日本ケミファ	2,600	2,470.00	6,422,000	
ツムラ	60,800	2,904.00	176,563,200	
日医工	55,600	1,190.00	66,164,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
キッセイ薬品工業	34,700	2,282.00	79,185,400	
生化学工業	38,100	1,063.00	40,500,300	
栄研化学	34,500	1,957.00	67,516,500	
日水製薬	8,200	1,129.00	9,257,800	
鳥居薬品	12,300	2,813.00	34,599,900	
JCRファーマ	13,800	11,670.00	161,046,000	

東和薬品	25,100	2,062.00	51,756,200	
富士製薬工業	13,300	1,079.00	14,350,700	
沢井製薬	40,300	5,480.00	220,844,000	
ゼリア新薬工業	35,600	1,960.00	69,776,000	貸付有価証券 100株
第一三共	561,300	9,294.00	5,216,722,200	貸付有価証券 800株
キョーリン製薬ホールディングス	43,300	2,061.00	89,241,300	
大幸薬品	24,100	2,485.00	59,888,500	貸付有価証券 400株
ダイト	12,300	3,375.00	41,512,500	
大塚ホールディングス	407,600	4,454.00	1,815,450,400	貸付有価証券 34,700株
大正製薬ホールディングス	41,500	6,450.00	267,675,000	
ペプチドリーム	99,700	4,235.00	422,229,500	貸付有価証券 13,400株
日本コークス工業	165,700	61.00	10,107,700	貸付有価証券 800株
ニチレキ	23,200	1,612.00	37,398,400	
ユシロ化学工業	11,000	1,245.00	13,695,000	
ピーピー・カストロール	7,000	1,179.00	8,253,000	
富士石油	52,400	185.00	9,694,000	
MORESCO	7,100	921.00	6,539,100	
出光興産	217,700	2,318.00	504,628,600	
ENEOSホールディングス	2,950,700	408.20	1,204,475,740	貸付有価証券 300株
コスモエネルギーホールディングス	56,800	1,601.00	90,936,800	
横浜ゴム	113,600	1,731.00	196,641,600	貸付有価証券 8,000株
TOYO TIRE	103,200	1,799.00	185,656,800	貸付有価証券 12,600株
ブリヂストン	521,500	3,368.00	1,756,412,000	貸付有価証券 109,600株
住友ゴム工業	176,200	1,020.00	179,724,000	貸付有価証券 1,100株
藤倉コンポジット	17,100	355.00	6,070,500	
オカモト	11,900	4,135.00	49,206,500	

フコク	8,600	636.00	5,469,600	貸付有価証券 1,300株
ニッタ	22,100	2,265.00	50,056,500	
住友理工	38,000	557.00	21,166,000	
三ツ星ベルト	25,800	1,648.00	42,518,400	
バンドー化学	34,500	584.00	20,148,000	
日東紡績	29,200	4,090.00	119,428,000	貸付有価証券 12,400株
A G C	180,100	3,015.00	543,001,500	貸付有価証券 30,600株
日本板硝子	93,800	413.00	38,739,400	貸付有価証券 24,600株（10,100株）
石塚硝子	3,600	1,853.00	6,670,800	
日本山村硝子	8,100	871.00	7,055,100	
日本電気硝子	72,700	2,026.00	147,290,200	貸付有価証券 24,100株
オハラ	7,700	1,014.00	7,807,800	貸付有価証券 400株（300株）
住友大阪セメント	37,100	3,510.00	130,221,000	貸付有価証券 200株
太平洋セメント	123,900	2,834.00	351,132,600	
日本ヒューム	19,700	780.00	15,366,000	
日本コンクリート工業	42,200	299.00	12,617,800	
三谷セキサン	9,100	5,690.00	51,779,000	
アジアパイルホールディ ングス	27,800	474.00	13,177,200	
東海カーボン	191,800	1,036.00	198,704,800	貸付有価証券 76,200株（10,000株）
日本カーボン	10,800	3,535.00	38,178,000	貸付有価証券 100株
東洋炭素	11,500	1,685.00	19,377,500	
ノリタケカンパニーリミ テド	10,800	3,270.00	35,316,000	
T O T O	140,100	4,740.00	664,074,000	貸付有価証券 1,600株
日本碍子	235,500	1,519.00	357,724,500	貸付有価証券 600株
日本特殊陶業	149,200	1,869.00	278,854,800	
ダントーホールディング ス	14,600	321.00	4,686,600	貸付有価証券 6,800株

MARUWA	7,500	9,170.00	68,775,000	
品川リフレクトリーズ	5,200	2,298.00	11,949,600	
黒崎播磨	3,900	3,120.00	12,168,000	
ヨータイ	15,600	706.00	11,013,600	
イソライト工業	10,100	436.00	4,403,600	
東京窯業	24,900	345.00	8,590,500	
ニッカトー	8,900	631.00	5,615,900	貸付有価証券 2,100株
フジインコーポレー テッド	17,500	3,465.00	60,637,500	
クニミネ工業	7,900	976.00	7,710,400	
エーアンドエーマテリア ル	3,300	1,039.00	3,428,700	
ニチアス	53,700	2,441.00	131,081,700	
ニチハ	27,300	2,657.00	72,536,100	
日本製鉄	868,100	1,108.00	961,854,800	貸付有価証券 11,100株
神戸製鋼所	355,000	428.00	151,940,000	貸付有価証券 12,000株
中山製鋼所	26,900	346.00	9,307,400	
合同製鐵	10,400	2,042.00	21,236,800	貸付有価証券 100株
ジェイ エフ イー ホールディングス	523,800	851.00	445,753,800	
東京製鐵	94,400	719.00	67,873,600	貸付有価証券 1,400株
共英製鋼	21,900	1,310.00	28,689,000	貸付有価証券 9,800株
大和工業	41,200	2,591.00	106,749,200	
東京鐵鋼	8,000	1,557.00	12,456,000	貸付有価証券 1,400株
大阪製鐵	10,300	1,042.00	10,732,600	
淀川製鋼所	26,200	1,847.00	48,391,400	
丸一鋼管	63,000	2,805.00	176,715,000	
モリ工業	5,800	2,212.00	12,829,600	
大同特殊鋼	31,800	3,390.00	107,802,000	
日本高周波鋼業	7,200	337.00	2,426,400	
日本冶金工業	16,000	1,563.00	25,008,000	貸付有価証券 200株

山陽特殊製鋼	13,300	942.00	12,528,600	
愛知製鋼	10,900	2,536.00	27,642,400	
日立金属	208,900	1,634.00	341,342,600	貸付有価証券 29,400株
日本金属	4,500	623.00	2,803,500	貸付有価証券 2,100株
大平洋金属	13,100	1,819.00	23,828,900	貸付有価証券 1,000株
新日本電工	125,100	211.00	26,396,100	
栗本鐵工所	9,600	1,844.00	17,702,400	
虹技	2,900	1,302.00	3,775,800	
日本鑄鉄管	2,000	1,200.00	2,400,000	
三菱製鋼	14,400	560.00	8,064,000	
日亜鋼業	28,400	272.00	7,724,800	
日本精線	3,200	3,300.00	10,560,000	
エンビプロ・ホールディングス	8,200	543.00	4,452,600	貸付有価証券 100株（100株）
シンニッタン	30,100	213.00	6,411,300	貸付有価証券 100株
新家工業	4,400	1,040.00	4,576,000	
大紀アルミニウム工業所	31,900	543.00	17,321,700	
日本軽金属ホールディングス	490,800	191.00	93,742,800	貸付有価証券 4,600株
三井金属鉱業	52,300	2,711.00	141,785,300	貸付有価証券 2,200株
東邦亜鉛	9,900	1,992.00	19,720,800	
三菱マテリアル	128,100	2,263.00	289,890,300	
住友金属鉱山	247,900	3,444.00	853,767,600	貸付有価証券 100株
DOWAホールディングス	49,100	3,345.00	164,239,500	
古河機械金属	34,500	1,087.00	37,501,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,200	965.00	19,493,000	貸付有価証券 3,700株（300株）
東邦チタニウム	34,700	708.00	24,567,600	貸付有価証券 13,200株（9,000株）
UACJ	29,400	2,058.00	60,505,200	
CKサンエツ	4,000	3,295.00	13,180,000	
古河電気工業	60,200	2,498.00	150,379,600	貸付有価証券

				200株
住友電気工業	725,200	1,233.50	894,534,200	貸付有価証券 200株
フジクラ	234,200	309.00	72,367,800	貸付有価証券 5,200株
昭和電線ホールディングス	22,500	1,105.00	24,862,500	
東京特殊電線	2,900	2,300.00	6,670,000	
タツタ電線	38,500	617.00	23,754,500	
カナレ電気	3,200	1,640.00	5,248,000	
平河ヒューテック	9,700	932.00	9,040,400	
リョービ	23,900	1,171.00	27,986,900	
アーレスティ	25,400	332.00	8,432,800	
アサヒホールディングス	34,000	3,515.00	119,510,000	
稲葉製作所	10,900	1,323.00	14,420,700	
宮地エンジニアリンググループ	5,900	1,600.00	9,440,000	貸付有価証券 200株
トーカロ	53,900	1,063.00	57,295,700	
アルファC o	6,800	929.00	6,317,200	
SUMCO	248,200	1,415.00	351,203,000	貸付有価証券 115,600株
川田テクノロジーズ	4,000	4,925.00	19,700,000	
RS Technologies	6,300	3,150.00	19,845,000	
信和	11,200	700.00	7,840,000	
東洋製罐グループホールディングス	123,500	1,167.00	144,124,500	貸付有価証券 1,400株
ホッカンホールディングス	10,700	1,472.00	15,750,400	
コロナ	10,700	1,011.00	10,817,700	
横河ブリッジホールディングス	36,100	1,930.00	69,673,000	
駒井ハルテック	3,600	1,428.00	5,140,800	
高田機工	1,800	2,411.00	4,339,800	
三和ホールディングス	182,900	1,140.00	208,506,000	
文化シャッター	57,200	755.00	43,186,000	
三協立山	25,000	931.00	23,275,000	
アルインコ	14,100	918.00	12,943,800	
東洋シャッター	4,700	739.00	3,473,300	

LIXILグループ	286,200	1,979.00	566,389,800	貸付有価証券 7,900株（4,700株）
日本ファイルコン	13,500	550.00	7,425,000	
ノーリツ	40,200	1,341.00	53,908,200	
長府製作所	19,700	2,067.00	40,719,900	
リンナイ	37,700	9,510.00	358,527,000	
ダイニチ工業	10,400	687.00	7,144,800	
日東精工	24,300	441.00	10,716,300	
三洋工業	2,600	1,918.00	4,986,800	
岡部	39,300	789.00	31,007,700	貸付有価証券 4,300株
ジーテクト	24,100	1,255.00	30,245,500	
東プレ	36,200	1,226.00	44,381,200	
高周波熱錬	37,300	502.00	18,724,600	貸付有価証券 16,700株
東京製綱	13,900	530.00	7,367,000	
サンコール	14,500	431.00	6,249,500	貸付有価証券 100株
モリテック スチール	15,100	285.00	4,303,500	
パイオラックス	28,700	1,584.00	45,460,800	
エイチワン	19,000	552.00	10,488,000	
日本発條	208,100	685.00	142,548,500	
中央発條	2,300	2,660.00	6,118,000	
アドバネクス	2,800	1,397.00	3,911,600	
立川ブラインド工業	8,500	1,226.00	10,421,000	
三益半導体工業	15,100	2,140.00	32,314,000	
日本ドライケミカル	4,800	1,537.00	7,377,600	貸付有価証券 2,200株
日本製鋼所	58,800	1,537.00	90,375,600	
三浦工業	83,900	4,210.00	353,219,000	貸付有価証券 100株
タクマ	65,700	1,657.00	108,864,900	
ツガミ	40,200	1,180.00	47,436,000	貸付有価証券 13,700株
オークマ	22,600	5,250.00	118,650,000	
芝浦機械	21,900	2,185.00	47,851,500	
アマダ	240,600	989.00	237,953,400	貸付有価証券 100株

アイダエンジニアリング	50,700	695.00	35,236,500	
滝澤鉄工所	6,000	1,011.00	6,066,000	
F U J I	83,400	1,879.00	156,708,600	貸付有価証券 14,200株（14,200株）
牧野フライス製作所	22,700	3,830.00	86,941,000	
オーエスジー	95,700	1,643.00	157,235,100	貸付有価証券 300株
ダイジェット工業	2,200	1,400.00	3,080,000	
旭ダイヤモンド工業	50,900	509.00	25,908,100	
D M G 森精機	122,700	1,510.00	185,277,000	貸付有価証券 4,300株
ソディック	42,200	733.00	30,932,600	貸付有価証券 1,400株
ディスコ	26,300	23,610.00	620,943,000	
日東工器	10,600	1,996.00	21,157,600	
日進工具	7,600	2,267.00	17,229,200	
パンチ工業	17,500	410.00	7,175,000	
富士ダイス	8,500	647.00	5,499,500	
豊和工業	10,700	828.00	8,859,600	貸付有価証券 500株
O K K	7,900	370.00	2,923,000	
東洋機械金属	13,900	402.00	5,587,800	
津田駒工業	3,700	777.00	2,874,900	
エンシュウ	4,600	920.00	4,232,000	
島精機製作所	30,500	1,552.00	47,336,000	
オプトラン	24,300	2,089.00	50,762,700	
N C ホールディングス	5,900	593.00	3,498,700	
イワキポンプ	12,300	933.00	11,475,900	
フリュー	19,000	1,036.00	19,684,000	
ヤマシンフィルタ	42,100	1,205.00	50,730,500	貸付有価証券 3,900株
日阪製作所	23,900	805.00	19,239,500	
やまびこ	37,600	1,205.00	45,308,000	
平田機工	9,200	5,820.00	53,544,000	貸付有価証券 300株
ペガサスミシン製造	19,700	283.00	5,575,100	貸付有価証券 200株
マルマエ	7,200	886.00	6,379,200	貸付有価証券 3,300株

タツモ	8,200	1,343.00	11,012,600	
ナブテスコ	114,300	3,375.00	385,762,500	貸付有価証券 100株
三井海洋開発	20,600	1,779.00	36,647,400	
レオン自動機	19,000	1,083.00	20,577,000	
S M C	61,500	57,710.00	3,549,165,000	貸付有価証券 100株
ホソカワミクロン	6,800	5,540.00	37,672,000	
ユニオンツール	7,200	2,781.00	20,023,200	
オイレス工業	25,100	1,430.00	35,893,000	
日精エー・エス・ビー機 械	5,600	4,010.00	22,456,000	
サトーホールディングス	27,600	2,032.00	56,083,200	
技研製作所	17,100	3,825.00	65,407,500	
日本エアテック	6,300	1,299.00	8,183,700	貸付有価証券 2,800株（2,100株）
カワタ	5,700	894.00	5,095,800	
日精樹脂工業	16,300	862.00	14,050,600	
オカダアイヨン	6,100	980.00	5,978,000	
ワイエイシイホールディ ングス	8,300	641.00	5,320,300	貸付有価証券 2,200株
小松製作所	888,400	2,326.50	2,066,862,600	
住友重機械工業	112,300	2,394.00	268,846,200	
日立建機	78,600	3,715.00	291,999,000	貸付有価証券 500株
日工	26,800	641.00	17,178,800	
巴工業	7,700	1,883.00	14,499,100	
井関農機	19,600	1,275.00	24,990,000	
T O W A	19,800	1,066.00	21,106,800	
丸山製作所	4,000	1,266.00	5,064,000	
北川鉄工所	8,800	1,403.00	12,346,400	
ローツェ	8,600	4,630.00	39,818,000	
タカキタ	6,800	661.00	4,494,800	貸付有価証券 3,100株
クボタ	1,040,600	1,929.00	2,007,317,400	貸付有価証券 152,000株（300株）
荏原実業	4,900	2,804.00	13,739,600	
三菱化工機	6,700	1,724.00	11,550,800	

月島機械	36,100	1,186.00	42,814,600	
帝国電機製作所	16,200	1,114.00	18,046,800	
東京機械製作所	8,000	282.00	2,256,000	
新東工業	46,500	694.00	32,271,000	貸付有価証券 21,800株
澁谷工業	17,100	3,210.00	54,891,000	
アイチ コーポレーショ ン	33,900	825.00	27,967,500	
小森コーポレーション	49,700	721.00	35,833,700	
鶴見製作所	15,100	1,834.00	27,693,400	
住友精密工業	2,900	2,295.00	6,655,500	
日本ギア工業	7,800	278.00	2,168,400	
酒井重工業	3,700	2,340.00	8,658,000	
荏原製作所	81,300	2,695.00	219,103,500	貸付有価証券 100株
石井鐵工所	2,500	2,605.00	6,512,500	
西島製作所	19,800	825.00	16,335,000	
北越工業	20,200	1,037.00	20,947,400	
ダイキン工業	249,900	19,900.00	4,973,010,000	貸付有価証券 200株
オルガノ	7,100	5,520.00	39,192,000	
トーヨーカネツ	8,500	2,237.00	19,014,500	
栗田工業	106,100	3,330.00	353,313,000	貸付有価証券 100株
椿本チエイン	28,000	2,384.00	66,752,000	
大同工業	9,300	574.00	5,338,200	
木村化工機	16,300	411.00	6,699,300	貸付有価証券 100株
アネスト岩田	30,500	820.00	25,010,000	
ダイフク	100,200	9,220.00	923,844,000	
サムコ	4,900	2,583.00	12,656,700	貸付有価証券 800株（800株）
加藤製作所	10,700	1,118.00	11,962,600	
油研工業	3,300	1,455.00	4,801,500	
タダノ	94,600	839.00	79,369,400	貸付有価証券 34,000株（900株）
フジテック	71,300	2,173.00	154,934,900	
C K D	53,800	1,495.00	80,431,000	

キトー	14,800	1,183.00	17,508,400	
平和	54,700	1,805.00	98,733,500	貸付有価証券 400株
理想科学工業	17,300	1,421.00	24,583,300	
SANKYO	43,600	2,979.00	129,884,400	貸付有価証券 300株
日本金銭機械	21,700	537.00	11,652,900	
マースグループホールディングス	12,500	1,654.00	20,675,000	
フクシマガリレイ	12,100	3,375.00	40,837,500	
オーイズミ	8,200	366.00	3,001,200	
ダイコク電機	9,000	1,025.00	9,225,000	貸付有価証券 100株
竹内製作所	32,800	2,245.00	73,636,000	貸付有価証券 100株
アマノ	51,300	2,247.00	115,271,100	
JUKI	27,300	454.00	12,394,200	
蛇の目ミシン工業	17,800	631.00	11,231,800	貸付有価証券 100株
マックス	29,900	1,575.00	47,092,500	
グローリー	50,400	2,325.00	117,180,000	
新晃工業	18,200	1,382.00	25,152,400	
大和冷機工業	31,500	895.00	28,192,500	
セガサミーホールディングス	194,500	1,196.00	232,622,000	貸付有価証券 1,200株
日本ピストンリング	7,100	1,045.00	7,419,500	
リケン	9,100	2,677.00	24,360,700	
T P R	26,400	1,366.00	36,062,400	
ツバキ・ナカシマ	37,500	898.00	33,675,000	貸付有価証券 1,100株
ホシザキ	61,700	7,980.00	492,366,000	
大豊工業	16,000	534.00	8,544,000	
日本精工	369,300	853.00	315,012,900	貸付有価証券 2,300株
NTN	453,900	210.00	95,319,000	貸付有価証券 121,800株
ジェイテクト	188,100	865.00	162,706,500	貸付有価証券 200株
不二越	18,200	3,490.00	63,518,000	

日本トムソン	58,200	378.00	21,999,600	
THK	122,300	2,553.00	312,231,900	貸付有価証券 46,000株
ユーシン精機	15,200	680.00	10,336,000	
前澤給装工業	7,100	2,095.00	14,874,500	
イーグル工業	24,200	786.00	19,021,200	
前澤工業	13,000	468.00	6,084,000	
日本ピラー工業	19,800	1,473.00	29,165,400	
キッツ	79,500	610.00	48,495,000	
マキタ	255,800	4,935.00	1,262,373,000	
日立造船	155,500	423.00	65,776,500	貸付有価証券 100株
三菱重工業	328,700	2,605.00	856,263,500	貸付有価証券 500株
IHI	141,300	1,572.00	222,123,600	
スター精密	30,200	1,349.00	40,739,800	
日清紡ホールディングス	119,900	724.00	86,807,600	貸付有価証券 1,000株
イビデン	120,100	3,485.00	418,548,500	貸付有価証券 200株
コニカミノルタ	428,500	329.00	140,976,500	貸付有価証券 100株
ブラザー工業	239,500	1,712.00	410,024,000	貸付有価証券 1,000株
ミネベアミツミ	364,100	1,881.00	684,872,100	
日立製作所	942,500	3,565.00	3,360,012,500	
三菱電機	1,961,300	1,467.50	2,878,207,750	貸付有価証券 300株
富士電機	118,200	3,385.00	400,107,000	
東洋電機製造	7,100	1,064.00	7,554,400	
安川電機	211,100	3,955.00	834,900,500	貸付有価証券 9,500株
シンフォニアテクノロ ジー	25,400	1,096.00	27,838,400	
明電舎	36,000	1,633.00	58,788,000	
オリジン	5,300	1,314.00	6,964,200	
山洋電気	9,500	4,690.00	44,555,000	
デンヨー	16,700	2,183.00	36,456,100	
東芝テック	24,600	4,545.00	111,807,000	

芝浦メカトロニクス	3,500	2,989.00	10,461,500	
マブチモーター	54,300	3,680.00	199,824,000	
日本電産	472,000	8,896.00	4,198,912,000	貸付有価証券 3,300株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,700	335.00	3,919,500	貸付有価証券 3,000株（100株）
トレックス・セミコンダクター	11,300	1,149.00	12,983,700	
東光高岳	10,900	998.00	10,878,200	
ダブル・スコープ	31,000	807.00	25,017,000	貸付有価証券 12,500株（100株）
ダイヘン	21,500	3,960.00	85,140,000	
ヤーマン	32,000	1,455.00	46,560,000	貸付有価証券 2,400株（300株）
JVCケンウッド	159,800	160.00	25,568,000	
ミマキエンジニアリング	17,600	390.00	6,864,000	
I - P E X	9,100	2,153.00	19,592,300	貸付有価証券 3,300株
日新電機	46,000	1,106.00	50,876,000	
大崎電気工業	39,000	581.00	22,659,000	
オムロン	175,800	7,920.00	1,392,336,000	貸付有価証券 700株
日東工業	28,800	1,908.00	54,950,400	
I D E C	28,300	1,826.00	51,675,800	
正興電機製作所	4,600	975.00	4,485,000	
不二電機工業	3,200	1,320.00	4,224,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	65,500	1,768.00	115,804,000	貸付有価証券 1,500株
サクサホールディングス	4,600	1,390.00	6,394,000	
メルコホールディングス	6,800	2,504.00	17,027,200	
テクノメディカ	4,400	1,748.00	7,691,200	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	4,200	524.00	2,200,800	
日本電気	237,900	5,270.00	1,253,733,000	
富士通	189,100	13,490.00	2,550,959,000	
沖電気工業	79,700	998.00	79,540,600	貸付有価証券 1,300株
岩崎通信機	8,600	836.00	7,189,600	
電気興業	9,400	2,411.00	22,663,400	

サンケン電気	21,400	2,245.00	48,043,000	
ナカヨ	3,800	1,364.00	5,183,200	
アイホン	11,100	1,337.00	14,840,700	
ルネサスエレクトロニクス	838,500	689.00	577,726,500	貸付有価証券 2,000株
セイコーエプソン	243,400	1,251.00	304,493,400	貸付有価証券 300株
ワコム	131,800	677.00	89,228,600	貸付有価証券 100株
アルバック	36,100	3,860.00	139,346,000	貸付有価証券 7,700株
アクセル	8,200	862.00	7,068,400	
E I Z O	15,200	3,870.00	58,824,000	
日本信号	49,900	1,023.00	51,047,700	
京三製作所	45,900	487.00	22,353,300	貸付有価証券 20,700株
能美防災	25,900	2,100.00	54,390,000	
ホーチキ	14,200	1,190.00	16,898,000	
星和電機	9,700	575.00	5,577,500	
エレコム	22,200	4,880.00	108,336,000	
パナソニック	2,240,900	951.50	2,132,216,350	貸付有価証券 23,600株
シャープ	227,000	1,373.00	311,671,000	貸付有価証券 86,000株
アンリツ	126,300	2,255.00	284,806,500	貸付有価証券 59,300株（500株）
富士通ゼネラル	53,200	2,861.00	152,205,200	
ソニー	1,228,700	8,198.00	10,072,882,600	貸付有価証券 15,200株
T D K	94,700	11,350.00	1,074,845,000	
帝国通信工業	8,600	1,178.00	10,130,800	
タムラ製作所	65,500	535.00	35,042,500	
アルプスアルパイン	173,600	1,652.00	286,787,200	貸付有価証券 3,300株
池上通信機	6,200	802.00	4,972,400	
日本電波工業	17,700	357.00	6,318,900	貸付有価証券 8,300株（4,700株）
鈴木	9,600	672.00	6,451,200	
日本トリム	2,600	3,815.00	9,919,000	

ローランド ディー . ジー .	11,600	1,315.00	15,254,000	貸付有価証券 500株
フォスター電機	20,600	1,200.00	24,720,000	
S M K	5,000	2,578.00	12,890,000	
ヨコオ	12,700	2,635.00	33,464,500	
ティアック	14,100	111.00	1,565,100	
ホシデン	53,600	916.00	49,097,600	貸付有価証券 2,900株
ヒロセ電機	30,200	12,270.00	370,554,000	
日本航空電子工業	45,000	1,366.00	61,470,000	
T O A	21,000	768.00	16,128,000	
マクセルホールディング ス	42,200	1,072.00	45,238,400	
古野電気	25,200	945.00	23,814,000	
ユニデンホールディング ス	5,400	1,551.00	8,375,400	
スミダコーポレーション	16,700	651.00	10,871,700	
アイコム	10,900	2,659.00	28,983,100	
リオン	8,200	2,236.00	18,335,200	
本多通信工業	16,800	435.00	7,308,000	貸付有価証券 2,200株
船井電機	19,800	491.00	9,721,800	貸付有価証券 5,000株
横河電機	179,900	1,755.00	315,724,500	貸付有価証券 1,600株
新電元工業	6,900	2,012.00	13,882,800	
アズビル	123,800	3,380.00	418,444,000	
東亜ディーケーケー	9,700	850.00	8,245,000	
日本光電工業	81,100	3,480.00	282,228,000	
チノー	6,800	1,335.00	9,078,000	
共和電業	20,500	419.00	8,589,500	
日本電子材料	7,700	2,132.00	16,416,400	貸付有価証券 1,200株
堀場製作所	38,900	5,820.00	226,398,000	
アドバンテスト	145,800	5,020.00	731,916,000	貸付有価証券 100株
小野測器	8,200	490.00	4,018,000	
エスペック	17,400	1,780.00	30,972,000	
キーエンス	177,700	43,470.00	7,724,619,000	

日置電機	9,400	3,715.00	34,921,000	
シスメックス	140,200	9,137.00	1,281,007,400	
日本マイクロニクス	34,100	1,059.00	36,111,900	貸付有価証券 2,800株
メガチップス	18,200	2,163.00	39,366,600	
O B A R A G R O U P	11,400	3,665.00	41,781,000	貸付有価証券 5,300株（4,300株）
澤藤電機	2,400	1,636.00	3,926,400	
原田工業	9,300	863.00	8,025,900	
コーセル	26,100	866.00	22,602,600	
イリソ電子工業	16,500	4,125.00	68,062,500	貸付有価証券 500株
オブテックスグループ	32,200	1,353.00	43,566,600	貸付有価証券 200株
千代田インテグレ	8,200	1,568.00	12,857,600	
アイ・オー・データ機器	6,300	1,006.00	6,337,800	
レーザーテック	86,100	7,690.00	662,109,000	
スタンレー電気	137,500	3,050.00	419,375,000	
岩崎電気	7,600	1,415.00	10,754,000	
ウシオ電機	108,300	1,359.00	147,179,700	
岡谷電機産業	15,400	328.00	5,051,200	
ヘリオス テクノ ホールディング	18,100	291.00	5,267,100	貸付有価証券 300株
エノモト	5,900	994.00	5,864,600	
日本セラミック	19,900	2,523.00	50,207,700	
遠藤照明	9,900	629.00	6,227,100	
古河電池	14,000	1,059.00	14,826,000	貸付有価証券 3,800株（400株）
双信電機	9,500	413.00	3,923,500	
山一電機	14,200	1,377.00	19,553,400	
図研	12,800	2,532.00	32,409,600	
日本電子	38,700	2,946.00	114,010,200	
カシオ計算機	173,500	1,763.00	305,880,500	貸付有価証券 19,500株
ファナック	184,400	20,640.00	3,806,016,000	貸付有価証券 100株
日本シイエムケイ	46,100	474.00	21,851,400	貸付有価証券 300株
エンプラス	10,000	2,153.00	21,530,000	

大真空	7,200	1,677.00	12,074,400	貸付有価証券 900株
ローム	81,500	7,110.00	579,465,000	
浜松ホトニクス	140,700	4,905.00	690,133,500	貸付有価証券 1,800株
三井ハイテック	21,600	1,647.00	35,575,200	貸付有価証券 2,400株（100株）
新光電気工業	65,900	1,578.00	103,990,200	
京セラ	275,900	6,115.00	1,687,128,500	貸付有価証券 1,500株
太陽誘電	87,200	2,984.00	260,204,800	貸付有価証券 1,000株
村田製作所	576,200	6,507.00	3,749,333,400	貸付有価証券 300株
双葉電子工業	31,000	852.00	26,412,000	
北陸電気工業	7,900	893.00	7,054,700	
ニチコン	66,500	783.00	52,069,500	貸付有価証券 2,400株
日本ケミコン	14,900	1,448.00	21,575,200	貸付有価証券 200株（200株）
K O A	29,600	1,060.00	31,376,000	
市光工業	29,300	483.00	14,151,900	
小糸製作所	117,500	5,350.00	628,625,000	
ミツバ	36,100	377.00	13,609,700	
S C R E E Nホールディングス	34,000	5,180.00	176,120,000	
キャノン電子	18,000	1,451.00	26,118,000	
キャノン	974,600	1,750.00	1,705,550,000	貸付有価証券 433,300株
リコー	499,000	777.00	387,723,000	貸付有価証券 200株
象印マホービン	53,100	1,576.00	83,685,600	貸付有価証券 8,200株
M U T O Hホールディングス	2,500	1,508.00	3,770,000	
東京エレクトロン	124,500	26,400.00	3,286,800,000	貸付有価証券 1,000株
トヨタ紡織	57,100	1,507.00	86,049,700	
芦森工業	4,100	899.00	3,685,900	
ユニプレス	38,000	895.00	34,010,000	

豊田自動織機	158,700	6,330.00	1,004,571,000	
モリタホールディングス	34,300	1,864.00	63,935,200	
三櫻工業	24,900	644.00	16,035,600	
デンソー	431,800	4,493.00	1,940,077,400	貸付有価証券 500株
東海理化電機製作所	51,600	1,560.00	80,496,000	貸付有価証券 2,000株
三井E & Sホールディングス	70,800	425.00	30,090,000	
川崎重工業	152,600	1,490.00	227,374,000	貸付有価証券 10,600株
名村造船所	63,100	154.00	9,717,400	貸付有価証券 7,900株
サノヤスホールディングス	23,900	158.00	3,776,200	貸付有価証券 700株
日本車輛製造	7,100	2,580.00	18,318,000	
三菱ロジスネクスト	26,000	987.00	25,662,000	
近畿車輛	2,900	1,237.00	3,587,300	
日産自動車	2,313,200	419.90	971,312,680	貸付有価証券 277,200株
いすゞ自動車	568,300	1,024.50	582,223,350	貸付有価証券 1,800株
トヨタ自動車	2,188,500	6,966.00	15,245,091,000	貸付有価証券 2,500株
日野自動車	244,900	700.00	171,430,000	貸付有価証券 100株
三菱自動車工業	726,000	258.00	187,308,000	貸付有価証券 132,500株
エフテック	13,700	500.00	6,850,000	貸付有価証券 2,600株
レシップホールディングス	7,700	581.00	4,473,700	貸付有価証券 2,500株
G M B	3,500	625.00	2,187,500	
ファルテック	3,400	601.00	2,043,400	
武蔵精密工業	43,700	1,091.00	47,676,700	
日産車体	38,300	983.00	37,648,900	
新明和工業	52,800	921.00	48,628,800	
極東開発工業	36,400	1,270.00	46,228,000	
日信工業	39,900	2,246.00	89,615,400	
トピー工業	16,100	1,149.00	18,498,900	

ティラド	7,100	1,261.00	8,953,100	
タチエス	32,200	878.00	28,271,600	貸付有価証券 14,300株
N O K	105,400	1,154.00	121,631,600	
フタバ産業	54,600	548.00	29,920,800	
K Y B	22,000	2,122.00	46,684,000	
大同メタル工業	37,600	522.00	19,627,200	
プレス工業	97,200	303.00	29,451,600	
ミクニ	24,900	264.00	6,573,600	貸付有価証券 100株
太平洋工業	41,100	1,048.00	43,072,800	
ケーヒン	45,100	2,595.00	117,034,500	貸付有価証券 1,100株
河西工業	26,500	374.00	9,911,000	
アイシン精機	161,500	3,645.00	588,667,500	
マツダ	577,100	680.00	392,428,000	貸付有価証券 6,600株
今仙電機製作所	18,200	641.00	11,666,200	
本田技研工業	1,544,300	2,743.50	4,236,787,050	貸付有価証券 4,300株
スズキ	388,800	4,668.00	1,814,918,400	貸付有価証券 2,300株
S U B A R U	608,900	2,247.50	1,368,502,750	貸付有価証券 200株
安永	9,500	1,033.00	9,813,500	
ヤマハ発動機	277,200	1,700.00	471,240,000	貸付有価証券 500株
ショーワ	46,300	2,295.00	106,258,500	
T B K	23,300	414.00	9,646,200	
エクセディ	26,600	1,421.00	37,798,600	
豊田合成	63,300	2,376.00	150,400,800	
愛三工業	30,700	472.00	14,490,400	
盟和産業	3,000	897.00	2,691,000	
日本プラスト	15,400	438.00	6,745,200	
ヨロズ	18,300	1,000.00	18,300,000	
エフ・シー・シー	32,100	2,083.00	66,864,300	
シマノ	73,400	21,790.00	1,599,386,000	
テイ・エス テック	45,600	3,235.00	147,516,000	

ジャムコ	9,800	685.00	6,713,000	貸付有価証券 300株
テルモ	555,000	4,295.00	2,383,725,000	貸付有価証券 2,700株
クリエートメディック	6,500	993.00	6,454,500	
日機装	63,300	1,077.00	68,174,100	貸付有価証券 9,700株
日本エム・ディ・エム	11,300	2,060.00	23,278,000	
島津製作所	234,400	3,300.00	773,520,000	貸付有価証券 400株
J M S	16,600	869.00	14,425,400	
クボテック	5,100	337.00	1,718,700	
長野計器	14,200	842.00	11,956,400	
ブイ・テクノロジー	9,200	3,935.00	36,202,000	
東京計器	12,500	921.00	11,512,500	
愛知時計電機	2,600	4,405.00	11,453,000	
インターアクション	10,500	1,780.00	18,690,000	貸付有価証券 4,900株（100株）
オーバル	17,500	219.00	3,832,500	
東京精密	35,600	3,175.00	113,030,000	
マニー	78,100	2,709.00	211,572,900	貸付有価証券 2,400株（100株）
ニコン	299,500	783.00	234,508,500	貸付有価証券 1,000株
トプコン	98,800	929.00	91,785,200	貸付有価証券 2,700株
オリンパス	1,085,300	2,051.50	2,226,492,950	貸付有価証券 700株
理研計器	17,300	2,525.00	43,682,500	
タムロン	15,800	1,701.00	26,875,800	
H O Y A	389,100	10,500.00	4,085,550,000	
シード	8,300	701.00	5,818,300	
ノーリツ鋼機	13,200	1,522.00	20,090,400	
エー・アンド・デイ	17,900	646.00	11,563,400	
朝日インテック	222,100	3,055.00	678,515,500	貸付有価証券 3,700株
シチズン時計	229,700	322.00	73,963,400	貸付有価証券 15,100株（400株）
リズム時計工業	6,100	625.00	3,812,500	

大研医器	13,600	548.00	7,452,800	貸付有価証券 1,200株
メニコン	27,800	6,580.00	182,924,000	
シンシア	2,100	391.00	821,100	
松風	8,800	1,437.00	12,645,600	
セイコーホールディングス	27,700	1,508.00	41,771,600	貸付有価証券 3,900株(3,700株)
ニプロ	135,700	1,211.00	164,332,700	貸付有価証券 100株
中本パックス	5,000	1,508.00	7,540,000	
スノーピーク	11,600	1,603.00	18,594,800	貸付有価証券 2,700株
パラマウントベッドホールディングス	20,700	4,210.00	87,147,000	
トランザクション	10,700	1,128.00	12,069,600	貸付有価証券 400株(300株)
粧美堂	5,700	392.00	2,234,400	貸付有価証券 2,600株
ニホンフラッシュ	18,300	1,395.00	25,528,500	
前田工織	21,600	2,534.00	54,734,400	貸付有価証券 700株
永大産業	25,600	294.00	7,526,400	
アートネイチャー	20,900	614.00	12,832,600	
バンダイナムコホールディングス	202,800	6,609.00	1,340,305,200	貸付有価証券 200株
アイフィスジャパン	5,000	772.00	3,860,000	
共立印刷	32,800	132.00	4,329,600	
SHOEI	17,200	3,185.00	54,782,000	
フランスベッドホールディングス	27,700	866.00	23,988,200	
パイロットコーポレーション	34,700	3,085.00	107,049,500	
萩原工業	10,900	1,489.00	16,230,100	貸付有価証券 1,100株
トッパン・フォームズ	42,000	965.00	40,530,000	
フジシールインターナショナル	44,000	1,891.00	83,204,000	
タカラトミー	88,000	845.00	74,360,000	貸付有価証券 2,100株
廣濟堂	13,700	671.00	9,192,700	

エステールホールディングス	5,200	642.00	3,338,400	貸付有価証券 2,400株
タカノ	7,700	620.00	4,774,000	貸付有価証券 3,600株
プロネクサス	16,800	1,093.00	18,362,400	
ホクシン	12,100	112.00	1,355,200	
ウッドワン	6,600	1,181.00	7,794,600	
大建工業	13,200	1,712.00	22,598,400	
凸版印刷	276,800	1,525.00	422,120,000	貸付有価証券 100株
大日本印刷	256,700	2,147.00	551,134,900	貸付有価証券 100株
共同印刷	6,000	2,583.00	15,498,000	
N I S S H A	40,300	1,197.00	48,239,100	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
光村印刷	1,700	1,589.00	2,701,300	
TAKARA & COMPANY	9,500	2,770.00	26,315,000	
アシックス	173,400	1,496.00	259,406,400	貸付有価証券 17,400株
ツツミ	6,100	2,028.00	12,370,800	
小松ウオール工業	6,000	1,732.00	10,392,000	
ヤマハ	116,600	5,000.00	583,000,000	貸付有価証券 500株(200株)
河合楽器製作所	6,000	2,664.00	15,984,000	
クリナップ	18,200	507.00	9,227,400	
ビジョン	125,900	4,855.00	611,244,500	貸付有価証券 2,200株
オリバー	4,100	2,453.00	10,057,300	貸付有価証券 400株
兼松サステック	1,300	1,614.00	2,098,200	
キングジム	16,300	895.00	14,588,500	貸付有価証券 300株
リンテック	46,600	2,483.00	115,707,800	
イトーキ	38,900	358.00	13,926,200	
任天堂	120,300	58,950.00	7,091,685,000	
三菱鉛筆	32,300	1,275.00	41,182,500	
タカラスタンダード	40,500	1,301.00	52,690,500	
コクヨ	94,100	1,225.00	115,272,500	貸付有価証券

				2,500株
ナカバヤシ	19,300	625.00	12,062,500	
グローブライド	8,800	3,210.00	28,248,000	
オカムラ	68,400	742.00	50,752,800	
美津濃	17,800	1,938.00	34,496,400	
東京電力ホールディングス	1,565,800	310.00	485,398,000	貸付有価証券 300株
中部電力	600,100	1,303.00	781,930,300	
関西電力	743,100	1,047.50	778,397,250	
中国電力	282,900	1,293.00	365,789,700	
北陸電力	179,300	761.00	136,447,300	
東北電力	490,000	1,067.00	522,830,000	
四国電力	176,600	801.00	141,456,600	貸付有価証券 200株
九州電力	404,300	946.00	382,467,800	
北海道電力	183,500	450.00	82,575,000	貸付有価証券 200株
沖縄電力	38,100	1,669.00	63,588,900	
電源開発	156,100	1,600.00	249,760,000	貸付有価証券 1,200株
エフオン	10,500	644.00	6,762,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
イーレックス	28,000	1,267.00	35,476,000	貸付有価証券 3,600株
レノバ	32,800	1,158.00	37,982,400	
東京瓦斯	377,200	2,330.50	879,064,600	
大阪瓦斯	380,600	2,028.00	771,856,800	
東邦瓦斯	96,500	4,520.00	436,180,000	
北海道瓦斯	10,500	1,585.00	16,642,500	貸付有価証券 100株
広島ガス	40,400	359.00	14,503,600	
西部瓦斯	22,100	2,488.00	54,984,800	
静岡ガス	55,700	876.00	48,793,200	
メタウォーター	9,500	4,550.00	43,225,000	貸付有価証券 300株
SBSホールディングス	14,500	1,993.00	28,898,500	貸付有価証券 100株
東武鉄道	204,400	3,345.00	683,718,000	
相鉄ホールディングス	62,800	2,920.00	183,376,000	

東急	494,700	1,423.00	703,958,100	貸付有価証券 900株
京浜急行電鉄	251,900	1,601.00	403,291,900	貸付有価証券 7,500株
小田急電鉄	291,700	2,601.00	758,711,700	貸付有価証券 1,700株
京王電鉄	101,800	6,450.00	656,610,000	貸付有価証券 4,800株
京成電鉄	136,500	3,100.00	423,150,000	貸付有価証券 200株
富士急行	26,700	3,520.00	93,984,000	貸付有価証券 12,500株
新京成電鉄	5,000	2,255.00	11,275,000	
東日本旅客鉄道	345,200	6,866.00	2,370,143,200	貸付有価証券 100株
西日本旅客鉄道	174,800	5,614.00	981,327,200	
東海旅客鉄道	163,100	15,815.00	2,579,426,500	
西武ホールディングス	256,100	1,257.00	321,917,700	貸付有価証券 400株
鴻池運輸	31,200	1,099.00	34,288,800	
西日本鉄道	54,400	3,020.00	164,288,000	
ハマキョウレックス	15,100	3,365.00	50,811,500	
サカイ引越センター	10,300	4,800.00	49,440,000	
近鉄グループホールディングス	185,800	4,690.00	871,402,000	貸付有価証券 8,000株
阪急阪神ホールディングス	247,800	3,445.00	853,671,000	
南海電気鉄道	88,000	2,331.00	205,128,000	
京阪ホールディングス	82,700	4,575.00	378,352,500	
神戸電鉄	4,400	3,730.00	16,412,000	貸付有価証券 2,100株
名古屋鉄道	152,700	2,976.00	454,435,200	貸付有価証券 22,800株
山陽電気鉄道	13,300	2,088.00	27,770,400	貸付有価証券 6,200株
日本通運	64,300	6,190.00	398,017,000	貸付有価証券 400株
ヤマトホールディングス	325,600	2,725.00	887,260,000	
山九	51,600	4,320.00	222,912,000	
丸運	10,600	232.00	2,459,200	

丸全昭和運輸	15,100	3,295.00	49,754,500	
センコーグループホールディングス	102,400	943.00	96,563,200	
トナミホールディングス	4,500	5,760.00	25,920,000	
ニッコンホールディングス	66,500	2,253.00	149,824,500	
日本石油輸送	2,000	2,640.00	5,280,000	
福山通運	23,800	5,110.00	121,618,000	貸付有価証券 300株
セイノーホールディングス	139,100	1,492.00	207,537,200	
エスライン	5,600	926.00	5,185,600	
神奈川中央交通	4,600	4,005.00	18,423,000	貸付有価証券 2,100株
日立物流	34,000	3,640.00	123,760,000	
丸和運輸機関	19,600	3,985.00	78,106,000	貸付有価証券 800株
C & F ロジホールディングス	18,800	1,570.00	29,516,000	
九州旅客鉄道	162,800	2,346.00	381,928,800	
S Gホールディングス	195,000	4,825.00	940,875,000	貸付有価証券 3,600株
日本郵船	155,300	1,700.00	264,010,000	
商船三井	117,500	2,014.00	236,645,000	
川崎汽船	57,200	1,162.00	66,466,400	貸付有価証券 5,100株（5,100株）
N S ユナイテッド海運	10,200	1,424.00	14,524,800	貸付有価証券 100株
明治海運	19,700	321.00	6,323,700	
飯野海運	87,900	353.00	31,028,700	
共栄タンカー	3,300	770.00	2,541,000	
乾汽船	10,700	814.00	8,709,800	
日本航空	328,500	2,224.00	730,584,000	貸付有価証券 100株
A N A ホールディングス	339,600	2,709.50	920,146,200	貸付有価証券 161,100株（60,000株）
パスコ	3,600	1,380.00	4,968,000	
トラコム	5,200	7,070.00	36,764,000	
日新	16,000	1,542.00	24,672,000	

三菱倉庫	58,900	3,180.00	187,302,000	貸付有価証券 6,900株（5,400株）
三井倉庫ホールディングス	21,200	1,787.00	37,884,400	
住友倉庫	66,800	1,310.00	87,508,000	
澁澤倉庫	10,200	1,994.00	20,338,800	
東陽倉庫	33,500	318.00	10,653,000	貸付有価証券 100株
日本トランスシティ	40,900	503.00	20,572,700	貸付有価証券 100株
ケイヒン	3,600	1,290.00	4,644,000	
中央倉庫	11,300	1,030.00	11,639,000	
川西倉庫	3,400	1,115.00	3,791,000	貸付有価証券 1,500株
安田倉庫	15,300	934.00	14,290,200	
ファイズホールディングス	4,000	1,094.00	4,376,000	貸付有価証券 800株
東洋埠頭	5,700	1,409.00	8,031,300	
宇徳	15,900	470.00	7,473,000	
上組	103,700	2,127.00	220,569,900	貸付有価証券 800株
サンリツ	4,400	612.00	2,692,800	
キムラユニティー	5,000	1,074.00	5,370,000	貸付有価証券 2,300株
キューソー流通システム	4,600	1,505.00	6,923,000	
近鉄エクスプレス	39,500	2,151.00	84,964,500	
東海運	10,600	285.00	3,021,000	
エーアイティー	13,100	996.00	13,047,600	
内外トランスライン	6,500	1,131.00	7,351,500	
日本コンセプト	5,900	1,315.00	7,758,500	
NEC ネットエスアイ	54,600	1,870.00	102,102,000	貸付有価証券 600株
クロスキャット	5,000	1,276.00	6,380,000	
システナ	68,600	1,743.00	119,569,800	貸付有価証券 2,700株
デジタルアーツ	9,500	7,760.00	73,720,000	貸付有価証券 300株
日鉄ソリューションズ	28,800	3,055.00	87,984,000	
キューブシステム	10,200	1,159.00	11,821,800	貸付有価証券

				4,700株
エイジア	3,500	2,015.00	7,052,500	貸付有価証券 1,600株
コア	8,100	1,337.00	10,829,700	
ラクーンホールディングス	9,000	1,929.00	17,361,000	貸付有価証券 4,200株
ソリトンシステムズ	9,600	1,809.00	17,366,400	貸付有価証券 3,900株(3,900株)
ソフトクリエイティブホールディングス	8,400	2,628.00	22,075,200	
T I S	192,500	2,062.00	396,935,000	貸付有価証券 600株
J N S ホールディングス	7,700	627.00	4,827,900	貸付有価証券 1,400株
電算システム	6,700	3,650.00	24,455,000	貸付有価証券 400株
グリー	118,000	449.00	52,982,000	
コーエーテクモホールディングス	39,400	4,095.00	161,343,000	
三菱総合研究所	8,300	4,035.00	33,490,500	
ボルテージ	4,600	520.00	2,392,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
電算	2,100	2,204.00	4,628,400	
A G S	10,900	825.00	8,992,500	
ファインデックス	16,200	1,311.00	21,238,200	貸付有価証券 1,600株(1,300株)
ブレインパッド	4,900	3,995.00	19,575,500	
K L a b	35,000	915.00	32,025,000	貸付有価証券 15,600株(13,900株)
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	23,200	947.00	21,970,400	貸付有価証券 1,800株(200株)
イーブックイニシアティブジャパン	2,800	3,145.00	8,806,000	
ネクソン	484,900	2,506.00	1,215,159,400	貸付有価証券 10,200株(5,800株)
アイスタイル	53,900	304.00	16,385,600	貸付有価証券 19,700株(100株)
エムアップホールディングス	5,600	3,535.00	19,796,000	貸付有価証券 700株
エイチーム	13,300	932.00	12,395,600	
エニグモ	18,200	1,533.00	27,900,600	貸付有価証券

				5,800株(5,800株)
テクノスジャパン	14,900	781.00	11,636,900	
e n i s h	10,000	825.00	8,250,000	貸付有価証券 2,200株
コロプラ	63,100	950.00	59,945,000	貸付有価証券 24,400株(7,800株)
オルトプラス	11,700	515.00	6,025,500	貸付有価証券 5,400株(100株)
ブロードリーフ	95,400	505.00	48,177,000	貸付有価証券 45,600株
クロス・マーケティング グループ	8,500	330.00	2,805,000	
デジタルハーツホール ディングス	10,200	1,004.00	10,240,800	貸付有価証券 1,600株
システム情報	14,400	1,222.00	17,596,800	貸付有価証券 6,700株(600株)
メディアドゥ	6,100	6,900.00	42,090,000	
じげん	47,600	356.00	16,945,600	
ブイキューブ	10,400	1,713.00	17,815,200	貸付有価証券 5,500株(1,700株)
エンカレッジ・テクノロ ジ	4,200	841.00	3,532,200	
サイバーリンクス	3,100	1,876.00	5,815,600	貸付有価証券 100株
ディー・エル・イー	15,500	414.00	6,417,000	貸付有価証券 7,200株(4,900株)
フィックスターズ	20,500	1,023.00	20,971,500	
C A R T A H O L D I N G S	7,800	1,166.00	9,094,800	貸付有価証券 3,900株(3,700株)
オプティム	10,100	2,856.00	28,845,600	貸付有価証券 1,000株
セレス	6,300	1,851.00	11,661,300	貸付有価証券 2,400株
S H I F T	7,800	12,330.00	96,174,000	
ティーガイア	17,100	2,055.00	35,140,500	
セック	2,800	3,055.00	8,554,000	
日本アジアグループ	20,300	292.00	5,927,600	
テクマトリックス	27,100	2,122.00	57,506,200	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
プロシップ	5,600	1,515.00	8,484,000	
ガンホー・オンライン・	46,400	2,169.00	100,641,600	貸付有価証券

エンターテイメント				10,700株
GMOペイメントゲートウェイ	40,700	10,340.00	420,838,000	
ザッパラス	8,300	445.00	3,693,500	
システムリサーチ	5,100	1,684.00	8,588,400	貸付有価証券 2,300株（300株）
インターネットイニシアティブ	28,500	4,105.00	116,992,500	
さくらインターネット	20,600	636.00	13,101,600	貸付有価証券 9,600株
ヴィンクス	5,400	1,220.00	6,588,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,300	8,060.00	34,658,000	貸付有価証券 1,900株（1,200株）
SRAホールディングス	10,200	2,349.00	23,959,800	
システムインテグレータ	6,100	713.00	4,349,300	貸付有価証券 1,500株
朝日ネット	13,600	901.00	12,253,600	
eBASE	23,000	1,156.00	26,588,000	
アバント	18,300	1,017.00	18,611,100	貸付有価証券 300株
アドソル日進	6,800	2,503.00	17,020,400	
フリービット	10,000	839.00	8,390,000	貸付有価証券 700株（100株）
コムチュア	21,600	2,504.00	54,086,400	
サイバーコム	3,400	1,846.00	6,276,400	
アステリア	11,700	810.00	9,477,000	
アイル	10,700	1,355.00	14,498,500	貸付有価証券 5,000株（2,300株）
マークライNZ	8,000	2,166.00	17,328,000	
メディカル・データ・ビジョン	21,900	1,906.00	41,741,400	貸付有価証券 5,200株（4,800株）
gumi	24,700	1,034.00	25,539,800	
ショーケース	4,100	790.00	3,239,000	貸付有価証券 100株
モバイルファクトリー	4,300	1,265.00	5,439,500	貸付有価証券 1,200株
テラスカイ	6,900	4,595.00	31,705,500	貸付有価証券 2,200株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,600	1,214.00	9,226,400	貸付有価証券 600株（600株）

PCIホールディングス	7,300	1,149.00	8,387,700	
パイプドHD	2,500	1,718.00	4,295,000	貸付有価証券 1,100株（700株）
アイピーシー	3,100	929.00	2,879,900	
ネオジャパン	3,600	2,845.00	10,242,000	貸付有価証券 1,600株
PR TIMES	3,300	2,326.00	7,675,800	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
ランドコンピュータ	2,900	1,036.00	3,004,400	
ダブルスタンダード	2,500	4,500.00	11,250,000	貸付有価証券 700株
オープンドア	9,500	1,366.00	12,977,000	貸付有価証券 4,400株（1,100株）
マイネット	6,300	1,304.00	8,215,200	
アカツキ	6,800	4,050.00	27,540,000	貸付有価証券 200株（200株）
ベネフィットジャパン	1,400	1,838.00	2,573,200	
Ubicomホールディングス	4,300	1,923.00	8,268,900	
LINE	58,900	5,410.00	318,649,000	貸付有価証券 12,600株（7,000株）
カナミックネットワーク	17,600	771.00	13,569,600	
ノムラシステムコーポレーション	8,400	398.00	3,343,200	貸付有価証券 900株
チェンジ	13,400	8,220.00	110,148,000	貸付有価証券 3,200株（1,200株）
シンクロ・フード	8,200	335.00	2,747,000	貸付有価証券 300株（300株）
オークネット	10,200	1,280.00	13,056,000	
セグエグループ	4,900	1,186.00	5,811,400	
エイトレッド	3,200	1,941.00	6,211,200	
AOI TYO Holdings	19,400	410.00	7,954,000	貸付有価証券 6,700株（6,700株）
マクロミル	39,300	845.00	33,208,500	
ビーグリー	3,800	1,537.00	5,840,600	貸付有価証券 1,400株
オロ	6,100	2,999.00	18,293,900	貸付有価証券 300株
ユーザーローカル	1,900	4,065.00	7,723,500	
テモナ	4,100	1,517.00	6,219,700	

ニーズウェル	3,600	732.00	2,635,200	
サインポスト	4,000	1,306.00	5,224,000	貸付有価証券 700株(400株)
ソルクシーズ	7,300	1,022.00	7,460,600	貸付有価証券 900株(600株)
フェイス	6,700	1,032.00	6,914,400	貸付有価証券 600株(600株)
プロトコーポレーション	17,200	1,207.00	20,760,400	
ハイマックス	2,300	2,384.00	5,483,200	貸付有価証券 1,000株(200株)
野村総合研究所	272,800	2,764.00	754,019,200	
サイバネットシステム	13,700	850.00	11,645,000	貸付有価証券 500株
C Eホールディングス	10,100	562.00	5,676,200	貸付有価証券 4,700株
日本システム技術	3,100	1,748.00	5,418,800	
インテージホールディングス	24,000	910.00	21,840,000	
東邦システムサイエンス	5,100	968.00	4,936,800	貸付有価証券 2,300株
ソースネクスト	91,300	297.00	27,116,100	貸付有価証券 42,900株(17,000株)
インフォコム	21,000	3,620.00	76,020,000	
HEROZ	2,700	3,630.00	9,801,000	貸付有価証券 1,200株(1,100株)
ラクスル	15,500	3,145.00	48,747,500	貸付有価証券 2,200株
F I G	20,800	238.00	4,950,400	
システムサポート	4,400	1,606.00	7,066,400	
イーソル	10,500	1,182.00	12,411,000	貸付有価証券 3,400株
アルテリア・ネットワークス	21,300	1,797.00	38,276,100	
東海ソフト	1,300	1,236.00	1,606,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	3,300	1,061.00	3,501,300	
東名	1,000	1,287.00	1,287,000	貸付有価証券 100株
ヴィッツ	700	3,305.00	2,313,500	貸付有価証券 300株
トピラシステムズ	1,900	1,960.00	3,724,000	貸付有価証券

				800株
Link - U	1,300	2,087.00	2,713,100	貸付有価証券 500株
フォーカスシステムズ	11,900	824.00	9,805,600	
クレスコ	11,700	1,233.00	14,426,100	
フジ・メディア・ホールディングス	185,400	1,038.00	192,445,200	貸付有価証券 400株
オービック	66,700	18,410.00	1,227,947,000	
ジャストシステム	31,300	7,240.00	226,612,000	
TDCソフト	16,800	927.00	15,573,600	
Zホールディングス	2,643,200	658.00	1,739,225,600	貸付有価証券 100株
トレンドマイクロ	102,700	6,480.00	665,496,000	貸付有価証券 8,500株
IDホールディングス	7,300	1,372.00	10,015,600	
日本オラクル	39,000	11,730.00	457,470,000	
アルファシステムズ	6,000	3,660.00	21,960,000	
フューチャー	23,200	1,899.00	44,056,800	貸付有価証券 6,400株
CAC Holdings	12,500	1,306.00	16,325,000	貸付有価証券 4,800株
SBテクノロジー	6,900	3,020.00	20,838,000	
トーセ	5,200	892.00	4,638,400	
オービックビジネスコンサルタント	19,700	6,130.00	120,761,000	貸付有価証券 8,200株
伊藤忠テクノソリューションズ	87,700	3,755.00	329,313,500	
アイティフォー	23,300	796.00	18,546,800	
東計電算	2,800	4,425.00	12,390,000	
エクスネット	3,000	968.00	2,904,000	
大塚商会	104,100	5,050.00	525,705,000	
サイボウズ	22,500	3,050.00	68,625,000	
ソフトブレーン	15,100	866.00	13,076,600	貸付有価証券 3,200株(1,300株)
電通国際情報サービス	11,900	5,840.00	69,496,000	
ACCESS	18,000	925.00	16,650,000	貸付有価証券 400株(400株)
デジタルガレージ	34,600	3,180.00	110,028,000	貸付有価証券 9,300株
EMシステムズ	27,200	831.00	22,603,200	

ウェザーニューズ	6,500	4,890.00	31,785,000	貸付有価証券 200株
C I J	13,100	841.00	11,017,100	
ビジネスエンジニアリン グ	2,200	2,968.00	6,529,600	貸付有価証券 1,000株
日本エンタープライズ	19,600	315.00	6,174,000	貸付有価証券 9,200株
WOWOW	9,200	2,776.00	25,539,200	貸付有価証券 4,300株(300株)
スカラ	12,800	806.00	10,316,800	
インテリジェント ウェ イブ	11,200	767.00	8,590,400	
I M A G I C A G R O U P	16,300	391.00	6,373,300	
ネットワンシステムズ	73,300	4,060.00	297,598,000	
システムソフト	41,400	93.00	3,850,200	
アルゴグラフィックス	16,300	3,450.00	56,235,000	
マーベラス	29,400	779.00	22,902,600	貸付有価証券 200株
エイベックス	33,000	899.00	29,667,000	貸付有価証券 100株
日本ユニシス	60,100	2,945.00	176,994,500	
兼松エレクトロニクス	10,500	3,980.00	41,790,000	
都築電気	6,100	1,581.00	9,644,100	貸付有価証券 700株
東京放送ホールディング ス	117,000	1,755.00	205,335,000	
日本テレビホールディン グス	160,700	1,197.00	192,357,900	貸付有価証券 100株
朝日放送グループホール ディングス	19,100	708.00	13,522,800	
テレビ朝日ホールディン グス	52,900	1,610.00	85,169,000	貸付有価証券 500株
スカパー J S A T ホール ディングス	126,600	461.00	58,362,600	貸付有価証券 200株
テレビ東京ホールディン グス	15,800	2,298.00	36,308,400	貸付有価証券 100株
日本 B S 放送	6,500	1,084.00	7,046,000	
ビジョン	23,900	884.00	21,127,600	貸付有価証券 3,100株
スマートバリュー	5,000	1,069.00	5,345,000	

USEN - NEXT HOLDINGS	7,300	1,183.00	8,635,900	貸付有価証券 1,800株(1,100株)
ワイヤレスゲート	7,800	823.00	6,419,400	貸付有価証券 3,600株
コネクシオ	10,900	1,232.00	13,428,800	
日本通信	150,000	230.00	34,500,000	貸付有価証券 62,700株(62,100株)
クロップス	3,500	780.00	2,730,000	
日本電信電話	2,572,800	2,370.50	6,098,822,400	
KDDI	1,403,100	2,910.00	4,083,021,000	
ソフトバンク	1,749,100	1,353.00	2,366,532,300	貸付有価証券 730,900株
光通信	19,800	24,550.00	486,090,000	貸付有価証券 200株
NTTドコモ	1,376,300	2,825.00	3,888,047,500	貸付有価証券 8,300株
エムティーアイ	18,600	673.00	12,517,800	
GMOインターネット	69,000	2,651.00	182,919,000	
ファイバーゲート	6,200	1,820.00	11,284,000	貸付有価証券 2,900株(1,100株)
アйдママーケティング コミュニケーション	5,800	451.00	2,615,800	
KADOKAWA	51,800	2,475.00	128,205,000	
学研ホールディングス	25,800	1,572.00	40,557,600	
ゼンリン	38,400	1,140.00	43,776,000	貸付有価証券 2,500株
昭文社ホールディングス	8,900	464.00	4,129,600	貸付有価証券 200株
インプレスホールディングス	15,900	157.00	2,496,300	
アイネット	9,900	1,518.00	15,028,200	貸付有価証券 500株
松竹	12,700	14,320.00	181,864,000	貸付有価証券 5,400株(400株)
東宝	113,600	4,105.00	466,328,000	
東映	7,200	16,510.00	118,872,000	貸付有価証券 2,300株
エヌ・ティ・ティ・データ	512,400	1,216.00	623,078,400	
ピー・シー・エー	3,300	4,625.00	15,262,500	貸付有価証券 500株

ビジネスブレイン太田昭和	6,600	1,343.00	8,863,800	
D T S	43,000	2,188.00	94,084,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	82,100	6,900.00	566,490,000	
シーイーシー	20,600	1,549.00	31,909,400	
カプコン	90,700	5,230.00	474,361,000	
アイ・エス・ビー	4,100	2,350.00	9,635,000	貸付有価証券 100株
ジャステック	12,200	1,294.00	15,786,800	
S C S K	44,400	5,610.00	249,084,000	貸付有価証券 200株
日本システムウエア	6,400	1,956.00	12,518,400	
アイネス	18,900	1,460.00	27,594,000	
T K C	16,300	5,960.00	97,148,000	
富士ソフト	20,500	4,685.00	96,042,500	貸付有価証券 9,600株
N S D	61,900	1,817.00	112,472,300	
コナミホールディングス	69,900	4,205.00	293,929,500	貸付有価証券 1,200株
福井コンピュータホールディングス	7,600	2,760.00	20,976,000	貸付有価証券 200株
J B C Cホールディングス	13,000	1,627.00	21,151,000	
ミロク情報サービス	17,000	2,163.00	36,771,000	貸付有価証券 6,300株（5,600株）
ソフトバンクグループ	1,527,100	5,881.00	8,980,875,100	
ハウスイ	1,500	918.00	1,377,000	
高千穂交易	7,400	940.00	6,956,000	
カワニシホールディングス	2,300	1,366.00	3,141,800	
伊藤忠食品	4,800	5,300.00	25,440,000	
エレマテック	18,000	895.00	16,110,000	
J A L U X	5,400	1,595.00	8,613,000	貸付有価証券 2,500株
あらた	15,400	5,100.00	78,540,000	
トーメンデバイス	2,900	3,760.00	10,904,000	貸付有価証券 1,300株
東京エレクトロン デバイス	7,000	2,906.00	20,342,000	

フィールズ	14,800	328.00	4,854,400	
双日	1,067,000	240.00	256,080,000	貸付有価証券 19,100株
アルフレッサ ホールディングス	214,700	2,152.00	462,034,400	
横浜冷凍	50,500	897.00	45,298,500	
神栄	2,700	497.00	1,341,900	
ラサ商事	10,200	941.00	9,598,200	
アルコニックス	20,500	1,412.00	28,946,000	
神戸物産	66,600	5,780.00	384,948,000	貸付有価証券 31,200株
ハイパー	2,900	557.00	1,615,300	
あい ホールディングス	27,600	1,793.00	49,486,800	
ディーブイエックス	6,900	900.00	6,210,000	貸付有価証券 2,100株
ダイワボウホールディングス	16,400	6,170.00	101,188,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	46,100	1,837.00	84,685,700	貸付有価証券 20,600株
ラクト・ジャパン	8,400	3,545.00	29,778,000	貸付有価証券 100株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	36,400	1,054.00	38,365,600	
八洲電機	14,900	968.00	14,423,200	貸付有価証券 7,000株
メディアスホールディングス	10,900	845.00	9,210,500	
レスターホールディングス	20,100	2,027.00	40,742,700	
ジューテックホールディングス	4,400	997.00	4,386,800	
大光	8,200	681.00	5,584,200	
OCHIホールディングス	5,600	1,504.00	8,422,400	
TOKAIホールディングス	102,100	1,017.00	103,835,700	貸付有価証券 47,900株
黒谷	5,200	500.00	2,600,000	貸付有価証券 1,500株
Cominix	3,300	712.00	2,349,600	
三洋貿易	19,400	1,023.00	19,846,200	
ビューティガレージ	3,100	2,052.00	6,361,200	

ウイン・パートナーズ	13,900	932.00	12,954,800	貸付有価証券 6,200株
ミタチ産業	5,800	562.00	3,259,600	
シップヘルスケアホールディングス	31,000	4,940.00	153,140,000	貸付有価証券 3,000株
明治電機工業	6,100	1,343.00	8,192,300	
デリカフーズホールディングス	6,800	682.00	4,637,600	貸付有価証券 3,200株
スターティアホールディングス	4,400	608.00	2,675,200	貸付有価証券 100株
コメダホールディングス	42,100	1,867.00	78,600,700	貸付有価証券 4,400株
ピーバンドットコム	1,900	970.00	1,843,000	
アセンテック	4,100	1,952.00	8,003,200	
富士興産	5,900	639.00	3,770,100	
協栄産業	2,100	1,276.00	2,679,600	
小野建	17,300	1,126.00	19,479,800	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
南陽	4,200	1,556.00	6,535,200	
佐鳥電機	13,100	827.00	10,833,700	
エコートレーディング	4,400	552.00	2,428,800	
伯東	11,800	1,106.00	13,050,800	貸付有価証券 100株
コンドーテック	14,900	1,189.00	17,716,100	
中山福	11,100	469.00	5,205,900	
ナガイレーベン	25,600	2,685.00	68,736,000	
三菱食品	21,200	2,711.00	57,473,200	
松田産業	14,100	1,497.00	21,107,700	
第一興商	28,800	3,435.00	98,928,000	
メディカルホールディングス	208,500	2,050.00	427,425,000	貸付有価証券 1,100株
S P K	8,300	1,375.00	11,412,500	
萩原電気ホールディングス	7,100	2,087.00	14,817,700	
アズワン	12,600	13,880.00	174,888,000	
スズデン	6,700	1,140.00	7,638,000	
尾家産業	5,600	1,469.00	8,226,400	
シモジマ	11,800	1,253.00	14,785,400	
ドウシシャ	18,200	2,038.00	37,091,600	

小津産業	4,200	1,777.00	7,463,400	
高速	11,500	1,484.00	17,066,000	貸付有価証券 5,400株
たけびし	6,800	1,475.00	10,030,000	
リックス	4,300	1,478.00	6,355,400	
丸文	17,100	475.00	8,122,500	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
ハビネット	16,100	1,306.00	21,026,600	
橋本総業ホールディングス	3,900	2,196.00	8,564,400	
日本ライフライン	57,200	1,416.00	80,995,200	
タカショー	12,500	620.00	7,750,000	
マルカ	6,200	1,991.00	12,344,200	
I D O M	52,100	572.00	29,801,200	貸付有価証券 500株
進和	11,400	2,057.00	23,449,800	
エスケイジャパン	4,100	291.00	1,193,100	
ダイトロン	8,200	1,403.00	11,504,600	貸付有価証券 100株
シークス	24,600	941.00	23,148,600	
田中商事	5,900	714.00	4,212,600	
オーハシテクニカ	9,900	1,442.00	14,275,800	
白銅	6,900	1,225.00	8,452,500	
ダイコー通産	1,200	1,208.00	1,449,600	
伊藤忠商事	1,351,200	2,802.00	3,786,062,400	
丸紅	2,010,800	652.30	1,311,644,840	貸付有価証券 65,000株
高島	3,100	1,789.00	5,545,900	
長瀬産業	108,600	1,369.00	148,673,400	
蝶理	12,300	1,560.00	19,188,000	
豊田通商	215,600	3,160.00	681,296,000	貸付有価証券 200株
三共生興	29,200	400.00	11,680,000	
兼松	72,000	1,347.00	96,984,000	
ツカモトコーポレーション	3,500	1,160.00	4,060,000	
三井物産	1,672,600	1,953.00	3,266,587,800	貸付有価証券 300株
日本紙パルプ商事	11,000	3,675.00	40,425,000	

カメイ	25,200	996.00	25,099,200	
東都水産	2,500	3,060.00	7,650,000	貸付有価証券 1,100株
OUGホールディングス	3,000	2,822.00	8,466,000	貸付有価証券 1,400株
スターゼン	7,100	4,035.00	28,648,500	
山善	75,400	998.00	75,249,200	
椿本興業	3,600	3,120.00	11,232,000	
住友商事	1,218,800	1,380.00	1,681,944,000	貸付有価証券 300株
内田洋行	7,600	5,150.00	39,140,000	貸付有価証券 1,000株（500株）
三菱商事	1,266,600	2,589.00	3,279,227,400	貸付有価証券 300株
第一実業	9,500	3,650.00	34,675,000	
キャノンマーケティング ジャパン	47,900	1,875.00	89,812,500	貸付有価証券 1,100株
西華産業	10,900	1,306.00	14,235,400	
佐藤商事	15,900	893.00	14,198,700	
菱洋エレクトロ	19,600	2,657.00	52,077,200	貸付有価証券 9,200株（9,200株）
東京産業	17,500	516.00	9,030,000	
ユアサ商事	18,300	3,110.00	56,913,000	
神鋼商事	4,900	1,775.00	8,697,500	
トルク	11,500	299.00	3,438,500	
阪和興業	36,100	2,138.00	77,181,800	貸付有価証券 4,200株
正栄食品工業	12,500	4,230.00	52,875,000	
カナデン	15,700	1,382.00	21,697,400	
菱電商事	13,900	1,438.00	19,988,200	
フルサト工業	10,700	1,333.00	14,263,100	
岩谷産業	43,200	4,040.00	174,528,000	貸付有価証券 17,300株（5,900株）
ナイス	8,200	1,275.00	10,455,000	
昭光通商	6,200	578.00	3,583,600	
ニチモウ	3,000	1,905.00	5,715,000	
極東貿易	5,500	1,318.00	7,249,000	
イワキ	25,400	479.00	12,166,600	
三愛石油	47,600	952.00	45,315,200	

稲畑産業	42,500	1,325.00	56,312,500	貸付有価証券 100株
G S Iクレオス	4,700	1,821.00	8,558,700	
明和産業	17,800	488.00	8,686,400	貸付有価証券 8,300株（5,900株）
クワザワ	6,900	516.00	3,560,400	
ヤマエ久野	14,100	1,152.00	16,243,200	
ワキタ	41,200	941.00	38,769,200	
東邦ホールディングス	62,000	2,138.00	132,556,000	
サンゲツ	52,100	1,604.00	83,568,400	
ミツウロコグループホールディングス	28,500	1,170.00	33,345,000	
シナネンホールディングス	7,900	3,015.00	23,818,500	
伊藤忠エネクス	42,700	949.00	40,522,300	
サンリオ	54,200	1,795.00	97,289,000	貸付有価証券 16,700株（5,600株）
サンワテクノス	13,700	850.00	11,645,000	
リョーサン	21,300	1,958.00	41,705,400	
新光商事	30,300	820.00	24,846,000	
トーヨー	8,700	1,804.00	15,694,800	
三信電気	10,400	1,825.00	18,980,000	
東陽テクニカ	20,700	944.00	19,540,800	
モスフードサービス	25,300	2,881.00	72,889,300	貸付有価証券 11,800株
加賀電子	19,200	2,129.00	40,876,800	
ソーダニッカ	19,900	520.00	10,348,000	
立花エレテック	14,300	1,700.00	24,310,000	
フォーバル	8,400	945.00	7,938,000	
P A L T A C	31,000	5,790.00	179,490,000	
三谷産業	25,400	350.00	8,890,000	
太平洋興発	7,600	616.00	4,681,600	
西本Wismettac ホールディングス	4,400	1,889.00	8,311,600	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,700	1,512.00	2,570,400	
コア商事ホールディングス	1,800	1,827.00	3,288,600	
国際紙パルプ商事	45,700	274.00	12,521,800	

ヤマタネ	9,700	1,269.00	12,309,300	
丸紅建材リース	1,900	1,711.00	3,250,900	
日鉄物産	13,800	3,140.00	43,332,000	貸付有価証券 1,600株
泉州電業	5,400	2,860.00	15,444,000	
トラスコ中山	44,200	2,445.00	108,069,000	
オートバックスセブン	71,700	1,380.00	98,946,000	
モリト	14,100	593.00	8,361,300	
加藤産業	27,900	3,585.00	100,021,500	
北恵	4,900	1,031.00	5,051,900	
イノテック	10,000	1,013.00	10,130,000	
イエローハット	36,500	1,717.00	62,670,500	
J Kホールディングス	17,500	717.00	12,547,500	貸付有価証券 7,800株
日伝	17,500	2,093.00	36,627,500	
北沢産業	14,500	260.00	3,770,000	
杉本商事	10,400	1,861.00	19,354,400	
因幡電機産業	55,000	2,603.00	143,165,000	
東テク	6,400	2,293.00	14,675,200	
ミスミグループ本社	242,100	2,798.00	677,395,800	
アルテック	14,100	245.00	3,454,500	
タキヒヨー	5,800	1,614.00	9,361,200	
蔵王産業	3,700	1,436.00	5,313,200	
スズケン	81,800	4,005.00	327,609,000	貸付有価証券 1,000株
ジェコス	13,300	917.00	12,196,100	
グローセル	19,300	400.00	7,720,000	
ローソン	48,900	5,120.00	250,368,000	貸付有価証券 22,900株
サンエー	16,100	4,280.00	68,908,000	貸付有価証券 100株
カワチ薬品	15,000	2,781.00	41,715,000	
エービーシー・マート	30,200	5,430.00	163,986,000	
ハードオフコーポレーション	7,600	663.00	5,038,800	
アスクル	20,200	3,430.00	69,286,000	
ゲオホールディングス	34,800	1,717.00	59,751,600	
アダストリア	26,700	1,675.00	44,722,500	貸付有価証券

				8,500株
ジーフット	11,700	482.00	5,639,400	貸付有価証券 300株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,800	440.00	1,232,000	
くら寿司	11,300	4,940.00	55,822,000	貸付有価証券 500株
キャンドゥ	9,200	2,142.00	19,706,400	
パルグループホールディ ングス	19,700	1,148.00	22,615,600	
エディオン	88,700	1,130.00	100,231,000	貸付有価証券 37,600株
サーラコーポレーション	39,200	577.00	22,618,400	
ワッツ	8,500	886.00	7,531,000	貸付有価証券 400株
ハローズ	7,300	3,890.00	28,397,000	
フジオフードグループ本 社	16,300	1,350.00	22,005,000	
あみやき亭	4,200	2,960.00	12,432,000	
ひらまつ	35,500	200.00	7,100,000	
大黒天物産	4,600	5,320.00	24,472,000	
ハニーズホールディン グス	17,000	1,051.00	17,867,000	
ファーマライズホール ディングス	4,700	750.00	3,525,000	
アルペン	14,800	1,824.00	26,995,200	
ハブ	5,500	635.00	3,492,500	貸付有価証券 100株(100株)
クオールホールディン グス	28,400	1,161.00	32,972,400	
ジンズホールディン グス	10,200	7,520.00	76,704,000	
ビックカメラ	114,600	1,111.00	127,320,600	
D C Mホールディン グス	111,600	1,231.00	137,379,600	貸付有価証券 200株
Monotaro	137,400	4,200.00	577,080,000	貸付有価証券 53,800株(6,600株)
東京一番フーズ	4,900	558.00	2,734,200	貸付有価証券 2,300株
DDホールディン グス	7,600	819.00	6,224,400	貸付有価証券 3,500株(100株)
きちりホールディン グス	5,100	640.00	3,264,000	

アークランドサービス ホールディングス	16,100	2,110.00	33,971,000	
J・フロント リテイリ ング	230,700	727.00	167,718,900	貸付有価証券 1,200株
ドトール・日レスホール ディングス	27,800	1,648.00	45,814,400	
マツモトキヨシホール ディングス	79,900	3,610.00	288,439,000	貸付有価証券 100株
ブロンコピリー	10,100	2,240.00	22,624,000	貸付有価証券 100株
Z O Z O	132,800	2,837.00	376,753,600	貸付有価証券 1,600株
トレジャー・ファクト リー	5,700	763.00	4,349,100	
物語コーポレーション	5,100	9,780.00	49,878,000	
ココカラファイン	20,200	6,130.00	123,826,000	
三越伊勢丹ホールディ ングス	337,800	563.00	190,181,400	貸付有価証券 13,100株
H a m e e	6,900	2,397.00	16,539,300	
ウエルシアホールディ ングス	114,900	4,190.00	481,431,000	貸付有価証券 5,800株（4,800株）
クリエイトSDホール ディングス	32,600	3,600.00	117,360,000	
丸善CHIホールディ ングス	22,500	376.00	8,460,000	貸付有価証券 4,600株（4,600株）
ミサワ	3,900	784.00	3,057,600	
ティーライフ	2,800	1,301.00	3,642,800	
エー・ピーカンパニー	3,600	408.00	1,468,800	貸付有価証券 100株（100株）
チムニー	5,900	1,425.00	8,407,500	貸付有価証券 2,700株
シュッピン	13,100	846.00	11,082,600	
オイシックス・ラ・大地	19,100	3,280.00	62,648,000	貸付有価証券 400株（200株）
ネクステージ	32,300	1,071.00	34,593,300	
ジョイフル本田	56,600	1,441.00	81,560,600	貸付有価証券 100株
鳥貴族	5,700	1,492.00	8,504,400	貸付有価証券 2,300株（400株）
キリン堂ホールディ ングス	7,600	2,544.00	19,334,400	

ホットランド	14,400	1,171.00	16,862,400	
すかいらくホールディングス	216,500	1,648.00	356,792,000	貸付有価証券 98,600株(500株)
SFPホールディングス	11,000	1,390.00	15,290,000	貸付有価証券 200株(200株)
綿半ホールディングス	7,200	2,756.00	19,843,200	貸付有価証券 100株
ヨシックス	3,100	1,932.00	5,989,200	貸付有価証券 1,400株
ユナイテッド・スーパー マーケット・ホール	56,100	1,172.00	65,749,200	貸付有価証券 500株
ゴルフダイジェスト・オ ンライン	10,000	572.00	5,720,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
B E E N O S	8,900	1,743.00	15,512,700	貸付有価証券 2,400株
あさひ	14,400	1,779.00	25,617,600	貸付有価証券 500株(500株)
日本調剤	11,700	1,591.00	18,614,700	
コスモス薬品	17,100	17,280.00	295,488,000	
トーエル	9,300	763.00	7,095,900	
オンリー	3,300	506.00	1,669,800	貸付有価証券 100株(100株)
セブン & アイ・ホール ディングス	755,700	3,333.00	2,518,748,100	貸付有価証券 30,500株
クリエイト・レストラン ツ・ホールディング	103,800	647.00	67,158,600	貸付有価証券 33,600株(1,800株)
ツルハホールディングス	42,000	14,170.00	595,140,000	
サンマルクホールディ ングス	15,300	1,651.00	25,260,300	
フェリシモ	4,300	991.00	4,261,300	
トリドールホールディ ングス	47,800	1,412.00	67,493,600	貸付有価証券 22,400株(4,300株)
T O K Y O B A S E	17,400	367.00	6,385,800	貸付有価証券 3,300株(3,000株)
ウイルプラスホールディ ングス	2,400	584.00	1,401,600	
J Mホールディングス	14,600	3,210.00	46,866,000	
サツドラホールディ ングス	2,900	1,985.00	5,756,500	
アレンザホールディ ングス	9,600	1,338.00	12,844,800	

串カツ田中ホールディングス	5,100	1,726.00	8,802,600	貸付有価証券 2,300株（1,600株）
パロックジャパンリミテッド	13,400	632.00	8,468,800	貸付有価証券 400株
クスリのアオキホールディングス	17,300	8,870.00	153,451,000	
力の源ホールディングス	8,800	688.00	6,054,400	貸付有価証券 100株
スシローグローバルホールディングス	106,000	2,705.00	286,730,000	
LIXILピバ	5,400	2,590.00	13,986,000	
メディカルシステムネットワーク	18,700	474.00	8,863,800	貸付有価証券 7,300株
はるやまホールディングス	9,000	715.00	6,435,000	貸付有価証券 4,000株
ノジマ	34,400	3,010.00	103,544,000	
カッパ・クリエイト	27,100	1,502.00	40,704,200	貸付有価証券 12,700株（100株）
ライトオン	14,400	559.00	8,049,600	貸付有価証券 1,000株（400株）
ジーンズメイト	5,900	209.00	1,233,100	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
良品計画	256,500	1,778.00	456,057,000	貸付有価証券 1,700株
三城ホールディングス	20,500	283.00	5,801,500	貸付有価証券 9,600株
アドヴァン	29,500	1,259.00	37,140,500	
アルビス	7,300	2,676.00	19,534,800	
コナカ	22,800	291.00	6,634,800	貸付有価証券 10,700株
ハウス オブ ローゼ	2,400	1,599.00	3,837,600	貸付有価証券 200株（200株）
G - 7ホールディングス	11,400	2,963.00	33,778,200	
イオン北海道	25,500	785.00	20,017,500	
コジマ	33,200	564.00	18,724,800	貸付有価証券 12,300株
ヒマラヤ	6,800	919.00	6,249,200	
コーナン商事	27,500	3,735.00	102,712,500	貸付有価証券 300株
エコス	7,100	2,116.00	15,023,600	貸付有価証券 900株

ワタミ	22,800	1,070.00	24,396,000	貸付有価証券 10,700株
マルシェ	5,100	598.00	3,049,800	貸付有価証券 2,300株
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	424,700	2,400.00	1,019,280,000	貸付有価証券 1,000株
西松屋チェーン	42,400	1,241.00	52,618,400	貸付有価証券 1,200株
ゼンショーホールディン グス	92,600	2,522.00	233,537,200	貸付有価証券 43,500株
幸楽苑ホールディングス	12,300	1,727.00	21,242,100	貸付有価証券 2,400株(700株)
ハークスレイ	4,000	980.00	3,920,000	
サイゼリヤ	28,600	2,009.00	57,457,400	貸付有価証券 200株
V Tホールディングス	80,000	385.00	30,800,000	
魚力	5,300	1,850.00	9,805,000	貸付有価証券 2,400株
ポブラ	5,000	401.00	2,005,000	貸付有価証券 1,800株
フジ・コーポレーション	5,100	2,101.00	10,715,100	
ユナイテッドアローズ	20,200	1,568.00	31,673,600	貸付有価証券 700株
ハイデイ日高	27,900	1,794.00	50,052,600	
京都きもの友禅	12,300	232.00	2,853,600	
コロワイド	64,200	1,700.00	109,140,000	貸付有価証券 30,100株(1,600株)
ピーシーデポコーポレー ション	25,600	688.00	17,612,800	貸付有価証券 3,900株
壱番屋	13,600	5,340.00	72,624,000	
トップカルチャー	7,000	420.00	2,940,000	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
P L A N T	4,900	785.00	3,846,500	貸付有価証券 2,300株
スギホールディングス	38,600	7,510.00	289,886,000	貸付有価証券 200株
薬王堂ホールディングス	8,400	2,418.00	20,311,200	
スクロール	29,700	877.00	26,046,900	貸付有価証券 2,300株
ヨンドシーホールディン グス	19,600	1,799.00	35,260,400	貸付有価証券 100株

ファミリーマート	154,300	2,364.00	364,765,200	
木曽路	25,200	2,450.00	61,740,000	貸付有価証券 11,800株(600株)
S R Sホールディングス	22,800	973.00	22,184,400	貸付有価証券 10,800株
千趣会	34,900	347.00	12,110,300	
タカキュー	14,900	131.00	1,951,900	貸付有価証券 300株(300株)
リテールパートナーズ	25,600	1,738.00	44,492,800	貸付有価証券 5,700株(5,700株)
ケーヨー	39,700	817.00	32,434,900	
上新電機	22,700	2,333.00	52,959,100	
日本瓦斯	30,500	4,400.00	134,200,000	
ロイヤルホールディングス	33,700	1,855.00	62,513,500	貸付有価証券 1,100株(300株)
東天紅	1,400	999.00	1,398,600	貸付有価証券 500株
いなげや	23,900	1,793.00	42,852,700	
島忠	36,300	2,811.00	102,039,300	貸付有価証券 300株
チヨダ	20,300	967.00	19,630,100	貸付有価証券 100株
ライフコーポレーション	14,600	4,510.00	65,846,000	貸付有価証券 200株
リンガーハット	23,800	2,503.00	59,571,400	
MrMaxHD	26,500	817.00	21,650,500	
テンアライド	17,800	393.00	6,995,400	貸付有価証券 8,400株
AOKIホールディングス	38,600	579.00	22,349,400	貸付有価証券 500株
オークワ	30,300	1,340.00	40,602,000	
コメリ	29,800	3,150.00	93,870,000	
青山商事	39,900	605.00	24,139,500	貸付有価証券 16,100株
しまむら	22,500	8,550.00	192,375,000	貸付有価証券 400株
はせがわ	10,200	286.00	2,917,200	
高島屋	140,700	845.00	118,891,500	貸付有価証券 24,600株
松屋	38,900	623.00	24,234,700	貸付有価証券

				16,800株
エイチ・ツー・オー テイリング	91,500	724.00	66,246,000	貸付有価証券 43,000株
近鉄百貨店	7,400	2,819.00	20,860,600	貸付有価証券 3,400株
丸井グループ	177,100	1,885.00	333,833,500	貸付有価証券 100株
アクシアル リテイリ ング	16,000	4,635.00	74,160,000	
井筒屋	10,500	171.00	1,795,500	貸付有価証券 4,800株
イオン	743,400	2,646.50	1,967,408,100	貸付有価証券 28,800株
イズミ	39,300	3,840.00	150,912,000	貸付有価証券 800株
平和堂	39,200	2,127.00	83,378,400	
フジ	23,300	1,780.00	41,474,000	貸付有価証券 100株
ヤオコー	21,900	7,770.00	170,163,000	貸付有価証券 8,200株
ゼビオホールディングス	23,300	748.00	17,428,400	
ケースホールディングス	186,400	1,443.00	268,975,200	貸付有価証券 800株
O l y m p i cグループ	10,000	843.00	8,430,000	
日産東京販売ホールディ ングス	28,400	251.00	7,128,400	貸付有価証券 100株
シルバーライフ	2,600	2,092.00	5,439,200	貸付有価証券 1,200株
一家ダイニングプロジェ クト	2,000	598.00	1,196,000	
Genky Drug S tores	8,500	3,510.00	29,835,000	
ナルミヤ・インターナ ショナル	4,300	570.00	2,451,000	
ブックオフグループホー ルディングス	11,300	859.00	9,706,700	貸付有価証券 5,200株(400株)
アインホールディングス	23,700	6,740.00	159,738,000	
元気寿司	4,900	2,426.00	11,887,400	貸付有価証券 2,500株
ヤマダ電機	588,600	550.00	323,730,000	貸付有価証券 2,700株
アークランドサカモト	30,200	2,015.00	60,853,000	貸付有価証券

				7,200株(7,200株)
ニトリホールディングス	83,600	21,325.00	1,782,770,000	貸付有価証券 3,500株
グルメ杵屋	13,800	1,049.00	14,476,200	貸付有価証券 6,400株
愛眼	15,400	221.00	3,403,400	
ケーユーホールディングス	10,100	798.00	8,059,800	
吉野家ホールディングス	63,500	2,101.00	133,413,500	貸付有価証券 17,000株(12,300株)
松屋フーズホールディングス	9,300	3,580.00	33,294,000	
サガミホールディングス	25,800	1,398.00	36,068,400	貸付有価証券 12,300株
関西スーパーマーケット	16,000	1,243.00	19,888,000	
王将フードサービス	14,200	6,030.00	85,626,000	
プレナス	21,600	1,750.00	37,800,000	貸付有価証券 8,300株
ミニストップ	14,300	1,458.00	20,849,400	
アークス	39,500	2,498.00	98,671,000	
バローホールディングス	42,700	2,603.00	111,148,100	
藤久	2,000	2,066.00	4,132,000	貸付有価証券 100株
ベルク	9,500	7,010.00	66,595,000	
大庄	10,300	1,203.00	12,390,900	
ファーストリテイリング	25,800	66,070.00	1,704,606,000	貸付有価証券 1,300株
サンドラッグ	72,700	3,850.00	279,895,000	
サックスパーホールディングス	16,400	537.00	8,806,800	
ヤマザワ	4,500	1,751.00	7,879,500	
やまや	4,000	2,205.00	8,820,000	貸付有価証券 1,800株
ベルーナ	41,500	953.00	39,549,500	貸付有価証券 200株
島根銀行	5,100	679.00	3,462,900	
じもとホールディングス	130,700	115.00	15,030,500	貸付有価証券 300株
めぶきフィナンシャルグループ	1,005,200	259.00	260,346,800	

東京きらぼしフィナンシャルグループ	26,100	1,158.00	30,223,800	
九州フィナンシャルグループ	423,300	488.00	206,570,400	貸付有価証券 1,900株
ゆうちょ銀行	548,100	848.00	464,788,800	貸付有価証券 256,600株
富山第一銀行	46,100	298.00	13,737,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,104,900	373.00	412,127,700	貸付有価証券 7,100株
西日本フィナンシャルホールディングス	128,700	732.00	94,208,400	貸付有価証券 1,700株
関西みらいフィナンシャルグループ	113,500	463.00	52,550,500	貸付有価証券 8,600株
三十三フィナンシャルグループ	17,900	1,384.00	24,773,600	貸付有価証券 8,400株
第四北越フィナンシャルグループ	33,600	2,106.00	70,761,600	貸付有価証券 200株
新生銀行	142,000	1,345.00	190,990,000	
あおぞら銀行	115,300	1,910.00	220,223,000	貸付有価証券 54,100株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	13,233,400	443.40	5,867,689,560	貸付有価証券 400株
りそなホールディングス	2,103,200	394.60	829,922,720	貸付有価証券 40,700株
三井住友トラスト・ホールディングス	365,700	3,061.00	1,119,407,700	
三井住友フィナンシャルグループ	1,337,900	3,140.00	4,201,006,000	貸付有価証券 12,700株
千葉銀行	645,600	578.00	373,156,800	貸付有価証券 400株
群馬銀行	371,600	357.00	132,661,200	
武蔵野銀行	28,800	1,616.00	46,540,800	
千葉興業銀行	53,000	272.00	14,416,000	貸付有価証券 500株（100株）
筑波銀行	80,400	222.00	17,848,800	貸付有価証券 100株
七十七銀行	65,400	1,594.00	104,247,600	
青森銀行	15,000	2,374.00	35,610,000	
秋田銀行	12,400	1,622.00	20,112,800	貸付有価証券 5,800株
山形銀行	21,700	1,332.00	28,904,400	

岩手銀行	12,700	2,546.00	32,334,200	
東邦銀行	173,000	229.00	39,617,000	
東北銀行	9,300	1,035.00	9,625,500	
みちのく銀行	12,400	1,154.00	14,309,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	163,000	1,856.00	302,528,000	
静岡銀行	471,100	755.00	355,680,500	貸付有価証券 200株
十六銀行	24,200	1,964.00	47,528,800	貸付有価証券 11,300株
スルガ銀行	197,900	397.00	78,566,300	貸付有価証券 300株
八十二銀行	466,900	416.00	194,230,400	
山梨中央銀行	22,500	833.00	18,742,500	
大垣共立銀行	38,200	2,210.00	84,422,000	貸付有価証券 17,900株
福井銀行	16,500	1,695.00	27,967,500	
北國銀行	19,300	2,999.00	57,880,700	
清水銀行	8,000	1,779.00	14,232,000	
富山銀行	3,700	2,439.00	9,024,300	
滋賀銀行	38,800	2,507.00	97,271,600	
南都銀行	32,200	1,951.00	62,822,200	
百五銀行	174,100	319.00	55,537,900	
京都銀行	69,300	4,735.00	328,135,500	
紀陽銀行	68,500	1,569.00	107,476,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	128,800	992.00	127,769,600	
広島銀行	285,600	560.00	159,936,000	
山陰合同銀行	114,700	542.00	62,167,400	
中国銀行	166,500	976.00	162,504,000	
鳥取銀行	6,600	1,185.00	7,821,000	
伊予銀行	276,000	682.00	188,232,000	
百十四銀行	20,600	1,808.00	37,244,800	
四国銀行	29,400	770.00	22,638,000	
阿波銀行	31,600	2,439.00	77,072,400	貸付有価証券 800株
大分銀行	11,100	2,508.00	27,838,800	
宮崎銀行	12,900	2,397.00	30,921,300	

佐賀銀行	11,700	1,336.00	15,631,200	
沖縄銀行	17,700	2,946.00	52,144,200	
琉球銀行	44,600	884.00	39,426,400	
セブン銀行	646,300	261.00	168,684,300	貸付有価証券 1,000株
みずほフィナンシャルグループ	26,287,000	143.00	3,759,041,000	貸付有価証券 150,700株
高知銀行	7,000	769.00	5,383,000	
山口フィナンシャルグループ	241,500	713.00	172,189,500	
長野銀行	6,300	1,184.00	7,459,200	
名古屋銀行	14,500	2,421.00	35,104,500	
北洋銀行	291,600	232.00	67,651,200	
愛知銀行	7,000	3,020.00	21,140,000	
中京銀行	7,900	2,041.00	16,123,900	
大光銀行	6,600	1,304.00	8,606,400	
愛媛銀行	27,000	1,155.00	31,185,000	貸付有価証券 1,300株
トマト銀行	7,500	1,030.00	7,725,000	貸付有価証券 2,200株
京葉銀行	82,500	501.00	41,332,500	貸付有価証券 38,700株
栃木銀行	93,400	205.00	19,147,000	貸付有価証券 100株
北日本銀行	6,000	1,745.00	10,470,000	
東和銀行	34,000	721.00	24,514,000	
福島銀行	18,200	258.00	4,695,600	貸付有価証券 8,500株
大東銀行	10,100	670.00	6,767,000	
トモニホールディングス	149,600	339.00	50,714,400	貸付有価証券 100株
フィデアホールディングス	187,800	114.00	21,409,200	
池田泉州ホールディングス	222,500	176.00	39,160,000	貸付有価証券 14,000株
F P G	59,700	605.00	36,118,500	貸付有価証券 26,000株（100株）
マーキュリアインベストメント	7,500	657.00	4,927,500	
S B I ホールディングス	216,100	2,683.00	579,796,300	貸付有価証券

				100株
日本アジア投資	16,300	228.00	3,716,400	貸付有価証券 400株
ジャフコ	29,700	4,275.00	126,967,500	
大和証券グループ本社	1,552,300	470.70	730,667,610	貸付有価証券 700株
野村ホールディングス	3,403,900	539.70	1,837,084,830	貸付有価証券 1,400株
岡三証券グループ	164,800	331.00	54,548,800	貸付有価証券 300株
丸三証券	57,500	428.00	24,610,000	貸付有価証券 13,600株
東洋証券	69,200	110.00	7,612,000	貸付有価証券 600株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	222,200	263.00	58,438,600	
光世証券	4,600	580.00	2,668,000	
水戸証券	56,000	200.00	11,200,000	貸付有価証券 300株
いちよし証券	36,200	454.00	16,434,800	
松井証券	110,500	953.00	105,306,500	貸付有価証券 400株
マネックスグループ	141,900	267.00	37,887,300	貸付有価証券 53,300株(37,400株)
極東証券	25,900	579.00	14,996,100	
岩井コスモホールディングス	18,300	1,262.00	23,094,600	貸付有価証券 400株
藍澤証券	34,700	691.00	23,977,700	
マネーパートナーズグループ	20,600	210.00	4,326,000	
スパークス・グループ	89,300	198.00	17,681,400	
小林洋行	5,500	254.00	1,397,000	貸付有価証券 100株
かんぽ生命保険	68,500	1,653.00	113,230,500	貸付有価証券 4,100株
SOMPOホールディングス	363,700	3,877.00	1,410,064,900	貸付有価証券 2,100株
アニコムホールディングス	16,000	4,230.00	67,680,000	
MS&ADインシュアランスグループホール	505,800	2,929.00	1,481,488,200	貸付有価証券 1,000株

第一生命ホールディングス	1,094,700	1,576.50	1,725,794,550	貸付有価証券 1,700株
東京海上ホールディングス	684,000	4,817.00	3,294,828,000	貸付有価証券 7,500株
T & Dホールディングス	578,200	1,120.00	647,584,000	
アドバンスクリエイト	4,000	2,170.00	8,680,000	貸付有価証券 1,800株
全国保証	54,500	3,915.00	213,367,500	貸付有価証券 8,600株(6,600株)
ジェイリース	5,400	572.00	3,088,800	貸付有価証券 1,000株(900株)
イントラスト	6,800	841.00	5,718,800	貸付有価証券 800株
日本モーゲージサービス	7,800	1,101.00	8,587,800	貸付有価証券 200株(200株)
C a s a	6,700	1,147.00	7,684,900	
アルヒ	30,800	1,656.00	51,004,800	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
プレミアグループ	10,500	1,956.00	20,538,000	
クレディセゾン	135,500	1,188.00	160,974,000	貸付有価証券 100株
芙蓉総合リース	20,300	6,620.00	134,386,000	
みずほリース	29,800	2,701.00	80,489,800	貸付有価証券 700株
東京センチュリー	39,000	5,640.00	219,960,000	貸付有価証券 3,800株
日本証券金融	85,300	549.00	46,829,700	貸付有価証券 100株
アイフル	295,100	256.00	75,545,600	貸付有価証券 10,900株
リコーリース	15,200	2,726.00	41,435,200	貸付有価証券 300株
イオンフィナンシャルサービス	118,400	953.00	112,835,200	
アコム	388,800	413.00	160,574,400	貸付有価証券 700株
ジャックス	21,400	1,751.00	37,471,400	貸付有価証券 3,600株
オリエントコーポレーション	523,300	117.00	61,226,100	貸付有価証券 100株
日立キャピタル	45,600	2,550.00	116,280,000	

アプラスフィナンシャル	92,800	73.00	6,774,400	貸付有価証券 5,700株(200株)
オリックス	1,200,200	1,364.50	1,637,672,900	貸付有価証券 100株
三菱UFJリース	491,000	510.00	250,410,000	
九州リースサービス	9,500	593.00	5,633,500	
日本取引所グループ	555,200	2,795.00	1,551,784,000	貸付有価証券 1,400株
イー・ギャランティ	21,200	2,186.00	46,343,200	
アサックス	10,000	716.00	7,160,000	貸付有価証券 3,800株
NECキャピタルソリューション	7,900	1,845.00	14,575,500	
いちご	246,200	284.00	69,920,800	
日本駐車場開発	190,900	132.00	25,198,800	貸付有価証券 4,300株
スター・マイカ・ホールディングス	10,000	1,250.00	12,500,000	貸付有価証券 100株
ADワークスグループ	35,900	159.00	5,708,100	
ヒューリック	410,400	973.00	399,319,200	貸付有価証券 63,500株
三栄建築設計	7,800	1,444.00	11,263,200	
野村不動産ホールディングス	117,500	2,066.00	242,755,000	貸付有価証券 1,600株
三重交通グループホールディングス	39,200	450.00	17,640,000	貸付有価証券 18,300株
サムティ	27,500	1,479.00	40,672,500	貸付有価証券 1,200株
ディア・ライフ	27,300	574.00	15,670,200	貸付有価証券 12,800株
コーセーアールイー	5,700	487.00	2,775,900	
日本商業開発	12,200	1,688.00	20,593,600	貸付有価証券 5,700株
プレサンスコーポレーション	31,800	1,391.00	44,233,800	貸付有価証券 500株(400株)
ハウスコム	3,300	1,232.00	4,065,600	
日本管理センター	10,400	1,218.00	12,667,200	
サンセイランディック	5,700	717.00	4,086,900	
エストラスト	2,600	645.00	1,677,000	
フージャースホールディ	38,600	627.00	24,202,200	

ングス				
オープンハウス	60,900	3,515.00	214,063,500	
東急不動産ホールディングス	526,000	468.00	246,168,000	貸付有価証券 200株
飯田グループホールディングス	161,400	2,085.00	336,519,000	
イーグランド	3,100	725.00	2,247,500	
ムゲンエステート	11,900	473.00	5,628,700	貸付有価証券 1,300株
ピーロット	9,000	685.00	6,165,000	
ファーストブラザーズ	3,500	870.00	3,045,000	
ハウズドゥ	9,500	1,011.00	9,604,500	貸付有価証券 2,500株
シーアールイー	5,000	1,436.00	7,180,000	
プロパティエージェント	3,100	1,198.00	3,713,800	貸付有価証券 1,400株
ケイアイスター不動産	6,100	2,425.00	14,792,500	貸付有価証券 2,800株
アグレ都市デザイン	3,100	571.00	1,770,100	
グッドコムアセット	4,600	2,105.00	9,683,000	貸付有価証券 700株
ジェイ・エス・ピー	3,600	2,873.00	10,342,800	
テンポイノベーション	4,300	729.00	3,134,700	貸付有価証券 2,000株（200株）
グローバル・リンク・マネジメント	3,200	605.00	1,936,000	
パーク24	103,800	1,810.00	187,878,000	貸付有価証券 12,800株
パラカ	5,000	1,723.00	8,615,000	貸付有価証券 2,300株
三井不動産	954,100	1,926.50	1,838,073,650	貸付有価証券 17,100株
三菱地所	1,355,400	1,650.50	2,237,087,700	貸付有価証券 1,900株
平和不動産	35,500	2,788.00	98,974,000	貸付有価証券 1,200株
東京建物	191,100	1,327.00	253,589,700	貸付有価証券 10,900株（700株）
ダイビル	49,800	1,130.00	56,274,000	貸付有価証券 3,300株
京阪神ビルディング	31,000	1,532.00	47,492,000	

住友不動産	434,900	3,175.00	1,380,807,500	貸付有価証券 5,800株
テーオーシー	38,000	669.00	25,422,000	
東京楽天地	3,200	4,020.00	12,864,000	
レオパレス21	253,500	177.00	44,869,500	貸付有価証券 67,200株(44,700株)
スターツコーポレーション	26,300	2,238.00	58,859,400	
フジ住宅	22,400	514.00	11,513,600	
空港施設	19,400	431.00	8,361,400	
明和地所	10,600	534.00	5,660,400	
ゴールドクレスト	15,300	1,461.00	22,353,300	貸付有価証券 3,200株
エスリード	7,500	1,301.00	9,757,500	
日神グループホールディングス	28,600	401.00	11,468,600	
日本エスコン	35,000	789.00	27,615,000	
タカラレーベン	88,400	344.00	30,409,600	
A V A N T I A	10,900	770.00	8,393,000	貸付有価証券 200株
イオンモール	97,000	1,403.00	136,091,000	貸付有価証券 200株
毎日コムネット	4,900	761.00	3,728,900	
ファースト住建	8,200	1,005.00	8,241,000	
カチタス	47,900	2,868.00	137,377,200	
トーセイ	26,700	976.00	26,059,200	
穴吹興産	4,200	1,475.00	6,195,000	
サンフロンティア不動産	26,700	822.00	21,947,400	
エフ・ジェー・ネクスト	16,900	832.00	14,060,800	貸付有価証券 1,300株
インテリックス	5,400	491.00	2,651,400	
ランドビジネス	6,500	363.00	2,359,500	
サンネクスタグループ	6,000	910.00	5,460,000	
グランディハウス	15,000	357.00	5,355,000	
日本空港ビルデング	61,700	4,870.00	300,479,000	貸付有価証券 14,500株
日本工営	12,600	2,676.00	33,717,600	
L I F U L L	65,400	460.00	30,084,000	
ミクシィ	35,700	2,569.00	91,713,300	貸付有価証券

				14,500株(4,300株)
ジェイエイシーリクルートメント	12,600	1,279.00	16,115,400	貸付有価証券 2,200株(2,100株)
日本M&Aセンター	143,400	5,200.00	745,680,000	貸付有価証券 500株
メンバーズ	5,500	1,636.00	8,998,000	貸付有価証券 1,500株
中広	2,600	548.00	1,424,800	貸付有価証券 1,200株
UTグループ	29,500	3,310.00	97,645,000	貸付有価証券 11,800株(4,900株)
アイティメディア	7,500	2,300.00	17,250,000	貸付有価証券 1,000株(100株)
タケエイ	20,500	968.00	19,844,000	貸付有価証券 6,600株
E・Jホールディングス	3,300	2,323.00	7,665,900	
ビーネックスグループ	23,500	1,184.00	27,824,000	貸付有価証券 700株
コシダカホールディングス	45,100	436.00	19,663,600	貸付有価証券 11,700株
アルトナー	4,500	1,029.00	4,630,500	
パソナグループ	20,300	1,456.00	29,556,800	貸付有価証券 2,400株
CDS	4,600	1,305.00	6,003,000	
リンクアンドモチベーション	34,400	363.00	12,487,200	貸付有価証券 16,100株(5,400株)
GCA	24,100	643.00	15,496,300	
エス・エム・エス	58,300	2,885.00	168,195,500	
サニーサイドアップグループ	6,500	712.00	4,628,000	貸付有価証券 400株(300株)
パーソルホールディングス	187,400	1,713.00	321,016,200	貸付有価証券 1,500株
リニカル	9,000	788.00	7,092,000	貸付有価証券 1,000株
クックパッド	58,900	356.00	20,968,400	貸付有価証券 6,100株(2,700株)
エスクリ	5,800	356.00	2,064,800	貸付有価証券 2,700株
アイ・ケイ・ケイ	9,100	583.00	5,305,300	
学情	6,600	1,046.00	6,903,600	
スタジオアリス	9,400	1,622.00	15,246,800	貸付有価証券

				4,300株
シミックホールディングス	9,200	1,280.00	11,776,000	
エプロ	4,500	957.00	4,306,500	
N J S	4,600	1,799.00	8,275,400	
総合警備保障	74,600	5,000.00	373,000,000	貸付有価証券 600株
カカクコム	138,500	2,654.00	367,579,000	
セントケア・ホールディング	12,200	670.00	8,174,000	貸付有価証券 6,600株
サイネックス	3,200	770.00	2,464,000	
ルネサンス	10,400	957.00	9,952,800	貸付有価証券 4,800株
ディップ	25,600	2,338.00	59,852,800	貸付有価証券 100株
デジタルホールディングス	13,100	1,269.00	16,623,900	
新日本科学	20,300	682.00	13,844,600	貸付有価証券 4,200株(2,500株)
ツクイ	44,100	621.00	27,386,100	
キャリアデザインセンター	4,300	897.00	3,857,100	
ベネフィット・ワン	68,200	2,451.00	167,158,200	貸付有価証券 2,000株
エムスリー	413,300	6,340.00	2,620,322,000	貸付有価証券 400株
ツカダ・グローバルホールディング	14,900	280.00	4,172,000	
プラス	2,400	498.00	1,195,200	
アウトソーシング	107,300	950.00	101,935,000	貸付有価証券 6,700株
ウェルネット	18,900	620.00	11,718,000	
ワールドホールディングス	6,400	1,891.00	12,102,400	貸付有価証券 100株
ディー・エヌ・エー	79,300	1,762.00	139,726,600	貸付有価証券 2,200株
博報堂D Yホールディングス	260,600	1,360.00	354,416,000	
ぐるなび	32,600	747.00	24,352,200	貸付有価証券 100株
タカミヤ	19,900	526.00	10,467,400	

ジャパンベストレス キューシステム	14,800	961.00	14,222,800	貸付有価証券 1,300株
ファンコミュニケーションズ	51,500	459.00	23,638,500	貸付有価証券 200株
ライク	6,200	1,808.00	11,209,600	貸付有価証券 100株
ビジネス・ブレークス ルー	7,800	398.00	3,104,400	
エスプール	48,100	729.00	35,064,900	
WDBホールディングス	8,600	2,889.00	24,845,400	貸付有価証券 700株
手間いらず	1,200	5,180.00	6,216,000	貸付有価証券 500株(300株)
ティア	10,900	459.00	5,003,100	
CDG	2,000	1,724.00	3,448,000	貸付有価証券 900株
バリューコマース	12,600	3,270.00	41,202,000	
インフォマート	189,600	719.00	136,322,400	貸付有価証券 12,700株(2,600株)
JPホールディングス	58,800	284.00	16,699,200	貸付有価証券 1,500株
EPSホールディングス	25,400	1,011.00	25,679,400	
レッグス	4,600	976.00	4,489,600	
プレステージ・インター ナショナル	70,200	904.00	63,460,800	
アミューズ	10,200	2,347.00	23,939,400	
ドリームインキュベータ	5,700	1,400.00	7,980,000	
クイック	11,600	1,230.00	14,268,000	
TAC	11,300	230.00	2,599,000	
ケネディクス	161,200	526.00	84,791,200	貸付有価証券 400株
電通グループ	210,800	2,952.00	622,281,600	貸付有価証券 11,500株
テイクアンドギヴ・ニ ーズ	7,200	568.00	4,089,600	
ぴあ	5,400	3,015.00	16,281,000	貸付有価証券 2,500株(1,400株)
イオンファンタジー	7,200	1,740.00	12,528,000	貸付有価証券 3,100株(3,000株)
シーティーエス	21,100	907.00	19,137,700	
ネクシィーズグループ	5,700	936.00	5,335,200	貸付有価証券

				1,700株(1,700株)
H.U.グループホールディングス	52,400	2,692.00	141,060,800	貸付有価証券 1,100株
アルプス技研	16,600	1,846.00	30,643,600	
ダイオーズ	3,700	1,028.00	3,803,600	貸付有価証券 2,100株
日本空調サービス	19,600	723.00	14,170,800	
オリエンタルランド	199,300	14,465.00	2,882,874,500	貸付有価証券 1,500株
ダスキン	46,600	2,713.00	126,425,800	
明光ネットワークジャパン	23,700	752.00	17,822,400	
ファルコホールディングス	10,300	1,506.00	15,511,800	貸付有価証券 4,800株
秀英予備校	4,100	446.00	1,828,600	貸付有価証券 100株
ラウンドワン	52,300	825.00	43,147,500	貸付有価証券 9,400株
リゾートトラスト	85,900	1,540.00	132,286,000	貸付有価証券 3,100株
ビー・エム・エル	24,100	2,826.00	68,106,600	
ワタベウェディング	2,400	270.00	648,000	貸付有価証券 100株
りらいあコミュニケーションズ	33,900	1,260.00	42,714,000	
リソー教育	85,600	286.00	24,481,600	
早稲田アカデミー	8,100	958.00	7,759,800	貸付有価証券 3,700株
ユー・エス・エス	209,800	1,791.00	375,751,800	
東京個別指導学院	6,600	556.00	3,669,600	
サイバーエージェント	115,500	5,580.00	644,490,000	貸付有価証券 1,300株
楽天	873,600	982.00	857,875,200	貸付有価証券 2,100株
クリーク・アンド・リバー社	9,800	1,244.00	12,191,200	
テー・オー・ダブリュー	29,800	313.00	9,327,400	貸付有価証券 100株
山田コンサルティンググループ	12,100	1,062.00	12,850,200	
セントラルスポーツ	7,000	2,375.00	16,625,000	貸付有価証券

				3,200株
フルキャストホールディングス	16,400	1,667.00	27,338,800	貸付有価証券 300株
エン・ジャパン	33,300	2,963.00	98,667,900	貸付有価証券 500株
リソルホールディングス	2,000	3,425.00	6,850,000	
テクノプロ・ホールディングス	37,400	5,830.00	218,042,000	
アトラ	4,300	281.00	1,208,300	
インターワークス	3,600	340.00	1,224,000	
アイ・アールジャパン ホールディングス	7,600	13,210.00	100,396,000	
K e e P e r 技研	6,900	2,765.00	19,078,500	
ファーストロジック	3,600	782.00	2,815,200	貸付有価証券 200株
三機サービス	3,600	1,053.00	3,790,800	
G u n o s y	11,600	906.00	10,509,600	貸付有価証券 600株(600株)
デザインワン・ジャパン	5,500	285.00	1,567,500	
イー・ガーディアン	8,200	3,100.00	25,420,000	
リブセンス	10,300	283.00	2,914,900	貸付有価証券 100株
ジャパンマテリアル	57,600	1,400.00	80,640,000	貸付有価証券 100株
ベクトル	23,400	905.00	21,177,000	貸付有価証券 300株
ウチヤマホールディングス	9,200	302.00	2,778,400	
チャーム・ケア・コーポ レーション	15,900	1,068.00	16,981,200	
キャリアリンク	6,100	784.00	4,782,400	
I B J	15,300	1,043.00	15,957,900	
アサンテ	7,500	1,525.00	11,437,500	貸付有価証券 3,500株(100株)
N・フィールド	12,900	641.00	8,268,900	貸付有価証券 500株
バリューHR	7,400	1,508.00	11,159,200	
M & A キャピタルパート ナーズ	15,200	3,755.00	57,076,000	
ライドオンエクスプレス ホールディングス	7,200	2,198.00	15,825,600	貸付有価証券 3,300株(3,300株)

E R Iホールディングス	5,200	602.00	3,130,400	
アビスト	2,900	3,035.00	8,801,500	
シグマクシス	12,800	1,498.00	19,174,400	貸付有価証券 6,000株
ウィルグループ	12,200	784.00	9,564,800	
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	27,700	312.00	8,642,400	貸付有価証券 3,600株
リクルートホールディン グス	1,342,600	3,971.00	5,331,464,600	貸付有価証券 13,200株
エラン	12,900	2,446.00	31,553,400	
土木管理総合試験所	9,100	359.00	3,266,900	
ネットマーケティング	7,200	603.00	4,341,600	貸付有価証券 2,700株(2,100株)
日本郵政	1,536,200	761.10	1,169,201,820	貸付有価証券 3,500株
ベルシステム24ホール ディングス	31,400	1,733.00	54,416,200	貸付有価証券 600株
鎌倉新書	14,200	894.00	12,694,800	貸付有価証券 3,700株(100株)
S M N	4,000	902.00	3,608,000	
一蔵	2,000	359.00	718,000	
L I T A L I C O	6,400	2,676.00	17,126,400	貸付有価証券 600株(600株)
グローバルキッズCOM P A N Y	3,400	699.00	2,376,600	
エアトリ	9,800	1,351.00	13,239,800	貸付有価証券 4,600株(100株)
ハイアス・アンド・カン パニー	11,700	281.00	3,287,700	貸付有価証券 5,400株
アトラエ	5,700	3,255.00	18,553,500	貸付有価証券 900株
ストライク	7,100	4,640.00	32,944,000	貸付有価証券 100株
ソラスト	51,700	1,303.00	67,365,100	
セラク	5,900	1,666.00	9,829,400	貸付有価証券 2,400株
インソース	7,800	2,656.00	20,716,800	貸付有価証券 3,200株(1,100株)
ベイカレント・コンサル ティング	11,400	12,190.00	138,966,000	
O r c h e s t r a H	3,900	1,668.00	6,505,200	貸付有価証券

oldings				1,800株
アイモバイル	6,600	879.00	5,801,400	貸付有価証券 1,800株(1,700株)
キャリアインデックス	7,700	465.00	3,580,500	貸付有価証券 1,500株(700株)
MS - Japan	6,100	803.00	4,898,300	貸付有価証券 300株(300株)
船場	3,700	893.00	3,304,100	
グレイステクノロジー	8,600	4,420.00	38,012,000	貸付有価証券 100株
ジャパンエレベーター サービスホールディング	20,900	3,660.00	76,494,000	
フルテック	2,600	1,304.00	3,390,400	
グリーンズ	4,700	508.00	2,387,600	貸付有価証券 600株
ツナググループ・ホール ディングス	3,100	485.00	1,503,500	貸付有価証券 600株
GameWith	5,500	653.00	3,591,500	貸付有価証券 400株
ソウルドアウト	4,500	1,535.00	6,907,500	
MS&Consulting	3,500	778.00	2,723,000	貸付有価証券 400株(400株)
エル・ティー・エス	1,300	4,285.00	5,570,500	貸付有価証券 600株
ミダック	2,400	2,126.00	5,102,400	
日総工産	12,500	794.00	9,925,000	貸付有価証券 600株
キュービーネットホール ディングス	7,800	1,947.00	15,186,600	
RPAホールディングス	14,300	811.00	11,597,300	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
スプリックス	5,300	885.00	4,690,500	貸付有価証券 400株(400株)
マネジメントソリューションズ	9,100	1,312.00	11,939,200	貸付有価証券 4,200株(300株)
プロレド・パートナーズ	2,500	5,510.00	13,775,000	
and factory	1,800	923.00	1,661,400	
ピアラ	1,000	1,863.00	1,863,000	貸付有価証券 600株
ギークス	1,900	1,264.00	2,401,600	貸付有価証券 800株(800株)

カーブスホールディングス	51,400	681.00	35,003,400	貸付有価証券 2,400株（2,200株）
フォーラムエンジニアリング	9,800	733.00	7,183,400	
アドバンテッジリスクマネジメント	9,500	738.00	7,011,000	
リログループ	102,500	2,323.00	238,107,500	貸付有価証券 2,100株
東祥	11,700	1,384.00	16,192,800	
エイチ・アイ・エス	29,200	1,990.00	58,108,000	貸付有価証券 11,600株（4,000株）
ラックランド	5,300	2,255.00	11,951,500	
共立メンテナンス	31,000	3,980.00	123,380,000	貸付有価証券 3,900株
イチネンホールディングス	21,000	1,208.00	25,368,000	
建設技術研究所	12,100	1,906.00	23,062,600	
スペース	12,100	782.00	9,462,200	貸付有価証券 1,300株
長大	7,500	1,288.00	9,660,000	
燦ホールディングス	8,100	1,107.00	8,966,700	
スバル興業	1,100	7,740.00	8,514,000	
東京テアトル	7,300	1,280.00	9,344,000	貸付有価証券 3,400株
タナベ経営	3,600	1,380.00	4,968,000	
ナガワ	6,000	6,780.00	40,680,000	
よみうりランド	4,100	3,980.00	16,318,000	貸付有価証券 1,900株
東京都競馬	12,300	5,040.00	61,992,000	
常磐興産	7,500	1,432.00	10,740,000	貸付有価証券 3,500株
カナモト	33,000	2,263.00	74,679,000	
東京ドーム	75,900	807.00	61,251,300	貸付有価証券 31,400株
西尾レントオール	17,300	2,384.00	41,243,200	貸付有価証券 100株
トランス・コスモス	17,800	2,712.00	48,273,600	貸付有価証券 600株
乃村工藝社	80,300	782.00	62,794,600	
藤田観光	7,400	1,579.00	11,684,600	貸付有価証券

				400株
KNT - CTホールディングス	11,700	1,173.00	13,724,100	貸付有価証券 5,400株
日本管財	20,100	2,000.00	40,200,000	貸付有価証券 200株
トーカイ	18,100	2,094.00	37,901,400	
白洋舎	2,100	2,492.00	5,233,200	貸付有価証券 900株
セコム	198,900	9,835.00	1,956,181,500	貸付有価証券 1,100株
セントラル警備保障	9,000	3,490.00	31,410,000	
丹青社	35,400	716.00	25,346,400	貸付有価証券 1,300株
メイテック	23,000	5,220.00	120,060,000	
応用地質	21,800	1,216.00	26,508,800	
船井総研ホールディングス	38,700	2,089.00	80,844,300	貸付有価証券 200株
進学会ホールディングス	7,300	431.00	3,146,300	
オオバ	13,300	740.00	9,842,000	貸付有価証券 100株(100株)
いであ	4,600	1,904.00	8,758,400	
学究社	5,500	1,086.00	5,973,000	
ベネッセホールディングス	62,400	2,639.00	164,673,600	
イオンディライト	23,100	2,991.00	69,092,100	
ナック	10,400	979.00	10,181,600	貸付有価証券 2,600株
ニチイ学館	17,800	1,662.00	29,583,600	
ダイセキ	31,400	2,591.00	81,357,400	
ステップ	6,900	1,558.00	10,750,200	
小計	銘柄数：2,153		442,397,201,860	
	組入時価比率：98.9%		100.0%	
合計			442,397,201,860	

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

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

(2)株式以外の有価証券(2020年9月7日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 9月 7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	4,816,525,704	-	4,869,210,000	52,534,311
合計	4,816,525,704	-	4,869,210,000	52,534,311

（注）時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2020年 9月 7日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	4,524,146,820
コール・ローン	399,944,837
株式	680,614,825,607
投資証券	16,636,127,808
派生商品評価勘定	21,463,143
未収入金	2,779,565
未収配当金	1,155,627,312
差入委託証拠金	4,023,312,753
流動資産合計	707,378,227,845
資産合計	707,378,227,845
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	150,602,319
未払解約金	874,763,762
未払利息	570
その他未払費用	5,704,600
流動負債合計	1,031,071,251
負債合計	1,031,071,251
純資産の部	
元本等	
元本	229,010,608,154
剰余金	

(2020年 9月 7日現在)

期末剰余金又は期末欠損金（ ）	477,336,548,440
元本等合計	706,347,156,594
純資産合計	706,347,156,594
負債純資産合計	707,378,227,845

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 9月 7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	3,0843円
(10,000口当たり純資産額)	(30,843円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 9月 7日

至 2020年 9月 7日

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月 7日現在

1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2.時価の算定方法

株式

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 9月 7日現在		
期首		2019年 9月 7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		215,181,030,662円
同期中における追加設定元本額		55,737,094,548円
同期中における一部解約元本額		41,907,517,056円
期末元本額		229,010,608,154円
期末元本額の内訳*		
バランスセレクト30		44,777,418円
バランスセレクト50		132,754,759円
バランスセレクト70		140,951,887円
野村外国株式インデックスファンド		495,978,873円
野村世界6資産分散投信(安定コース)		4,241,422,241円
野村世界6資産分散投信(分配コース)		5,540,120,347円
野村世界6資産分散投信(成長コース)		4,228,062,763円
野村資産設計ファンド2015		14,086,399円
野村資産設計ファンド2020		14,089,957円
野村資産設計ファンド2025		25,657,221円
野村資産設計ファンド2030		33,514,551円
野村資産設計ファンド2035		26,295,292円
野村資産設計ファンド2040		53,553,524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)		33,624,365,759円
のむらップ・ファンド(保守型)		963,944,064円
のむらップ・ファンド(普通型)		7,918,322,670円
のむらップ・ファンド(積極型)		5,878,811,016円
野村資産設計ファンド2045		8,231,088円
野村インデックスファンド・外国株式		5,425,150,664円
マイ・ロード		1,236,358,915円
ネクストコア		21,574,829円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		128,188,159円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)		1,955,418,310円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)		802,109,250円
野村資産設計ファンド2050		13,720,745円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型		4,487,436円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型		2,214,604円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型		1,738,910円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型		1,146,478円
のむらップ・ファンド(やや保守型)		196,475,126円
のむらップ・ファンド(やや積極型)		483,057,347円
インデックス・ブレンド(タイプ)		2,399,660円
インデックス・ブレンド(タイプ)		3,291,951円
インデックス・ブレンド(タイプ)		20,879,802円
インデックス・ブレンド(タイプ)		7,908,380円
インデックス・ブレンド(タイプ)		30,391,897円
野村6資産均等バランス		794,460,419円
野村つみたて外国株投信		5,672,330,253円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)		3,410,189,025円

世界6資産分散ファンド	56,271,397円
野村資産設計ファンド2060	4,990,322円
野村スリーゼロ先進国株式投信	41,660,919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	891,464,286円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	1,142,762,803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)	216,906,193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)	141,751,372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)	1,016,699,689円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	1,985,915,978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)	2,306,495円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	6,103,180円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	1,036,343円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	2,418,111円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	37,563,407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)	12,842,116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)	12,247,106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)	36,118,492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)	139,102,334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)	2,796,626,582円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	40,068,175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)	347,423,570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)	15,059,992,774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)	723,267円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,057,952円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	10,672,392円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	11,116,415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)	71,421,643,640円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,651,314,928円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	9,125,384,628円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	8,214,493,032円
マイバランスDC30	892,304,903円
マイバランスDC50	1,888,490,600円
マイバランスDC70	1,493,332,941円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	24,262,035,086円
野村DC運用戦略ファンド	340,774,035円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	26,384,115円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	304,550,360円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	242,120,976円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	210,890,727円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	12,472,056円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	5,972,437円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	27,083,808円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	3,951,242円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	3,018,200円

野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	2,918,975円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	107,360,426円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	77,298,612円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	37,300,286円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	42,878,744円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	1,359,738円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年9月7日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES CO	101,000	14.53	1,467,530.00	
		HALLIBURTON CO	135,000	15.99	2,158,650.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	58,000	12.15	704,700.00	
		SCHLUMBERGER LTD	216,000	19.31	4,170,960.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	64,000	18.33	1,173,120.00	
		CHENIERE ENERGY INC	36,400	52.05	1,894,620.00	
		CHEVRON CORP	289,800	81.93	23,743,314.00	
		CONCHO RESOURCES INC	31,000	50.65	1,570,150.00	
		CONOCOPHILLIPS	167,100	35.86	5,992,206.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	23,100	35.53	820,743.00	
		EOG RESOURCES INC	90,700	43.14	3,912,798.00	
		EXXON MOBIL CORP	656,500	39.08	25,656,020.00	
		HESS CORP	43,200	47.15	2,036,880.00	
		KINDER MORGAN INC	314,000	13.52	4,245,280.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	100,800	33.64	3,390,912.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	142,000	12.25	1,739,500.00	
		ONEOK INC	67,000	26.76	1,792,920.00	
		PHILLIPS 66	67,600	58.98	3,987,048.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	26,100	99.10	2,586,510.00	
		VALERO ENERGY CORP	62,700	51.22	3,211,494.00	
WILLIAMS COS	191,000	20.69	3,951,790.00			
AIR PRODUCTS	34,600	298.43	10,325,678.00			

ALBEMARLE CORP	16,700	94.72	1,581,824.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	36,000	23.07	830,520.00
CELANESE CORP-SERIES A	18,000	106.18	1,911,240.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	35,300	33.18	1,171,254.00
CORTEVA INC	120,000	29.32	3,518,400.00
DOW INC	115,600	48.60	5,618,160.00
DUPONT DE NEMOURS INC	115,500	58.80	6,791,400.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	20,800	78.93	1,641,744.00
ECOLAB INC	39,500	204.76	8,088,020.00
FMC CORP	19,600	108.48	2,126,208.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	13,600	123.12	1,674,432.00
LINDE PLC	81,500	247.70	20,187,550.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	42,100	72.06	3,033,726.00
MOSAIC CO/THE	56,000	18.53	1,037,680.00
PPG INDUSTRIES	36,800	122.61	4,512,048.00
RPM INTERNATIONAL INC	21,100	84.48	1,782,528.00
SHERWIN-WILLIAMS	12,620	679.62	8,576,804.40
MARTIN MARIETTA MATERIALS	9,700	215.11	2,086,567.00
VULCAN MATERIALS CO	20,800	125.00	2,600,000.00
AMCOR PLC	250,000	11.02	2,755,000.00
AVERY DENNISON CORP	13,400	119.08	1,595,672.00
BALL CORP	49,800	82.47	4,107,006.00
CROWN HOLDINGS INC	21,200	77.35	1,639,820.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	59,800	39.03	2,333,994.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	14,500	106.55	1,544,975.00
SEALED AIR CORP	22,500	39.78	895,050.00
WESTROCK CO	38,700	32.54	1,259,298.00
FREEMONT-MCMORAN INC	225,000	16.02	3,604,500.00
NEWMONT CORP	125,700	65.35	8,214,495.00
NUCOR CORP	46,700	46.90	2,190,230.00
STEEL DYNAMICS	33,400	30.66	1,024,044.00
BOEING CO	83,500	171.05	14,282,675.00
GENERAL DYNAMICS	38,000	151.70	5,764,600.00
HEICO CORP	6,300	111.44	702,072.00
HEICO CORP-CLASS A	10,500	91.67	962,535.00

HOWMET AEROSPACE INC	57,000	17.70	1,008,900.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	6,500	147.51	958,815.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	34,100	181.73	6,196,993.00	
LOCKHEED MARTIN	39,120	385.02	15,061,982.40	
NORTHROP GRUMMAN CORP	24,670	339.03	8,363,870.10	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	235,600	61.17	14,411,652.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,770	318.07	1,835,263.90	
TEXTRON INC	37,900	38.94	1,475,826.00	
TRANSDIGM GROUP INC	8,090	503.32	4,071,858.80	
ALLEGION PLC	14,800	99.67	1,475,116.00	
CARRIER GLOBAL CORP	130,000	30.00	3,900,000.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	21,600	82.56	1,783,296.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	114,200	41.31	4,717,602.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,700	277.53	1,581,921.00	
MASCO CORP	42,500	56.42	2,397,850.00	
OWENS CORNING INC	16,800	65.99	1,108,632.00	
SMITH (A.O.) CORP	21,800	48.61	1,059,698.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	37,600	117.77	4,428,152.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	19,500	91.96	1,793,220.00	
AMETEK INC	35,500	99.47	3,531,185.00	
EATON CORP PLC	61,600	102.58	6,318,928.00	
EMERSON ELEC	94,600	69.54	6,578,484.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	17,900	228.25	4,085,675.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	24,500	42.53	1,041,985.00	
3M CORP	89,800	165.77	14,886,146.00	
GENERAL ELEC CO	1,355,000	6.42	8,699,100.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	108,900	166.69	18,152,541.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	35,400	40.19	1,422,726.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	33,300	20.17	671,661.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	16,420	422.53	6,937,942.60	
CATERPILLAR INC DEL	83,800	148.18	12,417,484.00	
CUMMINS INC	23,500	204.36	4,802,460.00	
DEERE & COMPANY	46,200	211.34	9,763,908.00	
DOVER CORP	22,900	109.62	2,510,298.00	

FORTIVE CORP	47,600	74.21	3,532,396.00
IDEX CORP	12,300	177.62	2,184,726.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	48,800	193.90	9,462,320.00
INGERSOLL-RAND INC	53,400	35.31	1,885,554.00
NORDSON CORP	8,700	186.88	1,625,856.00
OTIS WORLDWIDE CORP	65,000	61.49	3,996,850.00
PACCAR	53,800	85.62	4,606,356.00
PARKER HANNIFIN CORP	20,100	207.30	4,166,730.00
PENTAIR PLC	23,200	44.87	1,040,984.00
SNAP-ON INC	8,400	151.22	1,270,248.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	23,900	160.13	3,827,107.00
WABTEC CORP	28,800	69.04	1,988,352.00
XYLEM INC	27,800	81.87	2,275,986.00
AERCAP HOLDINGS NV	21,000	29.87	627,270.00
FASTENAL CO	88,300	46.27	4,085,641.00
GRAINGER(W.W.) INC	6,970	358.08	2,495,817.60
HD SUPPLY HOLDINGS INC	26,800	39.30	1,053,240.00
UNITED RENTALS INC	11,300	176.43	1,993,659.00
CINTAS CORP	13,600	331.11	4,503,096.00
COPART INC	33,700	103.49	3,487,613.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	34,200	93.50	3,197,700.00
ROLLINS INC	23,900	54.59	1,304,701.00
WASTE CONNECTIONS INC	40,500	99.22	4,018,410.00
WASTE MANAGEMENT INC	65,100	111.21	7,239,771.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	20,400	97.90	1,997,160.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	25,200	87.80	2,212,560.00
FEDEX CORPORATION	39,100	226.12	8,841,292.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	109,600	160.78	17,621,488.00
XPO LOGISTICS INC	14,300	87.47	1,250,821.00
DELTA AIR LINES INC	25,200	31.77	800,604.00
SOUTHWEST AIRLINES	19,800	39.39	779,922.00
AMERCO	1,170	363.05	424,768.50
CSX CORP	120,400	75.51	9,091,404.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	13,200	136.62	1,803,384.00
KANSAS CITY SOUTHERN	14,800	188.00	2,782,400.00

KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	20,800	45.34	943,072.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	40,300	209.10	8,426,730.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,400	196.26	2,826,144.00
UBER TECHNOLOGIES INC	150,800	33.24	5,012,592.00
UNION PAC CORP	105,300	191.14	20,127,042.00
APTIV PLC	41,500	86.21	3,577,715.00
AUTOLIV INC	11,900	77.83	926,177.00
BORGWARNER INC	30,600	42.07	1,287,342.00
LEAR CORP	8,400	120.45	1,011,780.00
FORD MOTOR COMPANY	607,000	6.90	4,188,300.00
GENERAL MOTORS CO	198,000	30.00	5,940,000.00
TESLA INC	115,400	418.32	48,274,128.00
DR HORTON INC	53,800	68.23	3,670,774.00
GARMIN LTD	22,700	101.73	2,309,271.00
LENNAR CORP-A	43,000	73.62	3,165,660.00
MOHAWK INDUSTRIES	10,200	92.43	942,786.00
NEWELL BRANDS INC	66,000	16.32	1,077,120.00
NVR INC	559	3,931.93	2,197,948.87
PULTEGROUP INC	43,000	43.21	1,858,030.00
WHIRLPOOL CORP	9,400	168.00	1,579,200.00
HASBRO INC	21,400	79.05	1,691,777.00
PELOTON INTERACTIVE INC-A	29,600	80.63	2,386,648.00
LULULEMON ATHLETICA INC	19,130	361.41	6,913,773.30
NIKE INC-B	192,400	112.40	21,625,760.00
RALPH LAUREN CORPORATION	7,800	74.05	577,590.00
V F CORP	52,000	68.22	3,547,440.00
ARAMARK	34,000	28.30	962,200.00
CARNIVAL CORP	72,000	18.53	1,334,160.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,120	1,313.73	5,412,567.60
DARDEN RESTAURANTS INC	19,800	89.28	1,767,744.00
DOMINOS PIZZA INC	5,870	381.81	2,241,224.70
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	43,400	90.94	3,946,796.00
LAS VEGAS SANDS CORP	53,800	51.96	2,795,448.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	42,900	104.82	4,496,778.00
	116,000	211.73	24,560,680.00

MCDONALD'S CORP				
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	19.04	647,360.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	71,000	23.52	1,669,920.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	26,600	71.95	1,913,870.00	
STARBUCKS CORP	181,000	86.27	15,614,870.00	
VAIL RESORTS INC	6,000	219.72	1,318,320.00	
WYNN RESORTS LTD	15,500	87.72	1,359,660.00	
YUM BRANDS INC	46,800	95.22	4,456,296.00	
GENUINE PARTS CO	23,200	97.47	2,261,304.00	
LKQ CORP	44,000	31.80	1,399,200.00	
AMAZON.COM INC	65,977	3,294.62	217,369,143.74	
BOOKING HOLDINGS INC	6,400	1,917.74	12,273,536.00	
EBAY INC	108,100	52.54	5,679,574.00	
EXPEDIA GROUP INC	20,500	99.80	2,045,900.00	
MERCADOLIBRE INC	6,980	1,083.38	7,561,992.40	
WAYFAIR INC - CLASS A	9,800	260.94	2,557,212.00	
DOLLAR GENERAL CORP	38,900	195.72	7,613,508.00	
DOLLAR TREE INC	37,600	91.23	3,430,248.00	
TARGET CORP	77,400	147.23	11,395,602.00	
ADVANCE AUTO PARTS	10,900	153.75	1,675,875.00	
AUTOZONE	3,670	1,206.79	4,428,919.30	
BEST BUY COMPANY INC	36,000	106.31	3,827,160.00	
BURLINGTON STORES INC	10,500	211.83	2,224,215.00	
CARMAX INC	26,100	105.58	2,755,638.00	
HOME DEPOT	167,200	269.66	45,087,152.00	
LOWES COS INC	117,100	156.39	18,313,269.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	11,610	471.01	5,468,426.10	
ROSS STORES INC	56,000	93.32	5,225,920.00	
TIFFANY & CO	16,900	121.79	2,058,251.00	
TJX COS INC	186,700	55.18	10,302,106.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	18,000	142.08	2,557,440.00	
ULTA BEAUTY INC	8,600	240.51	2,068,386.00	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	68,540	346.57	23,753,907.80	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,000	4.06	182,700.00	
KROGER CO	120,500	35.47	4,274,135.00	
	75,800	60.14	4,558,612.00	

SYSCO CORP				
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	116,500	36.89	4,297,685.00	
WALMART INC	221,000	142.83	31,565,430.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	47,500	80.12	3,805,700.00	
COCA COLA CO	633,800	51.04	32,349,152.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	32,600	44.34	1,445,484.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	25,800	191.52	4,941,216.00	
KEURIG DR PEPPER INC	56,000	29.54	1,654,240.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	31,400	38.32	1,203,248.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	60,700	82.27	4,993,789.00	
PEPSICO INC	215,500	138.76	29,902,780.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	88,400	46.49	4,109,716.00	
BUNGE LIMITED	22,000	46.48	1,022,560.00	
CAMPBELL SOUP CO	27,400	47.58	1,303,692.00	
CONAGRA BRANDS INC	76,900	37.13	2,855,297.00	
GENERAL MILLS	94,400	63.15	5,961,360.00	
HERSHEY CO/THE	23,500	148.80	3,496,800.00	
HORMEL FOODS CORP	45,600	51.08	2,329,248.00	
INGREDION INC	11,200	81.51	912,912.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,600	117.56	2,186,616.00	
KELLOGG CO	40,000	69.22	2,768,800.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	103,500	33.47	3,464,145.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	23,900	62.44	1,492,316.00	
MCCORMICK & CO INC.	19,000	201.85	3,835,150.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	221,100	57.88	12,797,268.00	
TYSON FOODS INC-CL A	46,900	62.42	2,927,498.00	
ALTRIA GROUP INC	289,800	43.49	12,603,402.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	243,100	79.15	19,241,365.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	37,700	93.30	3,517,410.00	
CLOROX CO	19,300	212.52	4,101,636.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	126,500	77.21	9,767,065.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	53,200	152.23	8,098,636.00	
PROCTER & GAMBLE CO	385,000	137.96	53,114,600.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	34,500	216.22	7,459,590.00	
ABBOTT LABORATORIES	275,900	104.16	28,737,744.00	

ABIOMED INC	7,200	275.89	1,986,408.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	11,800	309.00	3,646,200.00
BAXTER INTERNATIONAL INC.	78,900	82.30	6,493,470.00
BECTON,DICKINSON	45,100	234.08	10,557,008.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	218,600	41.48	9,067,528.00
DANAHER CORP	99,300	196.58	19,520,394.00
DENTSPLY SIRONA INC	35,200	44.76	1,575,552.00
DEXCOM INC	14,480	398.24	5,766,515.20
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	97,100	83.71	8,128,241.00
HOLOGIC INC	40,400	58.24	2,352,896.00
IDEXX LABORATORIES INC	13,150	370.66	4,874,179.00
INSULET CORP	9,800	204.83	2,007,334.00
INTUITIVE SURGICAL INC	18,200	735.28	13,382,096.00
MASIMO CORP	8,200	213.72	1,752,504.00
MEDTRONIC PLC	209,600	105.74	22,163,104.00
RESMED INC	22,500	173.56	3,905,100.00
STERIS PLC	13,800	157.92	2,179,296.00
STRYKER CORP	53,100	197.62	10,493,622.00
TELEFLEX INC	7,070	389.39	2,752,987.30
THE COOPER COMPANIES, INC.	8,300	323.49	2,684,967.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	14,200	173.85	2,468,670.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	11,800	263.66	3,111,188.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	31,900	139.80	4,459,620.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	23,900	96.60	2,308,740.00
ANTHEM INC	39,600	276.22	10,938,312.00
CARDINAL HEALTH INC	47,200	49.72	2,346,784.00
CENTENE CORP	89,000	59.67	5,310,630.00
CIGNA CORP	58,000	178.61	10,359,380.00
CVS HEALTH CORP	203,500	60.24	12,258,840.00
DAVITA INC	12,500	87.06	1,088,250.00
HCA HEALTHCARE INC	42,200	137.05	5,783,510.00
HENRY SCHEIN INC	23,100	65.64	1,516,284.00
HUMANA INC	20,550	413.19	8,491,054.50
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	14,900	175.72	2,618,228.00
MCKESSON CORP	25,600	152.43	3,902,208.00
	9,700	183.00	1,775,100.00

MOLINA HEALTHCARE INC				
QUEST DIAGNOSTICS INC	20,500	108.89	2,232,245.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	147,900	312.00	46,144,800.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	11,500	113.57	1,306,055.00	
ABBVIE INC	274,200	91.87	25,190,754.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	34,400	112.97	3,886,168.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	17,500	122.83	2,149,525.00	
AMGEN INC	91,800	248.40	22,803,120.00	
BEIGENE, LTD ADR	6,300	240.17	1,513,071.00	
BIOGEN INC	25,200	276.00	6,955,200.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	28,000	76.00	2,128,000.00	
EXACT SCIENCES CORP	22,600	74.70	1,688,220.00	
GILEAD SCIENCES INC	194,200	66.01	12,819,142.00	
INCYTE CORP	28,500	90.49	2,578,965.00	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	21,400	55.61	1,190,054.00	
MODERNA INC	43,200	62.60	2,704,320.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,200	110.06	1,562,852.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	15,710	580.36	9,117,455.60	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	11,300	132.75	1,500,075.00	
SEATTLE GENETICS INC	18,700	149.21	2,790,227.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	40,400	266.50	10,766,600.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	351,400	59.95	21,066,430.00	
CATALENT INC	24,800	83.95	2,081,960.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	60,000	28.10	1,686,000.00	
ELI LILLY & CO.	133,900	150.91	20,206,849.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	9,000	131.70	1,185,300.00	
JOHNSON & JOHNSON	410,800	148.59	61,040,772.00	
MERCK & CO INC	392,100	85.24	33,422,604.00	
MYLAN NV	86,000	15.81	1,359,660.00	
PERRIGO CO PLC	19,600	50.86	996,856.00	
PFIZER INC	866,000	36.36	31,487,760.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	166,000	9.19	1,525,540.00	
ZOETIS INC	74,000	157.24	11,635,760.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,213,000	26.54	32,193,020.00	
CITIGROUP	322,800	52.52	16,953,456.00	
	70,000	27.36	1,915,200.00	

CITIZENS FINANCIAL GROUP				
COMERICA INC	23,000	41.47	953,810.00	
EAST WEST BANCORP INC	20,700	37.71	780,597.00	
FIFTH THIRD BANCORP	112,000	21.63	2,422,560.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	27,100	114.53	3,103,763.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	153,000	9.93	1,520,055.00	
JPMORGAN CHASE & CO	473,700	103.52	49,037,424.00	
KEYCORP	158,000	12.89	2,036,620.00	
M & T BANK CORP	20,000	105.90	2,118,000.00	
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	71,000	11.02	782,775.00	
PNC FINANCIAL	67,000	113.10	7,577,700.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	150,000	11.80	1,770,000.00	
SIGNATURE BANK	8,900	101.23	900,947.00	
SVB FINANCIAL GROUP	8,100	259.73	2,103,813.00	
TRUIST FINANCIAL CORP	208,700	39.16	8,172,692.00	
US BANCORP	212,200	38.31	8,129,382.00	
WELLS FARGO CO	605,000	24.79	14,997,950.00	
ZIONS BANCORP NA	27,500	33.68	926,200.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	216,100	218.32	47,178,952.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	62,000	20.97	1,300,140.00	
VOYA FINANCIAL INC	21,700	50.78	1,101,926.00	
AFLAC INC	108,900	37.86	4,122,954.00	
ALLEGHANY CORP	2,300	551.73	1,268,979.00	
ALLSTATE CORP	48,200	93.81	4,521,642.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,500	68.63	857,875.00	
AMERICAN INTL GROUP	137,800	29.80	4,106,440.00	
AON PLC	36,000	202.74	7,298,640.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	63,900	31.87	2,036,493.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	29,700	103.68	3,079,296.00	
ASSURANT INC	9,000	122.67	1,104,030.00	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,200	37.29	790,548.00	
BROWN & BROWN INC	38,800	45.25	1,755,700.00	
CHUBB LTD	70,800	125.56	8,889,648.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	24,600	81.08	1,994,568.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	3,700	209.94	776,778.00	
	6,200	215.55	1,336,410.00	

EVEREST RE GROUP LTD			
FNF GROUP	45,400	33.27	1,510,458.00
GLOBE LIFE INC	15,700	83.89	1,317,073.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	54,400	40.94	2,227,136.00
LINCOLN NATIONAL CORP	29,900	38.22	1,142,778.00
LOEWS CORP	38,700	36.87	1,426,869.00
MARKEL CORP	2,130	1,068.62	2,276,160.60
MARSH & MCLENNAN COS	78,900	115.41	9,105,849.00
METLIFE INC	120,400	39.15	4,713,660.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	44,400	43.42	1,927,848.00
PROGRESSIVE CO	91,500	92.94	8,504,010.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	63,000	69.71	4,391,730.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	10,500	96.51	1,013,355.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	7,800	179.78	1,402,284.00
TRAVELERS COS INC/THE	39,300	116.57	4,581,201.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	20,200	208.43	4,210,286.00
WR BERKLEY CORP	21,200	62.94	1,334,328.00
ACCENTURE PLC-CL A	99,300	236.07	23,441,751.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	25,800	108.43	2,797,494.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	66,400	138.53	9,198,392.00
BLACK KNIGHT INC	24,200	81.57	1,973,994.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	22,600	84.98	1,920,548.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	17,900	135.41	2,423,839.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	83,200	66.81	5,558,592.00
EPAM SYSTEMS INC	8,400	316.30	2,656,920.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	96,200	148.00	14,237,600.00
FISERV INC	87,900	99.03	8,704,737.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	13,100	238.04	3,118,324.00
GARTNER INC	14,100	131.18	1,849,638.00
GLOBAL PAYMENTS INC	46,200	172.56	7,972,272.00
GODADDY INC - CLASS A	26,900	79.52	2,139,088.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	138,800	122.30	16,975,240.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,600	163.17	1,892,772.00
LEIDOS HOLDINGS INC	21,500	88.49	1,902,535.00
MASTERCARD INC	138,940	335.01	46,546,289.40

MONGODB INC	7,400	214.51	1,587,374.00
OKTA INC	18,000	203.44	3,661,920.00
PAYCHEX INC	50,500	76.06	3,841,030.00
PAYPAL HOLDINGS INC	173,300	191.84	33,245,872.00
SQUARE INC - A	55,700	146.39	8,153,923.00
TWILIO INC - A	18,600	233.50	4,343,100.00
VERISIGN INC	16,200	203.54	3,297,348.00
VISA INC-CLASS A SHARES	262,300	204.66	53,682,318.00
WESTERN UNION CO	66,000	23.03	1,519,980.00
WIX.COM LTD	7,700	258.49	1,990,373.00
ADOBE INC	74,870	491.94	36,831,547.80
ANSYS INC	13,400	321.21	4,304,214.00
AUTODESK INC.	34,200	233.88	7,998,696.00
AVALARA INC	11,800	123.37	1,455,766.00
CADENCE DESIGN SYS INC	43,100	105.88	4,563,428.00
CDK GLOBAL INC	20,000	45.41	908,200.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	17,300	119.98	2,075,654.00
CITRIX SYSTEMS INC	18,400	137.14	2,523,376.00
COUPA SOFTWARE INC	10,600	285.81	3,029,586.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	22,200	125.19	2,779,218.00
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	5,500	101.98	560,890.00
DATADOG INC - CLASS A	20,600	79.57	1,639,142.00
DOCUSIGN INC	27,100	216.26	5,860,646.00
DROPBOX INC-CLASS A	39,000	19.75	770,250.00
DYNATRACE INC	29,000	39.99	1,159,710.00
FAIR ISAAC CORP	4,630	419.43	1,941,960.90
FORTINET INC	20,900	117.64	2,458,676.00
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	13,600	115.61	1,572,296.00
INTUIT INC	40,600	333.11	13,524,266.00
MICROSOFT CORP	1,121,200	214.25	240,217,100.00
NORTONLIFELOCK INC	91,000	23.39	2,128,490.00
ORACLE CORPORATION	317,900	55.73	17,716,567.00
PALO ALTO NETWORKS INC	15,200	235.65	3,581,880.00
PAYCOM SOFTWARE INC	8,100	270.75	2,193,075.00
PTC INC	17,000	87.69	1,490,730.00

RINGCENTRAL INC-CLASS A	11,200	266.45	2,984,240.00
SALESFORCE.COM INC	139,800	254.70	35,607,060.00
SERVICENOW INC	29,610	450.35	13,334,863.50
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	59,800	29.07	1,738,386.00
SPLUNK INC	24,800	200.14	4,963,472.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	36,700	61.24	2,247,691.50
SYNOPSYS INC	23,900	208.98	4,994,622.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	6,480	441.26	2,859,364.80
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,100	329.81	2,011,841.00
VMWARE INC - CLASS A	13,000	137.47	1,787,110.00
WORKDAY INC-CLASS A	26,500	215.80	5,718,700.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	24,600	369.89	9,099,294.00
ZSCALER INC	10,700	134.34	1,437,438.00
ARISTA NETWORKS INC	8,700	211.10	1,836,570.00
CISCO SYSTEMS	655,700	40.82	26,765,674.00
F5 NETWORKS INC	9,300	127.14	1,182,402.00
JUNIPER NETWORKS INC	53,000	23.24	1,231,720.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	26,800	153.04	4,101,472.00
APPLE INC	2,698,320	120.96	326,388,787.20
DELL TECHNOLOGIES-C	38,300	64.65	2,476,095.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	202,000	9.59	1,937,180.00
HP INC	223,000	19.23	4,288,290.00
NETAPP INC	35,200	46.40	1,633,280.00
SEAGATE TECHNOLOGY	37,300	47.01	1,753,473.00
WESTERN DIGITAL CORP	47,600	38.16	1,816,416.00
AMPHENOL CORP-CL A	46,400	108.45	5,032,080.00
ARROW ELECTRS INC	12,100	77.95	943,195.00
CDW CORPORATION	22,400	114.25	2,559,200.00
COGNEX CORP	27,800	63.19	1,756,682.00
CORNING INC	119,000	32.05	3,813,950.00
FLIR SYSTEMS INC	20,700	35.16	727,812.00
IPG PHOTONICS CORP	5,900	162.65	959,635.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	28,700	94.95	2,725,065.00
TE CONNECTIVITY LTD	52,400	98.75	5,174,500.00
TRIMBLE INC	38,800	49.96	1,938,448.00

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	8,400	260.55	2,188,620.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	182,600	82.01	14,975,026.00	
ANALOG DEVICES INC	58,100	117.44	6,823,264.00	
APPLIED MATERIALS	143,800	60.96	8,766,048.00	
BROADCOM INC	62,160	362.95	22,560,972.00	
INTEL CORP	657,800	50.08	32,942,624.00	
KLA CORP	24,400	193.37	4,718,228.00	
LAM RESEARCH	22,650	333.12	7,545,168.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	106,400	37.36	3,975,104.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	42,400	68.68	2,912,032.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	37,300	108.15	4,033,995.00	
MICRON TECHNOLOGY	174,000	46.48	8,087,520.00	
NVIDIA CORP	95,740	504.90	48,339,126.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	43,200	126.33	5,457,456.00	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	61,000	22.68	1,383,480.00	
QORVO INC	17,700	118.89	2,104,353.00	
QUALCOMM INC	174,500	115.97	20,236,765.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	25,500	139.01	3,544,755.00	
TERADYNE INC	25,400	78.60	1,996,440.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	142,400	140.47	20,002,928.00	
XILINX INC	38,200	101.64	3,882,648.00	
AT & T INC	1,107,000	29.42	32,567,940.00	
CENTURYLINK INC	147,000	10.76	1,581,720.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	22.53	540,840.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	64,000	22.01	1,408,640.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	644,500	60.48	38,979,360.00	
T-MOBILE US INC	86,100	114.29	9,840,369.00	
ALLIANT ENERGY CORP	37,600	53.29	2,003,704.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	77,200	79.05	6,102,660.00	
DUKE ENERGY CORP	114,200	80.97	9,246,774.00	
EDISON INTERNATIONAL	58,000	52.26	3,031,080.00	
ENTERGY CORP	31,300	97.90	3,064,270.00	
EVERGY INC	35,900	51.87	1,862,133.00	
EVERSOURCE ENERGY	52,100	86.08	4,484,768.00	
EXELON CORPORATION	150,400	37.09	5,578,336.00	

FIRSTENERGY CORP	86,600	29.40	2,546,040.00	
NEXTERA ENERGY INC	76,400	277.32	21,187,248.00	
NRG ENERGY INC	40,500	33.38	1,351,890.00	
OGE ENERGY CORP	32,500	31.54	1,025,050.00	
PG&E CORP	159,000	9.19	1,461,210.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	17,000	72.40	1,230,800.00	
PPL CORPORATION	121,800	28.29	3,445,722.00	
SOUTHERN CO.	165,200	52.29	8,638,308.00	
XCEL ENERGY INC	81,000	70.02	5,671,620.00	
ATMOS ENERGY CORP	18,400	97.22	1,788,848.00	
UGI CORP	30,900	34.17	1,055,853.00	
AMEREN CORPORATION	39,100	78.96	3,087,336.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	75,400	19.87	1,498,198.00	
CMS ENERGY CORP	45,600	61.66	2,811,696.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	52,500	73.04	3,834,600.00	
DOMINION ENERGY INC	130,600	78.44	10,244,264.00	
DTE ENERGY COMPANY	30,500	118.81	3,623,705.00	
NISOURCE INC	58,200	22.28	1,296,696.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	77,700	52.52	4,080,804.00	
SEMPRA ENERGY	45,100	120.89	5,452,139.00	
WEC ENERGY GROUP INC	49,800	96.49	4,805,202.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,300	143.17	4,051,711.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	34,900	41.59	1,451,491.00	
ALLY FINANCIAL INC	57,400	25.24	1,448,776.00	
AMERICAN EXPRESS CO	107,000	105.67	11,306,690.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	69,900	73.99	5,171,901.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	49,600	57.12	2,833,152.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	79,000	26.17	2,067,430.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	19,000	156.54	2,974,260.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	27,500	46.61	1,281,775.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	122,300	37.50	4,586,250.00	
BLACKROCK INC	23,620	564.63	13,336,560.60	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	103,000	52.99	5,457,970.00	
CARLYLE GROUP INC/THE	22,000	25.82	568,040.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	17,900	91.03	1,629,437.00	

CME GROUP INC	55,400	169.62	9,396,948.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	35,000	54.53	1,908,550.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,920	332.47	1,968,222.40
FRANKLIN RESOURCES INC	43,400	21.30	924,420.00
GOLDMAN SACHS GROUP	51,200	210.94	10,800,128.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	84,500	100.08	8,456,760.00
INVESCO LTD	58,000	11.39	660,620.00
KKR & CO INC-A	78,400	35.70	2,798,880.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	5,820	454.45	2,644,899.00
MOODYS CORP	26,100	282.47	7,372,467.00
MORGAN STANLEY	182,700	52.71	9,630,117.00
MSCI INC	13,130	348.18	4,571,603.40
NASDAQ INC	18,400	130.29	2,397,336.00
NORTHERN TRUST CORP	32,100	84.45	2,710,845.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	19,600	76.62	1,501,752.00
S&P GLOBAL INC	37,320	345.18	12,882,117.60
SCHWAB(CHARLES)CORP	178,800	36.20	6,472,560.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	51.80	989,380.00
STATE STREET CORP	56,200	68.35	3,841,270.00
T ROWE PRICE GROUP INC	34,900	132.27	4,616,223.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	41,200	39.09	1,610,508.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	13,000	53.19	691,470.00
AES CORP	101,000	17.57	1,774,570.00
VISTRA CORP	70,000	18.23	1,276,100.00
CERNER CORP	46,500	72.01	3,348,465.00
TELADOC HEALTH INC	11,200	198.29	2,220,848.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	20,700	269.59	5,580,513.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	49,000	96.84	4,745,160.00
AVANTOR INC	68,000	21.21	1,442,280.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	3,640	484.23	1,762,597.20
ILLUMINA INC	22,880	342.39	7,833,883.20
IQVIA HOLDINGS INC	29,300	160.21	4,694,153.00
METTLER-TOLEDO INTL	3,700	949.26	3,512,262.00
PERKINELMER INC	17,400	114.30	1,988,820.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	61,320	409.98	25,139,973.60

WATERS CORP	9,500	206.07	1,957,665.00
COSTAR GROUP INC	6,180	826.89	5,110,180.20
EQUIFAX INC	18,500	166.39	3,078,215.00
IHS MARKIT LTD	59,000	79.19	4,672,210.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	54,000	15.28	825,120.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17,100	53.20	909,720.00
TRUNSION	29,000	84.06	2,437,740.00
VERISK ANALYTICS INC	24,100	182.77	4,404,757.00
CBRE GROUP INC	51,400	48.22	2,478,508.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	184,000	3.89	715,760.00
JONES LANG LASALLE INC	7,600	103.03	783,028.00
ALTICE USA INC-A	46,000	26.65	1,225,900.00
CABLE ONE INC	730	1,845.01	1,346,857.30
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	22,390	604.02	13,524,007.80
COMCAST CORP-CL A	710,900	44.43	31,585,287.00
DISCOVERY INC - A	24,500	22.81	558,845.00
DISCOVERY INC - C	47,000	20.44	960,680.00
DISH NETWORK CORP-A	38,400	33.78	1,297,152.00
FOX CORP-CLASS A	52,000	27.66	1,438,320.00
FOX CORP-CLASS B	25,400	27.76	705,104.00
INTERPUBRIC GROUP	58,000	17.84	1,034,720.00
LIBERTY BROADBAND CORP-A	4,000	135.38	541,520.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	16,700	136.80	2,284,560.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	25,800	35.48	915,384.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	35.67	460,143.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	55,000	14.95	822,250.00
OMNICOM GROUP	34,500	54.08	1,865,760.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	175,000	5.72	1,001,000.00
VIACOMCBS INC-CLASS B	88,000	28.75	2,530,000.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	120,900	79.01	9,552,309.00
DISNEY (WALT) CO	280,700	131.99	37,049,593.00
ELECTRONIC ARTS	44,800	130.13	5,829,824.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	34,000	37.98	1,291,320.00
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	23,000	57.58	1,324,340.00
NETFLIX INC	68,670	516.05	35,437,153.50

	ROKU INC	15,800	159.91	2,526,578.00	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	18,100	161.71	2,926,951.00	
	ALPHABET INC-CL A	46,770	1,581.21	73,953,191.70	
	ALPHABET INC-CL C	47,060	1,591.04	74,874,342.40	
	FACEBOOK INC-A	374,100	282.73	105,769,293.00	
	IAC/INTERACTIVE CORP	12,600	126.20	1,590,120.00	
	MATCH GROUP INC	38,295	105.94	4,056,972.30	
	PINTEREST INC- CLASS A	62,800	34.38	2,159,064.00	
	SNAP INC-A	139,000	22.44	3,119,160.00	
	TWITTER INC	124,100	39.87	4,947,867.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	20,200	83.88	1,694,376.00	
	小計銘柄数：591			4,610,608,383.61	
				(490,384,307,680)	
	組入時価比率：69.4%			72.1%	
カナダドル	CAMECO CORP	56,000	14.18	794,080.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	187,000	25.71	4,807,770.00	
	CENOVUS ENERGY INC	156,000	6.06	945,360.00	
	ENBRIDGE INC	315,500	41.24	13,011,220.00	
	IMPERIAL OIL	37,500	20.91	784,125.00	
	INTER PIPELINE LTD	60,000	14.20	852,000.00	
	KEYERA CORP	34,000	23.95	814,300.00	
	PARKLAND CORP	21,700	35.63	773,171.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	88,000	32.02	2,817,760.00	
	SUNCOR ENERGY INC	234,000	20.24	4,736,160.00	
	TC ENERGY CORP	146,800	59.50	8,734,600.00	
	NUTRIEN LTD	90,000	49.21	4,428,900.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	24,700	47.36	1,169,792.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	37,700	102.87	3,878,199.00	
	B2GOLD CORP	153,000	8.42	1,288,260.00	
	BARRICK GOLD	277,000	37.90	10,498,300.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	93,000	12.93	1,202,490.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	29,500	190.11	5,608,245.00	
	KINROSS GOLD CORP	198,000	11.27	2,231,460.00	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	39,700	67.45	2,677,765.00	
	LUNDIN MINING CORP	95,000	8.23	781,850.00	

PAN AMERICAN SILVER CORP	31,000	45.01	1,395,310.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	68,000	15.35	1,043,800.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	68,600	67.40	4,623,640.00	
YAMANA GOLD INC	138,000	7.84	1,081,920.00	
CAE INC	41,000	19.86	814,260.00	
WSP GLOBAL INC	17,700	88.24	1,561,848.00	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	16,000	74.61	1,193,760.00	
AIR CANADA	20,400	18.63	380,052.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	110,700	135.38	14,986,566.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	21,300	379.13	8,075,469.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	45,100	63.59	2,867,909.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	31,800	26.54	843,972.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	43,100	73.18	3,154,058.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	8,600	134.93	1,160,398.00	
DOLLARAMA INC	46,600	49.42	2,302,972.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	134,200	44.58	5,982,636.00	
EMPIRE CO LTD A	26,000	32.96	856,960.00	
LOBLAW COMPANIES	28,500	66.78	1,903,230.00	
METRO INC	39,600	58.75	2,326,500.00	
WESTON(GEORGE)LTD	12,300	93.89	1,154,847.00	
SAPUTO INC	41,000	32.31	1,324,710.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	51,000	21.24	1,083,240.00	
CANOPY GROWTH CORP	33,000	21.11	696,630.00	
CRONOS GROUP INC	25,000	7.02	175,500.00	
BANK OF MONTREAL	99,100	81.37	8,063,767.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	189,900	55.34	10,509,066.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	69,600	104.09	7,244,664.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	52,300	72.58	3,795,934.00	
ROYAL BANK OF CANADA	221,400	96.91	21,455,874.00	
TORONTO DOMINION BANK	282,600	63.42	17,922,492.00	
ONEX CORPORATION	13,200	63.52	838,464.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,140	399.40	1,653,516.00	
GREAT-WEST LIFE CO INC	42,000	25.76	1,081,920.00	
IA FINANCIAL CORP INC	18,300	46.96	859,368.00	

	INTACT FINANCIAL CORP	22,700	136.82	3,105,814.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	303,000	19.16	5,805,480.00	
	POWER CORPORATION OF CANADA	86,950	25.65	2,230,267.50	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	92,300	54.38	5,019,274.00	
	CGI INC	34,900	91.04	3,177,296.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	16,740	1,270.00	21,259,800.00	
	BLACKBERRY LTD	71,000	6.66	472,860.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,200	1,472.81	4,712,992.00	
	OPEN TEXT CORP	41,700	56.90	2,372,730.00	
	BCE INC	25,600	55.84	1,429,504.00	
	TELUS CORP	58,600	23.80	1,394,680.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	54,500	55.52	3,025,840.00	
	EMERA INC	37,900	53.12	2,013,248.00	
	FORTIS INC	71,200	52.01	3,703,112.00	
	HYDRO ONE LTD	55,000	27.06	1,488,300.00	
	ALTAGAS LTD	42,000	16.78	704,760.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	85,000	17.89	1,520,650.00	
	ATCO LTD CL1	13,000	39.20	509,600.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	20,300	32.35	656,705.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	209,800	43.42	9,109,516.00	
	CI FINANCIAL CORP	33,600	18.34	616,224.00	
	IGM FINANCIAL INC	15,000	31.79	476,850.00	
	TMX GROUP LTD	9,500	134.65	1,279,175.00	
	THOMSON REUTERS CORP	27,800	99.29	2,760,262.00	
	QUEBECOR INC-CL B	27,000	32.52	878,040.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	77,000	24.21	1,864,170.00	
小計	銘柄数：81			288,838,208.50	
				(23,491,211,497)	
	組入時価比率：3.3%			3.5%	
ユ-口	TENARIS SA	71,000	4.82	342,717.00	
	ENI SPA	403,000	7.64	3,080,935.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	81,000	8.88	719,766.00	
	NESTE OYJ	66,800	44.96	3,003,328.00	
	OMV AG	21,000	27.02	567,420.00	
	REPSOL SA	232,733	6.44	1,500,662.38	

TOTAL SE	384,200	32.96	12,665,153.00
VOPAK	11,400	46.19	526,566.00
AIR LIQUIDE SA	73,800	138.80	10,243,440.00
AKZO NOBEL	30,800	81.66	2,515,128.00
ARKEMA	10,200	93.62	954,924.00
BASF SE	144,400	52.12	7,526,128.00
COVESTRO AG	26,900	43.30	1,164,770.00
EVONIK INDUSTRIES AG	33,000	23.23	766,590.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	10,500	38.28	401,940.00
KONINKLIJKE DSM NV	27,300	132.75	3,624,075.00
LANXESS	12,000	49.04	588,480.00
SOLVAY SA	11,400	76.38	870,732.00
SYMRISE AG	19,700	113.55	2,236,935.00
UMICORE	31,000	38.93	1,206,830.00
CRH PLC	121,400	30.54	3,707,556.00
HEIDELBERGCEMENT AG	22,600	52.76	1,192,376.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	35,300	30.46	1,075,238.00
ARCELORMITTAL	108,000	10.74	1,160,784.00
THYSSENKRUPP AG	62,000	6.12	379,688.00
VOESTALPINE AG	20,000	21.63	432,600.00
STORA ENSO OYJ-R	86,000	13.20	1,135,200.00
UPM-KYMMENE OYJ	83,200	26.30	2,188,160.00
AIRBUS SE	91,800	69.78	6,405,804.00
DASSAULT AVIATION SA	330	785.50	259,215.00
LEONARDO SPA	64,000	5.66	362,240.00
MTU AERO ENGINES AG	8,400	158.95	1,335,180.00
SAFRAN SA	50,000	97.24	4,862,000.00
THALES SA	16,300	65.34	1,065,042.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	79,000	34.24	2,704,960.00
KINGSPAN GROUP PLC	24,500	67.35	1,650,075.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	42,918	20.68	887,544.24
BOUYGUES	34,800	33.62	1,169,976.00
EIFFAGE SA	12,100	78.30	947,430.00
FERROVIAL SA	73,000	22.75	1,660,750.00
HOCHTIEF AG	3,800	73.45	279,110.00

VINCI	80,800	79.62	6,433,296.00
LEGRAND SA	40,900	69.32	2,835,188.00
PRYSMIAN SPA	37,000	23.49	869,130.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	85,800	103.10	8,845,980.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	38,000	20.83	791,540.00
SIEMENS AG	118,900	115.70	13,756,730.00
ALSTOM	30,300	47.09	1,426,827.00
ANDRITZ AG	11,700	27.80	325,260.00
CNH INDUSTRIAL NV	154,000	6.86	1,057,672.00
GEA GROUP AG	24,200	31.00	750,200.00
KION GROUP AG	9,900	70.38	696,762.00
KNORR-BREMSE AG	7,100	108.66	771,486.00
KONE OYJ	54,000	70.30	3,796,200.00
WARTSILA OYJ	63,000	6.96	438,480.00
BRENNTAG AG	23,800	52.72	1,254,736.00
DEUTSCHE POST AG-REG	153,500	37.68	5,783,880.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	42,000	9.09	382,032.00
ADP	4,700	88.55	416,185.00
AENA SME SA	10,700	126.10	1,349,270.00
ATLANTIA SPA	79,000	14.21	1,122,590.00
FRAPORT AG	6,300	37.40	235,620.00
GETLINK	72,000	12.59	906,480.00
CONTINENTAL AG	17,500	94.12	1,647,100.00
FAURECIA	10,500	40.88	429,240.00
MICHELIN (CGDE)	26,700	95.30	2,544,510.00
PIRELLI & C. SPA	53,000	3.69	195,994.00
VALEO SA	37,300	28.31	1,055,963.00
BAYER MOTOREN WERK	52,100	61.38	3,197,898.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,200	47.18	481,236.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	132,300	43.48	5,752,404.00
FERRARI NV	19,300	160.70	3,101,510.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	170,000	9.43	1,603,270.00
PEUGEOT CITROEN	88,000	15.14	1,332,760.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	25,400	52.28	1,327,912.00
RENAULT SA	28,100	24.45	687,045.00

VOLKSWAGEN AG	5,100	151.20	771,120.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	28,900	143.00	4,132,700.00
SEB SA	3,800	144.00	547,200.00
ADIDAS AG	29,800	262.70	7,828,460.00
ESSILORLUXOTTICA	44,100	111.10	4,899,510.00
HERMES INTERNATIONAL	5,010	738.20	3,698,382.00
KERING SA	11,770	555.00	6,532,350.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	43,400	402.85	17,483,690.00
MONCLER SPA	28,100	33.77	948,937.00
PUMA SE	12,600	68.34	861,084.00
ACCOR SA	27,000	27.11	731,970.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	24,500	125.00	3,062,500.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	15,400	30.28	466,312.00
SODEXO	13,200	63.84	842,688.00
DELIVERY HERO SE	19,500	86.96	1,695,720.00
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	18,900	88.76	1,677,564.00
PROSUS NV	75,400	80.20	6,047,080.00
ZALANDO SE	23,100	71.74	1,657,194.00
INDITEX SA	169,000	23.04	3,893,760.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	95,000	14.31	1,359,925.00
COLRUYT SA	8,700	53.00	461,100.00
JERONIMO MARTINS	38,000	13.75	522,690.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	171,000	24.86	4,251,060.00
METRO AG	25,000	8.38	209,500.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	117,500	49.21	5,782,175.00
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	91,000	8.78	798,980.00
HEINEKEN HOLDING NV	17,500	68.75	1,203,125.00
HEINEKEN NV	40,400	76.76	3,101,104.00
PERNOD RICARD SA	33,500	141.30	4,733,550.00
REMY COINTREAU	3,100	142.40	441,440.00
DANONE	97,000	56.18	5,449,460.00
KERRY GROUP PLC-A	24,500	112.80	2,763,600.00
HENKEL AG & CO KGAA	16,300	74.25	1,210,275.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	27,400	85.36	2,338,864.00
BEIERSDORF AG	16,000	96.92	1,550,720.00

LOREAL-ORD	39,190	273.90	10,734,141.00	
UNILEVER NV	226,900	48.82	11,077,258.00	
BIOMERIEUX	6,900	113.20	781,080.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	6,000	93.50	561,000.00	
DIASORIN SPA	4,000	141.80	567,200.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	142,200	39.14	5,566,419.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	5,390	324.40	1,748,516.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,900	36.69	876,891.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	33,300	70.66	2,352,978.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	67,300	38.13	2,566,149.00	
ORPEA	7,500	97.86	733,950.00	
ARGENX SE	6,800	183.20	1,245,760.00	
GALAPAGOS NV	7,000	102.45	717,150.00	
GRIFOLS SA	46,800	21.68	1,014,624.00	
BAYER AG-REG	152,400	54.28	8,272,272.00	
IPSEN	5,500	85.95	472,725.00	
MERCK KGAA	20,000	115.30	2,306,000.00	
ORION OYJ	16,500	37.82	624,030.00	
RECORDATI SPA	16,800	44.38	745,584.00	
SANOFI	176,300	83.57	14,733,391.00	
UCB SA	19,300	96.16	1,855,888.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	70,000	8.24	577,080.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,056,000	2.55	2,700,192.00	
BANCO SANTANDER SA	2,610,000	1.90	4,973,616.00	
BANKINTER S.A.	94,000	4.51	424,410.00	
BNP PARIBAS	176,000	37.22	6,551,600.00	
CAIXABANK	530,000	2.04	1,081,200.00	
COMMERZBANK AG	158,000	5.15	813,700.00	
CREDIT AGRICOLE SA	184,000	8.67	1,595,280.00	
ERSTE GROUP BANK AG	42,000	20.28	851,760.00	
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	91,000	12.14	1,105,195.00	
ING GROEP NV	600,000	6.97	4,182,000.00	
INTESA SANPAOLO	2,590,000	1.77	4,606,574.00	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00	
KBC GROEP NV	38,100	47.71	1,817,751.00	

MEDIOBANCA S.P.A.	89,000	7.16	637,952.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	20,100	15.05	302,505.00
SOCIETE GENERALE	127,000	13.67	1,736,598.00
UNICREDIT SPA	337,000	8.12	2,737,114.00
EURAZEO SE	5,953	46.12	274,552.36
EXOR NV	17,200	49.20	846,240.00
GROUPE BRUXELLES LAM	17,794	78.04	1,388,643.76
SOFINA SA	2,300	234.00	538,200.00
WENDEL	4,300	84.25	362,275.00
AEGON NV	293,000	2.33	683,276.00
AGEAS	28,900	35.80	1,034,620.00
ALLIANZ SE-REG	64,600	178.68	11,542,728.00
ASSICURAZIONI GENERALI	175,000	12.82	2,243,500.00
AXA SA	300,000	17.18	5,154,000.00
CNP ASSURANCES	28,000	11.03	308,840.00
HANNOVER RUECK SE	9,600	140.00	1,344,000.00
MAPFRE SA	163,000	1.56	254,443.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	21,600	241.30	5,212,080.00
NN GROUP NV	47,000	32.75	1,539,250.00
POSTE ITALIANE SPA	88,000	7.69	676,896.00
SAMPO OYJ-A SHS	72,100	33.61	2,423,281.00
SCOR SE	23,200	22.24	515,968.00
ADYEN NV	2,850	1,311.50	3,737,775.00
AMADEUS IT GROUP SA	70,100	50.30	3,526,030.00
ATOS SE	15,300	71.08	1,087,524.00
CAPGEMINI SA	24,600	117.00	2,878,200.00
EDENRED	38,200	42.29	1,615,478.00
NEXI SPA	60,000	14.20	852,300.00
WORLDLINE SA	20,800	73.80	1,535,040.00
DASSAULT SYSTEMES SA	20,900	152.10	3,178,890.00
NEMETSCHKE SE	9,200	61.40	564,880.00
SAP SE	162,600	132.86	21,603,036.00
TEAMVIEWER AG	20,600	40.56	835,536.00
NOKIA OYJ	878,000	3.76	3,305,231.00
INGENICO GROUP	9,500	137.00	1,301,500.00

ASML HOLDING NV	66,080	304.80	20,141,184.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	199,000	22.78	4,533,220.00
STMICROELECTRONICS NV	101,000	23.64	2,387,640.00
ALTICE EUROPE N.V.	99,000	3.42	338,679.00
CELLNEX TELECOM SA	48,505	51.24	2,485,396.20
DEUTSCHE TELEKOM-REG	519,000	14.97	7,772,025.00
ELISA OYJ	22,100	48.55	1,072,955.00
ILIAD SA	2,400	169.35	406,440.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	38,000	8.20	311,600.00
KONINKLIJKE KPN NV	560,000	2.16	1,212,960.00
ORANGE SA	310,000	9.21	2,857,580.00
PROXIMUS	26,000	16.44	427,570.00
TELECOM ITALIA SPA	1,170,000	0.39	460,512.00
TELECOM ITALIA-RNC	880,000	0.39	343,376.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	150,000	2.29	343,650.00
TELEFONICA SA	762,500	3.29	2,513,200.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	39.63	665,784.00
ELECTRICITE DE FRANCE	94,000	8.64	812,536.00
ELIA GROUP SA/NV	4,800	84.30	404,640.00
ENDESA S.A.	50,000	22.91	1,145,500.00
ENEL SPA	1,268,000	7.41	9,398,416.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	423,459	4.13	1,751,426.42
FORTUM OYJ	72,000	16.93	1,219,320.00
IBERDROLA SA	926,000	10.46	9,690,590.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	70,000	15.96	1,117,550.00
TERNA SPA	222,000	5.96	1,324,008.00
VERBUND AG	11,000	44.54	489,940.00
ENAGAS SA	39,000	20.01	780,390.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	42,000	16.44	690,690.00
SNAM SPA	320,000	4.30	1,378,880.00
E.ON SE	355,000	9.79	3,476,160.00
ENGIE	290,000	11.64	3,375,600.00
RWE AG	100,300	31.29	3,138,387.00
SUEZ	52,000	15.12	786,500.00
VEOLIA ENVIRONNEMENT	87,000	19.54	1,700,415.00

	AMUNDI SA	10,000	63.60	636,000.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	314,000	8.13	2,554,704.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG	29,400	148.70	4,371,780.00	
	NATIXIS	158,000	2.37	375,724.00	
	UNIPER SE	31,100	25.96	807,356.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,950	647.60	1,262,820.00	
	QIAGEN N.V.	35,400	39.54	1,399,716.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,100	277.00	1,135,700.00	
	BUREAU VERITAS SA	47,000	18.59	873,965.00	
	RANDSTAD NV	18,400	43.98	809,232.00	
	TELEPERFORMANCE	9,000	249.90	2,249,100.00	
	WOLTERS KLUWER	42,000	68.20	2,864,400.00	
	AROWNTOWN SA	185,000	4.70	869,870.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	52,500	43.49	2,283,225.00	
	LEG IMMOBILIEN AG	11,000	119.00	1,309,000.00	
	VONOVIA SE	79,800	57.56	4,593,288.00	
	JC DECAUX SA	15,000	16.16	242,400.00	
	PUBLICIS GROUPE	32,400	30.12	975,888.00	
	SES FDR	56,000	6.18	346,528.00	
	TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	31.52	211,184.00	
	BOLLORE	138,000	3.18	439,392.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	14,400	65.66	945,504.00	
	VIVENDI SA	130,000	23.85	3,100,500.00	
	SCOUT24 AG	17,100	75.05	1,283,355.00	
	小計 銘柄数：240			586,432,719.36	
				(73,814,286,385)	
	組入時価比率：10.5%			10.8%	
英bond	BP PLC	3,158,000	2.57	8,131,850.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	641,000	10.78	6,911,262.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	577,000	10.35	5,975,412.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	19,300	58.24	1,124,032.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	30,200	24.26	732,652.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	191,000	18.32	3,500,266.00	
	ANTOFAGASTA PLC	59,000	10.83	639,265.00	
	BHP GROUP PLC	328,000	16.55	5,429,712.00	
	EVRAZ PLC	76,000	3.27	248,672.00	

GLENCORE PLC	1,590,000	1.71	2,725,896.00
RIO TINTO PLC-REG	175,800	45.75	8,043,729.00
MONDI PLC	75,000	14.39	1,079,250.00
BAE SYSTEMS PLC	502,000	5.03	2,529,076.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	277,000	2.17	602,475.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	730,000	1.15	843,515.00
DCC PLC	16,000	62.56	1,000,960.00
SMITHS GROUP PLC	61,000	13.79	841,495.00
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	11,600	101.75	1,180,300.00
ASHTED GROUP PLC	69,200	25.61	1,772,212.00
BUNZLE	50,000	23.64	1,182,000.00
FERGUSON PLC	34,600	70.80	2,449,680.00
RENTOKIL INTIAL PLC	285,000	5.09	1,452,360.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	159,000	5.01	797,862.00
PERSIMMON PLC	48,000	25.03	1,201,440.00
TAYLOR WIMPEY PLC	500,000	1.14	574,250.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	19,500	44.75	872,625.00
BURBERRY GROUP PLC	66,000	14.66	967,560.00
COMPASS GROUP PLC	277,000	12.50	3,462,500.00
GVC HOLDINGS PLC	87,000	8.09	703,830.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	25,900	44.27	1,146,593.00
WHITBREAD PLC	31,650	25.26	799,479.00
OCADO GROUP PLC	72,000	22.92	1,650,240.00
NEXT PLC	19,900	56.98	1,133,902.00
JD SPORTS FASHION PLC	76,000	7.15	543,400.00
KINGFISHER PLC	308,000	2.70	833,448.00
MORRISON SUPERMARKETS	370,000	1.90	705,960.00
SAINSBURY	299,000	1.82	546,572.00
TESCO PLC	1,520,000	2.15	3,280,160.00
COCA-COLA HBC AG-DI	34,000	20.13	684,420.00
DIAGEO PLC	362,000	24.96	9,037,330.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	54,100	20.27	1,096,607.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	357,700	25.54	9,137,446.50
IMPERIAL BRANDS PLC	149,000	13.04	1,942,960.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	110,700	71.04	7,864,128.00

UNILEVER PLC	183,200	44.26	8,108,432.00
SMITH & NEPHEW PLC	137,000	14.92	2,044,040.00
NMC HEALTH PLC	13,300	0.24	3,192.00
ASTRAZENECA PLC	203,700	79.70	16,234,890.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	780,000	14.35	11,194,560.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	24,900	24.57	611,793.00
BARCLAYS PLC	2,740,000	1.06	2,928,512.00
HSBC HOLDINGS PLC	3,156,000	3.19	10,091,310.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	11,050,000	0.26	2,976,870.00
NATWEST GROUP PLC	770,000	1.07	830,060.00
STANDARD CHARTERED PLC	405,000	3.75	1,519,965.00
M&G PLC	440,000	1.57	692,560.00
ADMIRAL GROUP PLC	30,800	25.56	787,248.00
AVIVA PLC	604,000	2.73	1,652,544.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	219,000	2.88	630,720.00
LEGAL & GENERAL	940,000	2.04	1,920,420.00
PRUDENTIAL PLC	410,000	11.35	4,653,500.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	162,000	4.37	707,940.00
AVEVA GROUP PLC	11,200	47.18	528,416.00
SAGE GROUP PLC (THE)	175,000	7.03	1,230,250.00
HALMA PLC	59,000	21.58	1,273,220.00
BT GROUP PLC	1,370,000	1.01	1,392,605.00
VODAFONE GROUP PLC	4,190,000	1.05	4,410,394.00
SSE PLC	165,000	12.02	1,984,125.00
NATIONAL GRID PLC	547,000	8.33	4,558,698.00
SEVERN TRENT PLC	37,000	23.60	873,200.00
UNITED UTILITIES GROUP PLC	106,000	8.35	885,312.00
3I GROUP PLC	155,000	8.70	1,349,120.00
HARGREAVES LANSDOWN PLC	52,000	15.39	800,540.00
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	49,300	84.88	4,184,584.00
SCHRODERS PLC	19,700	27.01	532,097.00
ST JAMES S PLACE PLC	81,000	9.23	747,954.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	366,000	2.24	823,134.00
EXPERIAN PLC	140,000	26.70	3,738,000.00
INTERTEK GROUP PLC	25,600	58.32	1,492,992.00

	RELX PLC	299,000	16.94	5,066,555.00	
	INFORMA PLC	248,000	3.95	980,344.00	
	PEARSON	126,000	5.21	656,460.00	
	WPP PLC	200,000	6.28	1,257,200.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,000	5.41	773,630.00	
小計	銘柄数：84			214,506,169.50	
				(30,230,354,467)	
	組入時価比率：4.3%			4.4%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	32,000	18.91	605,280.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,220	811.00	989,420.00	
	GIVAUDAN-REG	1,421	3,799.00	5,398,379.00	
	SIKA AG-REG	22,000	213.10	4,688,200.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	81,200	42.07	3,416,084.00	
	GEBERIT AG-REG	5,670	509.40	2,888,298.00	
	ABB LTD	286,000	23.23	6,643,780.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,000	238.60	715,800.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,100	241.10	1,470,710.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	8,400	171.75	1,442,700.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	81,400	61.82	5,032,148.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,700	199.65	938,355.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	37.96	280,904.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	2,024.00	931,040.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	177	7,585.00	1,342,545.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	16	80,100.00	1,281,600.00	
	NESTLE SA-REG	462,700	108.32	50,119,664.00	
	ALCON INC	76,500	50.52	3,864,780.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	8,858	207.60	1,838,920.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,600	886.20	1,417,920.00	
	NOVARTIS AG-REG	344,900	78.78	27,171,222.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	109,480	317.25	34,732,530.00	
	VIFOR PHARMA AG	7,600	122.50	931,000.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	5,400	95.80	517,320.00	
	BALOISE HOLDING AG	7,400	140.40	1,038,960.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,810	368.50	1,772,485.00	
	SWISS RE LTD	46,200	73.50	3,395,700.00	
		23,520	334.70	7,872,144.00	

	ZURICH INSURANCE GROUP AG				
	TEMENOS AG-REG	10,400	136.35	1,418,040.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	24,900	62.74	1,562,226.00	
	SWISSCOM AG-REG	4,030	502.60	2,025,478.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	385,000	9.94	3,826,900.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	35,800	41.58	1,488,564.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,990	868.00	2,595,320.00	
	UBS GROUP AG	569,000	11.14	6,338,660.00	
	LONZA AG-REG	11,570	539.20	6,238,544.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	24,900	47.34	1,178,766.00	
	SGS SA-REG	920	2,351.00	2,162,920.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	11,400	81.80	932,520.00	
小計	銘柄数：39			202,505,826.80	
				(23,579,778,472)	
	組入時価比率：3.3%			3.5%	
スウェーデン ローナ	LUNDIN ENERGY AB	28,800	201.40	5,800,320.00	
	BOLIDEN AB	44,000	263.80	11,607,200.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	100,000	115.10	11,510,000.00	
	ASSA ABLOY AB-B	159,000	200.60	31,895,400.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	51,000	227.60	11,607,600.00	
	SKANSKA AB-B SHS	51,000	175.85	8,968,350.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	26,000	192.10	4,994,600.00	
	ALFA LAVAL AB	51,000	205.20	10,465,200.00	
	ATLAS COPCO AB-A	103,800	397.60	41,270,880.00	
	ATLAS COPCO AB-B	62,700	352.20	22,082,940.00	
	EPIROC AB - A	103,000	128.60	13,245,800.00	
	EPIROC AB - B	58,000	124.15	7,200,700.00	
	SANDVIK AB	178,000	172.90	30,776,200.00	
	SKF AB-B SHARES	58,000	179.65	10,419,700.00	
	VOLVO AB-B SHS	234,000	171.15	40,049,100.00	
	SECURITAS AB-B SHS	45,000	121.25	5,456,250.00	
	ELECTROLUX AB-B	34,000	185.45	6,305,300.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	58,000	91.54	5,309,320.00	
	EVOLUTION GAMING GROUP	18,900	573.60	10,841,040.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	127,000	137.60	17,475,200.00	

	ICA GRUPPEN AB	13,800	424.50	5,858,100.00	
	SWEDISH MATCH AB	26,000	655.80	17,050,800.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	92,700	295.00	27,346,500.00	
	NORDEA BANK ABP	515,000	69.29	35,684,350.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	250,000	83.74	20,935,000.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	243,000	83.32	20,246,760.00	
	SWEDBANK AB	138,000	145.36	20,059,680.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	229.80	5,745,000.00	
	INVESTOR AB-B SHS	71,500	549.20	39,267,800.00	
	KINNEVIK AB - B	39,000	318.70	12,429,300.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	12,600	401.00	5,052,600.00	
	ERICSSON LM-B	449,000	98.00	44,002,000.00	
	HEXAGON AB-B SHS	42,300	631.80	26,725,140.00	
	TELIA CO AB	381,000	34.19	13,026,390.00	
	TELE 2 AB-B SHS	78,000	124.55	9,714,900.00	
	EQT AB	35,000	159.05	5,566,750.00	
小計	銘柄数：36			615,992,170.00	
				(7,502,784,630)	
	組入時価比率：1.1%			1.1%	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	158,000	138.75	21,922,500.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,600	360.70	10,676,720.00	
	NORSK HYDRO	218,000	27.59	6,014,620.00	
	MOWI ASA	69,000	173.80	11,992,200.00	
	ORKLA ASA	115,000	89.12	10,248,800.00	
	DNB ASA	145,000	137.95	20,002,750.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,000	183.40	5,685,400.00	
	TELENOR ASA	116,000	147.80	17,144,800.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	334.60	4,316,340.00	
	ADEVINTA ASA	35,000	150.60	5,271,000.00	
小計	銘柄数：10			113,275,130.00	
				(1,349,106,798)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	16,700	686.80	11,469,560.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	33,700	378.40	12,752,080.00	

	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	31,600	924.60	29,217,360.00	
	DSV PANALPINA A S	32,700	950.20	31,071,540.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	460	8,875.00	4,082,500.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,040	9,606.00	9,990,240.00	
	PANDORA A/S	16,000	465.00	7,440,000.00	
	CARLSBERG B	15,600	871.00	13,587,600.00	
	AMBU A/S-B	24,000	169.30	4,063,200.00	
	COLOPLAST-B	18,200	999.60	18,192,720.00	
	DEMANT A/S	16,000	184.65	2,954,400.00	
	GN STORE NORD A/S	19,000	438.90	8,339,100.00	
	GENMAB A/S	10,000	2,178.00	21,780,000.00	
	H LUNDBECK A/S	10,500	200.50	2,105,250.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	267,000	408.90	109,176,300.00	
	DANSKE BANK AS	109,000	90.34	9,847,060.00	
	TRYG A/S	19,900	186.80	3,717,320.00	
	ORSTED A/S	30,000	848.20	25,446,000.00	
小計	銘柄数：18			325,232,230.00	
				(5,502,929,331)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
豪ドル	AMPOL LTD	40,000	25.00	1,000,000.00	
	OIL SEARCH LTD	280,000	3.11	870,800.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	265,000	5.33	1,412,450.00	
	SANTOS LTD.	265,000	5.31	1,407,150.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	20.61	350,370.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	152,000	18.97	2,883,440.00	
	ORICA LTD	59,000	17.04	1,005,360.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	67,000	30.14	2,019,380.00	
	BHP GROUP LIMITED	462,000	36.19	16,719,780.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	88,000	12.92	1,136,960.00	
	EVOLUTION MINING LTD	272,000	5.52	1,501,440.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	259,000	17.52	4,537,680.00	
	NEWCREST MINING	125,000	30.86	3,857,500.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	124,000	13.15	1,630,600.00	
	RIO TINTO LTD	57,300	95.58	5,476,734.00	
	SOUTH32 LTD	780,000	2.15	1,677,000.00	

CIMIC GROUP LTD	18,000	20.82	374,760.00
BRAMBLES LTD	228,000	10.87	2,478,360.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	108,000	3.89	420,120.00
AURIZON HOLDINGS LTD	305,000	4.32	1,317,600.00
SYDNEY AIRPORT	200,621	5.87	1,177,645.27
TRANSURBAN GROUP	434,000	14.14	6,136,760.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	88,000	29.06	2,557,280.00
CROWN RESORTS LTD	55,000	9.16	503,800.00
TABCORP HOLDINGS	340,000	3.55	1,207,000.00
TABCORP HOLDINGS LTD-RIGHTS	30,909	0.30	9,272.70
WESFARMERS LIMITED	175,900	46.74	8,221,566.00
COLES GROUP LTD	213,000	17.11	3,644,430.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	195,000	38.01	7,411,950.00
COCA-COLA AMATIL LTD	77,000	9.07	698,390.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	111,000	9.02	1,001,220.00
COCHLEAR LTD	10,300	190.04	1,957,412.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	29,500	64.70	1,908,650.00
SONIC HEALTHCARE LTD	69,000	32.51	2,243,190.00
CSL LIMITED	70,500	279.05	19,673,025.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	440,000	17.81	7,836,400.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	276,300	66.73	18,437,499.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	500,000	17.35	8,675,000.00
WESTPAC BANKING CORP	563,000	17.06	9,604,780.00
AMP LIMITED	530,000	1.63	863,900.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	361,000	4.75	1,714,750.00
MEDIBANK PRIVATE LTD	450,000	2.54	1,143,000.00
QBE INSURANCE	218,000	9.82	2,140,760.00
SUNCORP GROUP LTD	190,000	9.07	1,723,300.00
AFTERPAY LTD	32,200	78.20	2,518,040.00
COMPUTERSHARE LTD	76,000	12.74	968,240.00
WISETECH GLOBAL LTD	21,000	27.53	578,130.00
TELSTRA CORP LTD	650,000	2.84	1,846,000.00
TPG TELECOM LTD	52,000	7.81	406,120.00
AUSNET SERVICES	330,000	1.85	610,500.00
APA GROUP	180,000	10.48	1,886,400.00

	AGL ENERGY LTD	105,000	15.02	1,577,100.00	
	ASX LTD	30,700	85.90	2,637,130.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	53,000	126.20	6,688,600.00	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	19,200	58.52	1,123,584.00	
	REA GROUP LTD	8,800	112.81	992,728.00	
	SEEK LTD	48,000	20.16	967,680.00	
小計	銘柄数：57			185,368,715.97	
				(14,366,075,487)	
	組入時価比率：2.0%			2.1%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	193,000	7.08	1,367,405.00	
	A2 MILK CO LTD	117,000	18.27	2,137,590.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	87,000	34.25	2,979,750.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	58,000	13.88	805,040.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	307,000	4.81	1,476,670.00	
	MERCURY NZ LTD	100,000	5.19	519,000.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	201,000	4.94	993,945.00	
小計	銘柄数：7			10,279,400.00	
				(733,846,366)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	425,040	50.00	21,252,000.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	212,000	95.60	20,267,200.00	
	MTR CORP	243,000	40.05	9,732,150.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	335,000	59.80	20,033,000.00	
	SANDS CHINA LTD	384,000	33.50	12,864,000.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	10.54	2,845,800.00	
	WYNN MACAU LTD	228,000	14.46	3,296,880.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	249,000	25.30	6,299,700.00	
	WH GROUP LIMITED	1,440,000	6.62	9,532,800.00	
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	110,000	37.20	4,092,000.00	
	BANK OF EAST ASIA	220,060	17.18	3,780,630.80	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	564,000	21.70	12,238,800.00	
	HANG SENG BANK	119,000	119.10	14,172,900.00	
	AIA GROUP LTD	1,888,000	78.00	147,264,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	48,000	82.30	3,950,400.00	

	HKT TRUST AND HKT LTD	599,600	10.66	6,391,736.00	
	PCCW LTD	750,000	4.52	3,390,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	107,000	39.30	4,205,100.00	
	CLP HLDGS	250,000	75.30	18,825,000.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	225,000	42.65	9,596,250.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,640,365	11.10	18,208,051.50	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	188,100	380.60	71,590,860.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	409,040	41.10	16,811,544.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	310,000	20.95	6,494,500.00	
	HENDERSON LAND	229,443	29.30	6,722,679.90	
	KERRY PROPERTIES	114,000	20.25	2,308,500.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	234,916	39.40	9,255,690.40	
	PACIFIC CENTURY PREMIUM DEVE	81,000	1.79	144,990.00	
	SINO LAND CO.LTD	480,000	9.05	4,344,000.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	207,000	99.50	20,596,500.00	
	SWIRE PACIFIC-A	75,000	41.60	3,120,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	173,000	20.25	3,503,250.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	244,000	32.10	7,832,400.00	
小計	銘柄数：33			504,963,312.60	
				(6,928,096,648)	
	組入時価比率：1.0%			1.0%	
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	249,000	3.42	851,580.00	
	KEPPEL CORP.	232,000	4.36	1,011,520.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	440,000	0.93	409,200.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	192,600	3.62	697,212.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	850,000	0.69	590,750.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	14,000	18.56	259,840.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	289,000	4.37	1,262,930.00	
	DBS GROUP HLDGS	275,000	20.68	5,687,000.00	
	OCBC-ORD	524,000	8.56	4,485,440.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	187,000	19.45	3,637,150.00	
	VENTURE CORP LTD	45,000	19.06	857,700.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,290,000	2.27	2,928,300.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	129,000	8.68	1,119,720.00	

		CAPITALAND LIMITED	430,000	2.75	1,182,500.00	
		CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	7.95	556,500.00	
		UOL GROUP LIMITED	60,000	6.55	393,000.00	
	小計	銘柄数：16			25,930,342.00	
		組入時価比率：0.3%			(2,020,492,248)	0.3%
	新シェケル	ICL GROUP LTD	125,000	12.11	1,513,750.00	
		ELBIT SYSTEMS LTD	3,600	431.70	1,554,120.00	
		BANK HAPOALIM BM	183,000	19.60	3,586,800.00	
		BANK LEUMI LE-ISRAEL	238,000	16.51	3,929,380.00	
		ISRAEL DISCOUNT BANK-A	172,000	10.29	1,769,880.00	
		MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	23,000	66.60	1,531,800.00	
		NICE LTD	10,100	746.00	7,534,600.00	
		AZRIELI GROUP	6,500	172.10	1,118,650.00	
	小計	銘柄数：8			22,538,980.00	
		組入時価比率：0.1%			(711,555,598)	0.1%
	合計				680,614,825,607	(680,614,825,607)

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2) 株式以外の有価証券(2020年9月7日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	80,000	1,107,200.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,500	3,245,385.00	
		AMERICAN TOWER CORP	69,200	17,298,616.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	215,000	1,573,800.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,900	3,549,990.00	
		BOSTON PROPERTIES	22,600	1,984,506.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,000	1,491,040.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	64,800	10,406,232.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	40,800	5,923,344.00	

	DUKE REALTY CORP	56,600	2,160,422.00	
	EQUINIX INC	13,780	10,365,040.40	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,500	1,738,930.00	
	EQUITY RESIDENTIAL	56,900	3,306,459.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,900	2,220,174.00	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	20,700	2,242,845.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,100	910,866.00	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	81,000	2,296,350.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	109,000	1,301,460.00	
	INVITATION HOMES INC	85,000	2,436,950.00	
	IRON MOUNTAIN INC	43,100	1,299,896.00	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	83,000	1,527,200.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,600	2,082,960.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	27,900	1,044,855.00	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,500	1,160,700.00	
	PROLOGIS INC	115,200	11,607,552.00	
	PUBLIC STORAGE	24,500	5,197,430.00	
	REALTY INCOME CORP	52,400	3,372,988.00	
	REGENCY CENTERS CORP	26,200	1,088,086.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	17,200	5,164,988.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	47,900	3,364,496.00	
	SUN COMMUNITIES INC	14,300	2,083,367.00	
	UDR INC	46,300	1,634,853.00	
	VENTAS INC	57,400	2,557,744.00	
	VEREIT INC	160,000	1,112,000.00	
	VICI PROPERTIES INC	76,000	1,738,880.00	
	VORNADO REALTY TRUST	27,000	993,060.00	
	WELLTOWER INC	63,100	3,856,672.00	
	WEYERHAEUSER CO	115,000	3,339,600.00	
	WP CAREY INC	27,400	1,919,370.00	
小計	銘柄数：39	2,098,280	131,706,306.40	
			(14,008,282,748)	
	組入時価比率：2.0%		84.2%	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	653,365.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	16,000	218,720.00	

小計	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	328,680.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,000	230,560.00	
	銘柄数：4	63,900	1,431,325.00	(116,409,662)
	組入時価比率：0.0%			0.7%
ユーロ	COVIVIO	8,500	515,525.00	
	GECINA SA	7,100	788,810.00	
	ICADE	5,200	273,520.00	
	KLEPIERRE	32,300	446,224.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21,400	827,538.00	
	小計	銘柄数：5	74,500	2,851,617.50
	組入時価比率：0.1%			2.2%
英ポンド	BRITISH LAND	128,000	451,584.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	111,000	603,951.00	
	SEGRO PLC	176,000	1,614,976.00	
	小計	銘柄数：3	415,000	2,670,511.00
	組入時価比率：0.1%			2.3%
豪ドル	DEXUS	171,000	1,547,550.00	
	GOODMAN GROUP	254,000	4,610,100.00	
	GPT GROUP	330,000	1,247,400.00	
	LENDLEASE GROUP	111,000	1,355,310.00	
	MIRVAC GROUP	660,000	1,392,600.00	
	SCENTRE GROUP	790,000	1,722,200.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	350,000	1,284,500.00	
	VICINITY CENTRES	470,000	650,950.00	
	小計	銘柄数：8	3,136,000	13,810,610.00
	組入時価比率：0.2%			6.4%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	3,727,100.00	
	LINK REIT	312,000	19,656,000.00	
	小計	銘柄数：2	782,000	23,383,100.00
	組入時価比率：0.0%			1.9%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	440,800	1,445,824.00	

		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	439,972	725,953.80	
		CAPITALAND MALL TRUST	390,000	752,700.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	732,600.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	420,000	861,000.00	
		SUNTEC REIT	300,000	423,000.00	
	小計	銘柄数：6	2,360,772	4,941,077.80	
				(385,008,782)	
		組入時価比率：0.1%		2.3%	
	合計			16,636,127,808	
				(16,636,127,808)	

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 9月 7日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	8,392,223,901	-	8,263,999,525	128,224,376
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	42,512,000	-	42,540,000	28,000
米ドル	42,512,000	-	42,540,000	28,000
売建	607,007,700	-	607,950,500	942,800
米ドル	345,020,000	-	345,637,500	617,500
英ポンド	70,440,500	-	70,460,000	19,500
スイスフラン	69,970,200	-	69,864,000	106,200
スウェーデンクローナ	36,393,900	-	36,540,000	146,100
豪ドル	46,284,600	-	46,494,000	209,400
シンガポールドル	38,898,500	-	38,955,000	56,500
合計	-	-	-	129,139,176

(注)時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年 9月 7日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	612,042,306
コール・ローン	144,350,364
株式	41,588,925,308
投資信託受益証券	1,879,976,709
投資証券	32,018,815
派生商品評価勘定	13,676,836
未収配当金	47,986,891
差入委託証拠金	741,004,268
流動資産合計	45,059,981,497
資産合計	45,059,981,497
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,041,598
未払金	28,193,164
未払解約金	48,933,092
未払利息	205
その他未払費用	2,629,700
流動負債合計	88,797,759
負債合計	88,797,759
純資産の部	
元本等	
元本	34,441,716,263
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,529,467,475
元本等合計	44,971,183,738
純資産合計	44,971,183,738

(2020年 9月 7日現在)

負債純資産合計

45,059,981,497

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>新株予約権証券</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>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>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2020年 9月 7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	1.3057円
(10,000口当たり純資産額)	(13,057円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月 7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。

新株予約権証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

投資信託受益証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 9月 7日現在		2019年 9月 7日
期首		2019年 9月 7日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額		32,708,548,042円
同期中における追加設定元本額		7,250,137,457円
同期中における一部解約元本額		5,516,969,236円
期末元本額		34,441,716,263円
期末元本額の内訳*		
野村資産設計ファンド2015		25,177,946円
野村資産設計ファンド2020		25,187,129円
野村資産設計ファンド2025		45,242,213円
野村資産設計ファンド2030		58,670,825円
野村資産設計ファンド2035		46,348,774円
野村資産設計ファンド2040		93,389,285円
野村資産設計ファンド2045		14,507,249円
野村インデックスファンド・新興国株式		3,601,287,268円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		303,598,781円
野村資産設計ファンド2050		23,980,982円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		7,856,808円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		3,872,837円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		3,045,649円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		2,009,008円
インデックス・ブレンド(タイプ)		1,548,127円
インデックス・ブレンド(タイプ)		1,821,813円
インデックス・ブレンド(タイプ)		10,250,089円
インデックス・ブレンド(タイプ)		3,477,463円
インデックス・ブレンド(タイプ)		14,706,532円
野村つみたて外国株投信		2,058,264,596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)		536,476,475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)		1,237,887,491円
世界6資産分散ファンド		133,271,018円
野村資産設計ファンド2060		8,761,391円

NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIEマージング・マーケット・インデックス(為替ヘッジなし)連動型上場投信	314,321,592円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	438,671,813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)	9,668,383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)	402,266,250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)	428,264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)	24,996,052,657円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	6,916,688円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	5,261,857円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	5,101,760円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	2,387,250円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年9月7日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	12,600	11.57	145,782.00	
		INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	57,700	0.68	39,582.20	
		LUKOIL PJSC-SPON ADR	26,860	64.10	1,721,726.00	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	5,790	149.20	863,868.00	
		PJSC GAZPROM-ADR	382,000	4.68	1,789,670.00	
		ROSNEFT OJSC - GDR	72,800	4.87	354,681.60	
		SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	85,200	4.59	391,068.00	
		TATNEFT-SPONSORED ADR	14,000	42.34	592,760.00	
		YPF S.A. -SPONSORED ADR	10,600	5.42	57,452.00	
		PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	7,010	11.98	83,979.80	
		QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	7,400	32.46	240,204.00	
		CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	9,600	13.72	131,712.00	
		MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	10,700	6.39	68,373.00	
		NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	7,370	21.48	158,307.60	
		PJSC ALROSA	176,000	0.90	158,539.04	
		PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	41,700	26.33	1,097,961.00	
		POLYUS PJSC-REG S-GDR	3,960	114.00	451,440.00	
SEVERSTAL-GDR REG S	15,800	12.19	192,602.00			

SOUTHERN COPPER CORP	6,300	46.98	295,974.00
BEST INC - ADR	8,600	4.13	35,518.00
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	24,100	33.27	801,807.00
NIO INC ADR	69,900	17.98	1,256,802.00
HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR	8,800	45.00	396,000.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	23,440	53.82	1,261,540.80
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	119,740	281.39	33,693,638.60
BAOZUN INC-SPN ADR	2,300	38.70	89,010.00
JD.COM INC-ADR	54,520	80.00	4,361,600.00
PINDUODUO INC ADR	16,730	85.04	1,422,719.20
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	28,300	30.66	867,678.00
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	25,500	16.98	432,990.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	25,900	14.45	374,255.00
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	8,500	35.20	299,200.00
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	4,000	13.46	53,840.00
ZAI LAB LTD - ADR	3,370	77.91	262,556.70
HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD - ADR	3,890	34.52	134,282.80
BANCO DE CHILE-ADR	14,300	17.03	243,529.00
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	8,400	15.90	133,560.00
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	7,330	29.89	219,093.70
CREDICORP LTD	4,350	132.39	575,896.50
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	673,300	2.94	1,984,262.23
STATE BANK OF INDIA-GDR	11,070	28.00	309,960.00
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	87,890	0.88	77,431.09
GDS HOLDINGS LTD-ADR	4,340	76.69	332,834.60
GLOBANT SA	2,570	170.00	436,900.00
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	5,300	6.74	35,722.00
MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR	28,650	8.95	256,417.50
ENEL AMERICAS S.A-ADR	47,900	7.26	347,754.00
ENEL CHILE SA-ADR	42,900	3.68	157,872.00
INTER RAO UES PJSC	2,280,000	0.07	162,085.20
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	85,170	1.79	152,582.05
NOAH HLDS LTD ADR	1,500	28.55	42,825.00
GSX TECHEDU INC- ADR	5,000	80.01	400,050.00
NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	9,310	149.29	1,389,889.90

	TAL EDUCATION GROUP-ADR	24,830	75.13	1,865,477.90	
	51JOB INC-ADR	2,210	67.43	149,020.30	
	KE HOLDINGS INC ADR	6,710	45.44	304,902.40	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	87,648	0.85	74,500.80	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	6,300	47.02	296,226.00	
	HUYA INC-ADR	2,700	27.05	73,035.00	
	IQIYI INC-ADR	14,300	22.01	314,743.00	
	NETEASE INC-ADR	5,260	485.25	2,552,415.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	23,500	15.67	368,245.00	
	58.COM INC-ADR	5,780	55.85	322,813.00	
	AUTOHOME INC-ADR	3,860	85.77	331,072.20	
	BAIDU INC - SPON ADR	17,700	122.87	2,174,799.00	
	JOYY INC	3,160	80.83	255,422.80	
	MOMO INC-SPON ADR	8,800	15.50	136,400.00	
	SINA CORP	4,150	39.83	165,294.50	
	WEIBO CORP-SPON ADR	3,400	36.08	122,672.00	
	YANDEX NV-A	19,770	64.44	1,273,978.80	
小計	銘柄数：70			72,618,802.81	
				(7,723,735,866)	
	組入時価比率：17.2%			18.6%	
メキシコペソ	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	60,458	35.70	2,158,350.60	
	CEMEX SAB - CPO	829,985	6.87	5,701,996.95	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	186,983	59.48	11,121,748.84	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	380.77	3,202,275.70	
	ALFA S.A.B. -A	172,100	14.21	2,445,541.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	43.04	1,502,096.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	14,300	242.70	3,470,610.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	21,400	164.12	3,512,168.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	12,900	165.56	2,135,724.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	341,000	51.85	17,680,850.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	26,100	95.79	2,500,119.00	
	BECLE SAB DE CV	25,000	42.24	1,056,000.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	32,495	88.51	2,876,132.45	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	129,400	122.29	15,824,326.00	
	GRUMA S.A.B. -B	13,400	255.84	3,428,256.00	

	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	101,000	40.08	4,048,080.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	95,000	34.97	3,322,150.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	167,300	74.72	12,500,656.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	140,200	15.86	2,223,572.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,192,000	13.16	28,846,720.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	38,700	60.30	2,333,610.00	
	GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	153,400	28.80	4,417,920.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	23,100	64.83	1,497,573.00	
小計	銘柄数：23			137,806,475.54	
				(680,763,989)	
	組入時価比率：1.5%			1.6%	
リアル	COSAN SA	9,100	76.87	699,517.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	223,400	23.33	5,211,922.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	310,700	22.92	7,121,244.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	48,000	21.49	1,031,520.00	
	BRASKEM SA-PREF A	12,100	21.88	264,748.00	
	KLABIN SA-UNIT	42,700	24.95	1,065,365.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	14.97	691,614.00	
	GERDAU SA PFD NPV	74,500	19.92	1,484,040.00	
	VALE SA	238,121	60.49	14,403,939.29	
	SUZANO SA	39,060	47.54	1,856,912.40	
	WEG SA	51,924	64.49	3,348,578.76	
	LOCALIZA RENT A CAR	37,760	50.75	1,916,320.00	
	RUMO SA	70,600	22.34	1,577,204.00	
	CCR SA	75,600	14.40	1,088,640.00	
	B2W CIA DIGITAL	13,500	102.30	1,381,050.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	50,492	30.84	1,557,173.28	
	LOJAS RENNER S.A.	49,595	46.30	2,296,248.50	
	MAGAZINE LUIZA SA	46,000	88.77	4,083,420.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	43,600	22.38	975,768.00	
	VIA VAREJO SA	92,000	18.90	1,738,800.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	29,600	20.62	610,352.00	
	CIA BRASILIERA DE DISTRIBUICIAO	11,103	63.27	702,486.81	
	RAIA DROGASIL SA	11,900	112.34	1,336,846.00	
	AMBEV SA	308,956	12.60	3,892,845.60	

BRF SA	39,700	19.98	793,206.00	
JBS SA	74,600	21.87	1,631,502.00	
NATURA & CO HOLDING SA	47,900	49.45	2,368,655.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	13,900	66.41	923,099.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	30,300	74.58	2,259,774.00	
HYPERA SA	23,900	32.27	771,253.00	
BANCO BRADESCO S.A.	73,954	20.32	1,502,745.28	
BANCO BRADESCO SA - PREF	290,036	21.97	6,372,090.92	
BANCO DO BRASIL SA	53,600	33.95	1,819,720.00	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	30.41	742,004.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	314,691	24.96	7,854,687.36	
ITAUSA SA	284,017	9.77	2,774,846.09	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	44,100	27.00	1,190,700.00	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	60,764	6.95	422,309.80	
PORTO SEGURO SA	7,000	53.75	376,250.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	18,149	44.08	800,007.92	
CIELO SA	73,763	4.68	345,210.84	
TELEFONICA BRASIL-PREF	26,805	48.80	1,308,084.00	
TIM PARTICIPACOES SA	46,552	14.74	686,176.48	
CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	18,000	37.14	668,520.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	16,500	36.45	601,425.00	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	62,498	10.79	674,353.42	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	8,600	63.96	550,056.00	
CPFL ENERGIA SA	19,300	29.35	566,455.00	
ENERGISA SA-UNITS	10,200	44.11	449,922.00	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	50,000	23.78	1,189,000.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	21,300	49.16	1,047,108.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	133,833	58.33	7,806,478.89	
BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT	16,100	79.50	1,279,950.00	
COGNA EDUCACAO	103,956	6.01	624,775.56	
ENGIE BRASIL SA	12,000	43.28	519,360.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	17,600	22.25	391,600.00	
小計 銘柄数：56			111,647,880.20	
			(2,239,656,476)	

	組入時価比率：5.0%			5.4%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	25,900	5,720.10	148,150,590.00	
	EMPRESAS CMPC SA	71,951	1,615.00	116,200,865.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	50,200	2,520.00	126,504,000.00	
	CENCOSUD SA	80,738	1,212.00	97,854,456.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	28,800	1,805.00	51,984,000.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	3,241	25,310.00	82,029,710.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	8,972	4,861.20	43,614,686.40	
	AGUAS ANDINAS SA-A	216,000	231.80	50,068,800.00	
	COLBUN SA	471,000	123.50	58,168,500.00	
	CENCOSUD SHOPPING SA	23,000	1,308.90	30,104,700.00	
小計	銘柄数：10			804,680,307.40	(110,724,010)
	組入時価比率：0.2%			0.3%	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	15,900	27,260.00	433,434,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	13,000	22,800.00	296,400,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,800	20,860.00	705,068,000.00	
小計	銘柄数：3			1,434,902,000.00	(41,038,197)
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	3,800	11.40	43,320.00	
	FF GROUP	2,030	0.96	1,948.80	
	OPAP SA	13,190	8.03	105,915.70	
	JUMBO SA	6,732	15.04	101,249.28	
	HELLENIC TELECOM	12,600	13.23	166,698.00	
小計	銘柄数：5			419,131.78	(52,756,117)
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	15,000	19.19	287,850.00	
	小計	銘柄数：1		287,850.00	(40,566,700)
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,300	80.15	665,245.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,000	8.78	1,018,480.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	41,460	16.88	699,844.80	
	KOC HLDGS	53,000	14.77	782,810.00	

	TURK HAVA YOLLARI AO	32,186	10.54	339,240.44	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	3,320	84.50	280,540.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	30,000	67.75	2,032,500.00	
	ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYII	12,740	20.10	256,074.00	
	AKBANK T.A.S	205,000	4.92	1,008,600.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	142,160	6.80	966,688.00	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	91,800	5.00	459,000.00	
	YAPI VE KREDI BANKASI A.S.	190,000	2.04	387,600.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	40,000	7.81	312,400.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	77,000	14.80	1,139,600.00	
小計	銘柄数：14			10,348,622.24	
				(148,088,784)	
	組入時価比率：0.3%			0.4%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	526.00	2,656,300.00	
	MONETA MONEY BANK AS	42,000	54.90	2,305,800.00	
	CEZ AS	8,500	447.00	3,799,500.00	
小計	銘柄数：3			8,761,600.00	
				(41,617,600)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	25,000	1,691.00	42,275,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	9,200	7,200.00	66,240,000.00	
	OTP BANK NYRT	14,400	10,140.00	146,016,000.00	
小計	銘柄数：3			254,531,000.00	
				(88,933,131)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
ズロチ	GRUPA LOTOS SA	6,800	38.85	264,180.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	18,800	50.28	945,264.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	97,770	5.30	518,181.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	9,900	134.50	1,331,550.00	
	LPP SA	94	7,195.00	676,330.00	
	DINO POLSKA SA	3,820	221.00	844,220.00	
	BANK PEKAO SA	10,520	50.90	535,468.00	
	MBANK	900	181.00	162,900.00	
	PKO BANK POLSKI SA	56,200	21.01	1,180,762.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,550	144.50	223,975.00	

	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	37,500	27.00	1,012,500.00	
	ORANGE POLSKA SA	39,150	7.15	279,922.50	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	51,730	5.54	286,998.04	
	CYFROWY POLSAT SA	18,900	26.66	503,874.00	
	CD PROJEKT RED SA	4,080	428.00	1,746,240.00	
小計	銘柄数：15			10,512,364.54	
				(296,974,298)	
	組入時価比率：0.7%			0.7%	
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY	367,000	0.05	19,451.00	
	LEGEND HLDS CORP-RTS	18,100	0.00	0.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	100,000	5.78	578,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,434,900	3.43	4,921,707.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	231,000	13.36	3,086,160.00	
	CNOOC LTD	1,169,000	8.36	9,772,840.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION-H	66,000	3.35	221,100.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,400,000	2.57	3,598,000.00	
	YANZHOU COAL MINING-H	96,000	5.90	566,400.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	206,000	1.56	321,360.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	77,000	58.20	4,481,400.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	235,000	11.14	2,617,900.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	152,000	12.10	1,839,200.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	1.90	399,000.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	104,000	5.22	542,880.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	180,000	3.11	559,800.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	9.21	902,580.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H	57,000	8.81	502,170.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO-H	347,000	5.75	1,995,250.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	78,000	4.65	362,700.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	9.24	933,240.00	
	AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	202,000	4.76	961,520.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	92,000	14.48	1,332,160.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	299,000	4.12	1,231,880.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	5.08	885,952.00	

CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	94,000	35.25	3,313,500.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	230,000	3.80	874,000.00
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	135,000	5.78	780,300.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	153,250	6.46	989,995.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	3.47	248,105.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	126,000	2.24	282,240.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	39,984	6.29	251,499.36
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	36,300	24.90	903,870.00
CITIC LTD	362,000	6.83	2,472,460.00
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	165,940	8.55	1,418,787.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS	30,000	11.46	343,800.00
CRRC CORP LTD-H	275,350	3.21	883,873.50
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	32,000	19.14	612,480.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	37,500	21.05	789,375.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	117,800	16.00	1,884,800.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H	61,000	7.90	481,900.00
BOC AVIATION LTD	11,300	58.90	665,570.00
A-LIVING SERVICES CO LTD	33,000	38.40	1,267,200.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	281,000	4.56	1,281,360.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	88,000	54.10	4,760,800.00
GREENTOWN SER	60,000	9.58	574,800.00
AIR CHINA LIMITED-H	102,000	5.48	558,960.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	76,000	3.27	248,520.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	4.31	456,860.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	140,000	3.93	550,200.00
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	98,000	5.24	513,520.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	82,000	8.76	718,320.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	4.74	483,480.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	7.44	505,920.00
SHENZHEN EXPRESSWAY-H	32,000	6.89	220,480.00
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	79,000	12.14	959,060.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	5.34	608,760.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO	39,200	26.75	1,048,600.00

LTD				
BAIC MOTOR CORPORATION LIMITED	96,000	3.47	333,120.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	218,000	6.78	1,478,040.00	
BYD CO LTD-H	44,000	81.95	3,605,800.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	184,000	5.36	986,240.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	390,000	16.34	6,372,600.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	238,000	8.99	2,139,620.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	199,890	6.64	1,327,269.60	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	87,000	27.20	2,366,400.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	70,000	76.55	5,358,500.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	204,000	2.20	448,800.00	
LI NING CO LTD	136,000	32.75	4,454,000.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	50,100	126.00	6,312,600.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD.	51,000	53.45	2,725,950.00	
MEITUAN DIANPING B	227,100	261.80	59,454,780.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	54,800	14.50	794,600.00	
GOME RETAIL HODINGS LTD	523,360	1.08	565,228.80	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	77,000	9.76	751,520.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	29,500	49.20	1,451,400.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	149,000	9.67	1,440,830.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	7,000	90.50	633,500.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	93,333	50.05	4,671,316.65	
TSING TAO BREWERY CO-H	24,000	64.90	1,557,600.00	
CHINA FEIHE LTD	58,000	16.48	955,840.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.00	0.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	180,000	37.80	6,804,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	4.97	554,155.00	
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	118,000	15.10	1,781,800.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	70,000	7.20	504,000.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	308,000	5.56	1,712,480.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	28,000	118.70	3,323,600.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	23,000	25.80	593,400.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	44,500	61.10	2,718,950.00	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	24,000	19.86	476,640.00	

SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	160,000	18.64	2,982,400.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	13.74	699,366.00
SINOPHARM GROUP CO-H	87,200	18.06	1,574,832.00
3SBIO, INC	77,000	8.98	691,460.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	58,500	51.80	3,030,300.00
CANSINO BIOLOGICS INC	3,800	169.40	643,720.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	81,000	8.78	711,180.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	4.22	392,460.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	124,000	3.36	416,640.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	367,200	16.12	5,919,264.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	76,000	35.80	2,720,800.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	62,500	4.63	289,375.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	34,500	30.60	1,055,700.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	616,500	9.09	5,603,985.00
SSY GROUP LTD	82,000	4.86	398,520.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,638,000	2.51	4,111,380.00
BANK OF CHINA LTD-H	5,139,000	2.49	12,796,110.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	597,790	3.94	2,355,292.60
CHINA CITIC BANK-H	560,000	3.19	1,786,400.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	6,146,000	5.44	33,434,240.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	257,000	2.71	696,470.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	254,692	37.25	9,487,277.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	374,800	4.64	1,739,072.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	137,000	3.19	437,030.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	3,910,000	4.26	16,656,600.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	640,000	3.54	2,265,600.00
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	6.94	1,068,760.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	486,000	18.40	8,942,400.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	172,200	21.20	3,650,640.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	308,000	0.80	246,400.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	12.20	1,262,358.40
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	59,100	30.20	1,784,820.00
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	587,000	2.48	1,455,760.00

PICC PROPERTY & CASUALTY -H	434,420	5.90	2,563,078.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	378,000	80.50	30,429,000.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	25,000	50.60	1,265,000.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	66,000	16.54	1,091,640.00	
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	142,000	19.32	2,743,440.00	
KINGSOFT CORP LTD	54,000	42.45	2,292,300.00	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	33,000	41.35	1,364,550.00	
ZTE CORP-H	47,252	20.90	987,566.80	
LEGEND HLDS CORP	18,100	10.70	193,670.00	
LENOVO GROUP LTD	498,000	5.21	2,594,580.00	
XIAOMI CORPORATION	680,000	24.50	16,660,000.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	45,000	47.95	2,157,750.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	80,000	2.98	238,400.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	43,000	26.20	1,126,600.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	58,500	10.94	639,990.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	47,700	118.10	5,633,370.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	26,000	29.15	757,900.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	217,000	23.65	5,132,050.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	262,000	9.42	2,468,040.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	866,000	2.52	2,182,320.00	
CHINA TOWER CORP LTD	2,790,000	1.48	4,129,200.00	
CHINA UNICOM HONGKONG LTD	378,000	5.29	1,999,620.00	
CHINA MOBILE LTD	395,000	53.15	20,994,250.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	24.75	891,000.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	153,000	22.10	3,381,300.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	56,000	36.20	2,027,200.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	49,600	90.55	4,491,280.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	186,000	5.27	980,220.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	405,000	3.03	1,227,150.00	
GUANGDONG INVESTMENT	184,000	12.10	2,226,400.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	1.50	930,000.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	48,000	11.72	562,560.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	4.45	1,183,700.00	

CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	592,000	0.85	503,200.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H	92,400	18.68	1,726,032.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	123,000	18.50	2,275,500.00
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	9.61	793,786.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	62,000	11.46	710,520.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	173,600	6.94	1,204,784.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	102,000	13.34	1,360,680.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	46,000	17.58	808,680.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS	25,000	14.44	361,000.00
CHINA YUHUA EDUCATION CO.LTD	76,000	7.13	541,880.00
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	15,000	33.80	507,000.00
CGN POWER CO LTD-H	627,000	1.63	1,022,010.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	218,000	4.90	1,068,200.00
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	240,000	1.48	355,200.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	150,000	8.88	1,332,000.00
HUANENG POWER INTL INC-H	238,000	3.15	749,700.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	232,000	19.46	4,514,720.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	23,200	111.30	2,582,160.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	56,000	14.70	823,200.00
WUXI APPTTEC CO LTD	20,084	113.10	2,271,500.40
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	65,000	188.20	12,233,000.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	94,000	10.42	979,480.00
CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD	98,000	8.68	850,640.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	126,000	16.94	2,134,440.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	330,000	4.80	1,584,000.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	244,000	21.55	5,258,200.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	85,000	6.82	579,700.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	208,444	36.90	7,691,583.60
CHINA VANKE CO LTD-H	99,300	24.35	2,417,955.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	196,000	6.51	1,275,960.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	494,380	9.68	4,785,598.40
GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	80,000	10.04	803,200.00

	KAISA GROUP HLDS LTD	115,000	4.26	489,900.00	
	KWG GROUP HOLDINGS LTD	68,500	14.66	1,004,210.00	
	LOGAN GROUP CO LTD	74,000	13.44	994,560.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	116,500	42.85	4,992,025.00	
	POLY PROPERTY SERVICES CO LTD	7,400	66.05	488,770.00	
	SEAZEN GROUP LTD	168,000	6.68	1,122,240.00	
	SHENZHEN INVESTMENT LTD	176,000	2.53	445,280.00	
	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	72,000	34.95	2,516,400.00	
	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	146,000	1.78	259,880.00	
	SOHO CHINA LTD	106,000	2.38	252,280.00	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	165,000	32.15	5,304,750.00	
	WHARF(HOLDING)	94,000	14.90	1,400,600.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	370,000	1.48	547,600.00	
	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	91,000	3.51	319,410.00	
	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	67,000	4.51	302,170.00	
	CHINA LITERATURE LTD	20,800	54.45	1,132,560.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	870,000	1.19	1,035,300.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	364,900	518.00	189,018,200.00	
小計	銘柄数：207			739,824,006.11	
				(10,150,385,363)	
	組入時価比率：22.6%			24.3%	
リング	DIALOG GROUP BHD	219,344	3.71	813,766.24	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	14,500	20.66	299,570.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	144,000	5.55	799,200.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	81,100	5.20	421,720.00	
	GAMUDA BERHAD	100,200	3.39	339,678.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	7.32	247,416.00	
	SIME DARBY BERHAD	220,000	2.37	521,400.00	
	MISC BHD	99,960	7.62	761,695.20	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	56,460	5.01	282,864.60	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	51,400	3.93	202,002.00	
	GENTING BHD	112,000	3.55	397,600.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	229,000	2.29	524,410.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA BERHAD	9,500	19.92	189,240.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	7,700	31.26	240,702.00	

	GENTING PLANTATIONS BHD	14,600	9.90	144,540.00	
	IOI CORP	162,000	4.40	712,800.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG	26,400	22.56	595,584.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	4,400	139.60	614,240.00	
	PPB GROUP BERHAD	35,040	18.60	651,744.00	
	QL RESOURCES BHD	40,000	9.63	385,200.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	5.04	727,272.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,000	14.00	1,638,000.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES BERHAD	40,000	13.40	536,000.00	
	SUPERMAX CORP BHD	109,400	9.60	1,050,240.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	297,000	8.38	2,488,860.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	156,000	5.26	820,560.00	
	AMMB HOLDING	125,000	3.02	377,500.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	416,000	3.26	1,356,160.00	
	HONG LEONG BANK	37,460	14.88	557,404.80	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	13.78	184,955.16	
	MALAYAN BANKING	246,000	7.21	1,773,660.00	
	PUBLIC BANK BHD	193,260	16.00	3,092,160.00	
	RHB BANK BHD	125,023	4.68	585,107.64	
	TELEKOM MALAYSIA	62,000	4.24	262,880.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	195,000	3.01	586,950.00	
	DIGI.COM BERHAD	186,000	4.11	764,460.00	
	MAXIS BHD	146,200	5.05	738,310.00	
	TENAGA NASIONAL	147,000	11.16	1,640,520.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	41,500	17.36	720,440.00	
	YTL CORPORATION	210,847	0.70	147,592.90	
小計	銘柄数：40			29,194,404.54	
				(748,544,532)	
	組入時価比率：1.7%			1.8%	
パーツ	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR RTS	16,500	1.75	28,875.00	
	IRPC PCL - NVDR	900,000	2.26	2,034,000.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	86,400	88.00	7,603,200.00	
	PTT PCL-NVDR	753,000	36.00	27,108,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	83,000	39.25	3,257,750.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	110,967	23.30	2,585,531.10	

PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	151,994	45.25	6,877,728.50	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	50,600	369.00	18,671,400.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	476,000	10.40	4,950,400.00	
AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	294,000	58.25	17,125,500.00	
BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	447,100	9.05	4,046,255.00	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	290,000	3.98	1,154,200.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	182,878	22.60	4,133,042.80	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	86,025	28.75	2,473,218.75	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	354,597	14.90	5,283,495.30	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	38.00	2,800,600.00	
CP ALL PCL-NVDR	375,000	63.75	23,906,250.00	
OSOTSPA PCL-NVDR	33,000	39.00	1,287,000.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	279,000	31.75	8,858,250.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	199,800	14.10	2,817,180.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	655,000	20.80	13,624,000.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,200	110.50	3,558,100.00	
BANGKOK BANK(F)	28,600	105.50	3,017,300.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	37,300	82.25	3,067,925.00	
KASIKORNBANK PCL(F)	72,000	82.50	5,940,000.00	
KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	9.55	2,550,327.50	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	50,800	71.00	3,606,800.00	
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,098,957	0.93	1,022,030.01	
TRUE CORP PCL-NVDR	920,000	3.30	3,036,000.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	74,200	183.50	13,615,700.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR	140,000	54.75	7,665,000.00	
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	43,000	35.75	1,537,250.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	35,000	31.00	1,085,000.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	49.25	2,413,250.00	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	32,000	45.00	1,440,000.00	
BANGKOK COMMERCIAL ASSET-NVDR	80,000	22.10	1,768,000.00	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	34,000	45.25	1,538,500.00	
ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	17,300	217.00	3,754,100.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	95,000	41.75	3,966,250.00	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	59,000	63.50	3,746,500.00	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	165,000	31.75	5,238,750.00	

	RATCH GROUP PCL-NVDR	43,000	55.50	2,386,500.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	133,900	46.50	6,226,350.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	620,000	7.40	4,588,000.00	
小計	銘柄数：44			247,393,508.96	
				(836,190,060)	
	組入時価比率：1.9%			2.0%	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	49.35	7,205,100.00	
	AYALA CORPORATION	15,402	690.00	10,627,380.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,465	380.00	2,076,700.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	173,700	61.70	10,717,290.00	
	SM INVESTMENTS CORP	17,100	846.00	14,466,600.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	69,000	104.00	7,176,000.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	24,400	136.00	3,318,400.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	65,000	49.80	3,237,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	67,000	138.90	9,306,300.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	53,599	65.00	3,483,935.00	
	BDO UNIBANK INC	124,998	87.80	10,974,824.40	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	127,695	33.95	4,335,245.25	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	3.35	2,505,130.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,070	2,040.00	4,222,800.00	
	PLDT INC	4,970	1,416.00	7,037,520.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	259.60	4,387,240.00	
	ABOITIZ POWER CORP	76,700	26.00	1,994,200.00	
	AYALA LAND LTD	499,000	28.20	14,071,800.00	
	MEGAWORLD CORP	910,000	2.89	2,629,900.00	
	ROBINSONS LAND CO	132,000	14.80	1,953,600.00	
	SM PRIME HLDGS	652,975	27.95	18,250,651.25	
小計	銘柄数：21			143,977,615.90	
				(315,310,978)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	
ルピア	ADARO ENERGY PT	839,200	1,205.00	1,011,236,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	99,150	23,100.00	2,290,365,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,660,000	780.00	1,294,800,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	64,000	11,650.00	745,600,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	176,000	10,350.00	1,821,600,000.00	

	INDAH KIAT PULP&PAPER	148,600	8,600.00	1,277,960,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,335,000	5,050.00	6,741,750,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	300,000	1,600.00	480,000,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	178,000	10,300.00	1,833,400,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	266,200	7,600.00	2,023,120,000.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	499,000	6,100.00	3,043,900,000.00	
	GUDANG GARAM TBK	29,200	47,475.00	1,386,270,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	640,000	1,640.00	1,049,600,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	523,500	8,400.00	4,397,400,000.00	
	KALBE FARMA PT	1,540,000	1,590.00	2,448,600,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	642,000	31,900.00	20,479,800,000.00	
	BANK MANDIRI	1,107,000	5,925.00	6,558,975,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	499,000	5,225.00	2,607,275,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,536,000	3,550.00	12,552,800,000.00	
	TELEKOMUNIKASI	3,330,000	2,860.00	9,523,800,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	160,000	2,300.00	368,000,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	593,500	1,290.00	765,615,000.00	
小計	銘柄数：22			84,701,866,000.00	
				(609,853,435)	
	組入時価比率：1.4%			1.5%	
ウォン	GS HOLDINGS CORP	3,600	33,450.00	120,420,000.00	
	S-OIL CORPORATION	2,690	56,900.00	153,061,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,580	154,000.00	551,320,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	6,330	48,500.00	307,005,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	998	98,100.00	97,903,800.00	
	LG CHEM LTD - PREFERRED	384	374,000.00	143,616,000.00	
	LG CHEMICALS LTD	3,000	743,000.00	2,229,000,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,050	183,000.00	192,150,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,810	89,900.00	162,719,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	4,779	25,050.00	119,713,950.00	
	KOREA ZINC CO LTD	592	398,000.00	235,616,000.00	
	POSCO	4,400	186,000.00	818,400,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	4,520	23,400.00	105,768,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL COMPANY	1,600	90,900.00	145,440,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,220	24,950.00	105,289,000.00	
		4,650	32,000.00	148,800,000.00	

HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR				
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,520	11,400.00	97,128,000.00	
CJ CORP	1,100	82,600.00	90,860,000.00	
HANWHA CORPORATION	2,470	32,200.00	79,534,000.00	
LG CORP	6,050	80,100.00	484,605,000.00	
LOTTE CORP	1,620	30,050.00	48,681,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	5,700	107,500.00	612,750,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	2,340	212,000.00	496,080,000.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,900	22,450.00	65,105,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	3,350	26,900.00	90,115,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	597	224,000.00	133,728,000.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	2,377	86,100.00	204,659,700.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	30,700	5,190.00	159,333,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	3,900	13,750.00	53,625,000.00	
S-1 CORPORATION	1,450	86,000.00	124,700,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,140	135,000.00	153,900,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	4,280	18,600.00	79,608,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	14,890	3,375.00	50,253,750.00	
CJ LOGISTICS	780	158,500.00	123,630,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	5,320	30,600.00	162,792,000.00	
HANON SYSTEMS	11,650	12,650.00	147,372,500.00	
HYUNDAI MOBIS	3,960	230,000.00	910,800,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	8,920	172,500.00	1,538,700,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,640	85,700.00	226,248,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	83,900.00	123,333,000.00	
KIA MOTORS CORP	16,400	42,150.00	691,260,000.00	
COWAY CO LTD	3,340	79,400.00	265,196,000.00	
LG ELECTRONICS INC	5,970	84,000.00	501,480,000.00	
HLB INC	2,431	100,400.00	244,072,400.00	
FILA HOLDINGS CORP	2,930	38,850.00	113,830,500.00	
KANGWON LAND INC	7,900	20,800.00	164,320,000.00	
CJ ENM CO LTD	657	131,500.00	86,395,500.00	
LOTTE SHOPPING CO	800	78,700.00	62,960,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	427	207,500.00	88,602,500.00	

HOTEL SHILLA CO LTD	1,960	74,600.00	146,216,000.00	
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	122,000.00	59,170,000.00	
E-MART CO	1,181	127,000.00	149,987,000.00	
GS RETAIL CO LTD	1,140	32,300.00	36,822,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	510	396,500.00	202,215,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,800	135,000.00	243,000,000.00	
OTTOGI CORPORATION	70	581,000.00	40,670,000.00	
KT & G CORP	7,280	82,700.00	602,056,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	1,930	169,500.00	327,135,000.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	410	60,300.00	24,723,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	51,200.00	77,824,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	584	1,453,000.00	848,552,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	705,000.00	73,320,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	4,720	98,800.00	466,336,000.00	
ALTEOGEN INC	1,420	214,200.00	304,164,000.00	
CELLTRION INC	6,120	294,000.00	1,799,280,000.00	
SEEGENE, INC.	1,360	233,600.00	317,696,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,030	109,800.00	113,094,000.00	
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	481	300,000.00	144,300,000.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,330	146,000.00	340,180,000.00	
YUHAN CORPORATION	3,620	65,200.00	236,024,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	22,800	5,140.00	117,192,000.00	
HANA FINANCIAL HOLDINGS	20,100	27,950.00	561,795,000.00	
INDUSTRIAL BK OF KOREA	15,040	8,200.00	123,328,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	25,550	36,950.00	944,072,500.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP	28,600	29,650.00	847,990,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	29,800	8,460.00	252,108,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	2,850	43,550.00	124,117,500.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,400	21,950.00	74,630,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	1,890	182,000.00	343,980,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,640	62,200.00	288,608,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	1,950	157,000.00	306,150,000.00	
DUZONBIZON CO., LTD.	1,240	126,500.00	156,860,000.00	
KMW CO.LTD.	1,140	85,800.00	97,812,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS	303,960	55,600.00	16,900,176,000.00	

	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	53,150	47,500.00	2,524,625,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	860	158,000.00	135,880,000.00	
	LG.DISPLAY CO LTD	16,200	14,850.00	240,570,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	3,490	135,000.00	471,150,000.00	
	SAMSUNG SDI CO,LTD	3,600	439,000.00	1,580,400,000.00	
	SK HYNIX INC	35,170	78,700.00	2,767,879,000.00	
	LG UPLUS CORP	13,300	11,800.00	156,940,000.00	
	SK TELECOM CO LTD	2,700	237,500.00	641,250,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER	14,200	20,700.00	293,940,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,599	23,650.00	37,816,350.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,360	28,600.00	38,896,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,140	69,000.00	216,660,000.00	
	MERITZ SECURITIES	24,500	3,225.00	79,012,500.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	24,737	9,450.00	233,764,650.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	9,240.00	71,425,200.00	
	SAMSUNG SECURITIES	3,565	31,400.00	111,941,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,024	773,000.00	791,552,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,900	18,200.00	107,380,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	972	813,000.00	790,236,000.00	
	NETMARBLE CORP	1,470	197,500.00	290,325,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	310	204,300.00	63,333,000.00	
	KAKAO CORP	3,530	402,000.00	1,419,060,000.00	
	NAVER CORP	7,780	328,500.00	2,555,730,000.00	
小計	銘柄数：107			57,423,228,300.00	
				(5,150,863,578)	
	組入時価比率：11.5%			12.4%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	61,360	81.00	4,970,160.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	218,998	67.70	14,826,164.60	
	FORMOSA PLASTIC	246,424	78.50	19,344,284.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	342,726	60.50	20,734,923.00	
	ASIA CEMENT	126,980	41.70	5,295,066.00	
	TAIWAN CEMENT	334,294	42.20	14,107,206.80	
	CHINA STEEL	754,544	20.00	15,090,880.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	148,454	26.90	3,993,412.60	

AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	8,000	673.00	5,384,000.00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	13,640	323.50	4,412,540.00	
EVA AIRWAYS CORP	180,918	11.50	2,080,557.00	
EVERGREEN MARINE	202,375	18.80	3,804,650.00	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	143,000	32.35	4,626,050.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	142,036	36.10	5,127,499.60	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	332.50	3,325,000.00	
GIANT MANUFACTURING	18,752	302.00	5,663,104.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,443	370.50	4,239,631.50	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	26,815	168.00	4,504,920.00	
FORMOSA TAFFETA CO.	65,000	30.80	2,002,000.00	
POU CHEN CORP	135,468	27.25	3,691,503.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	18,000	605.00	10,890,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	37,816	263.00	9,945,608.00	
STANDARD FOODS CORP	27,079	63.00	1,705,977.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	320,836	63.60	20,405,169.60	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	355,459	17.80	6,327,170.20	
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,131,212	18.80	21,266,785.60	
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	710,897	26.65	18,945,405.05	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	636,320	20.70	13,171,824.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	516,720	17.80	9,197,616.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	723,380	28.65	20,724,837.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	550,549	10.80	5,945,929.20	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	680,155	13.00	8,842,015.00	
TAIWAN BUSINESS BANK	336,646	9.87	3,322,696.02	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	588,451	19.75	11,621,907.25	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	220,574	41.50	9,153,821.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	75,973	129.00	9,800,517.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	644,152	18.20	11,723,566.40	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	497,035	39.45	19,608,030.75	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	838,789	8.58	7,196,809.62	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	176,754	20.15	3,561,593.10	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	425,541	42.45	18,064,215.45	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	708,228	8.38	5,934,950.64	

ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION	32,000	230.00	7,360,000.00
ACER INC	160,767	23.70	3,810,177.90
ADVANTECH CO.,LTD.	23,750	299.50	7,113,125.00
ASUSTEK COMPUTER INC	45,805	248.50	11,382,542.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	40,840	194.50	7,943,380.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	48,645	86.00	4,183,470.00
COMPAL ELECTRONICS	244,590	19.20	4,696,128.00
INVENTEC CO.,LTD	136,911	22.80	3,121,570.80
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	145,897	45.95	6,703,967.15
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	52,000	144.50	7,514,000.00
PEGATRON CORP	121,692	63.60	7,739,611.20
QUANTA COMPUTER INC	175,684	76.80	13,492,531.20
WISTRON CORP	212,457	31.75	6,745,509.75
WIWYNN CORP	5,000	759.00	3,795,000.00
AU OPTRONICS CORP	489,008	12.40	6,063,699.20
DELTA ELECTRONICS INC	123,681	186.00	23,004,666.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,834	52.50	2,878,785.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	803,649	76.90	61,800,608.10
INNOLUX CORP	505,322	10.45	5,280,614.90
LARGAN PRECISION CO LTD	6,040	3,655.00	22,076,200.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	77,566	43.15	3,346,972.90
WALSIN TECHNOLOGY CORP	18,000	159.00	2,862,000.00
WPG HOLDINGS CO LTD	120,387	40.40	4,863,634.80
YAGEO CORPORATION	23,377	340.00	7,948,180.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	36,410	128.00	4,660,480.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	220,658	59.50	13,129,151.00
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,525.00	3,050,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	13,000	397.50	5,167,500.00
MEDIATEK INC	95,538	603.00	57,609,414.00
NANYA TECHNOLOGY CO	61,000	52.80	3,220,800.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	34,058	243.00	8,276,094.00
PHISON ELECTRONICS CORP	9,306	277.00	2,577,762.00
POWERTECH TECHNOLOGY INC	46,147	86.60	3,996,330.20
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	28,417	381.50	10,841,085.50
SILERGY CORP	5,000	1,800.00	9,000,000.00

	TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,568,000	429.00	672,672,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	704,500	21.45	15,111,525.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	69,000	93.80	6,472,200.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	21,000	292.00	6,132,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	12.95	3,133,900.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	242,065	108.50	26,264,052.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	105,000	60.80	6,384,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	102,200	101.00	10,322,200.00	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	39,110	45.80	1,791,238.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	46,509	41.50	1,930,123.50	
小計	銘柄数：87			1,502,048,226.08	
				(5,437,414,578)	
	組入時価比率：12.1%			13.1%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	44,705	403.35	18,031,761.75	
	COAL INDIA LTD	76,900	132.45	10,185,405.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	34,380	197.10	6,776,298.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	113,000	83.90	9,480,700.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	157,000	77.90	12,230,300.00	
	PETRONET LNG LTD	34,980	235.15	8,225,547.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	182,600	2,077.25	379,305,850.00	
	ASIAN PAINTS LTD	19,300	1,956.35	37,757,555.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	19,000	551.75	10,483,250.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	6,620	1,436.15	9,507,313.00	
	UPL LTD	32,100	508.45	16,321,245.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	29,920	208.50	6,238,320.00	
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	17,700	706.50	12,505,050.00	
	SHREE CEMENT LIMITED	470	20,025.30	9,411,891.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	6,180	3,916.10	24,201,498.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	71,770	188.30	13,514,291.00	
	JSW STEEL LTD	53,000	282.35	14,964,550.00	
	TATA STEEL LIMITED	18,606	421.30	7,838,707.80	
	VEDANTA LTD	126,000	125.95	15,869,700.00	
	LARSEN&TOUBRO LIMITED	31,100	942.50	29,311,750.00	
	HAVELLS INDIA LTD	17,700	633.90	11,220,030.00	
	SIEMENS LIMITED	3,100	1,219.00	3,778,900.00	

INTERGLOBE AVIATION LTD	5,010	1,257.15	6,298,321.50
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,380	391.70	4,849,246.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,600	353.00	15,037,800.00
BHARAT FORGE LIMITED	12,700	488.65	6,205,855.00
BOSCH LTD	390	12,856.35	5,013,976.50
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	57,438	112.65	6,470,390.70
BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	2,883.20	16,117,088.00
EICHER MOTORS LTD	8,200	2,180.85	17,882,970.00
HERO MOTOCORP LTD	6,210	2,915.20	18,103,392.00
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	50,800	632.00	32,105,600.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	7,060	7,190.10	50,762,106.00
TATA MOTORS LTD	104,000	147.80	15,371,200.00
PAGE INDUSTRIES LTD	340	18,503.55	6,291,207.00
TITAN CO LTD	21,000	1,159.25	24,344,250.00
JUBILANT FOODWORKS LIMITED	4,700	2,246.40	10,558,080.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	7,800	2,251.45	17,561,310.00
UNITED SPIRITS LTD	22,600	568.25	12,842,450.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	4,530	3,705.85	16,787,500.50
NESTLE INDIA LIMITED	1,550	16,232.60	25,160,530.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	27,900	569.05	15,876,495.00
ITC LTD	221,100	186.70	41,279,370.00
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	53,400	2,124.65	113,456,310.00
COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)	2,900	1,362.05	3,949,945.00
DABUR INDIA LTD	37,800	483.80	18,287,640.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,200	655.75	17,836,400.00
MARICO LIMITED	26,340	373.85	9,847,209.00
BIOCON LTD	18,600	420.95	7,829,670.00
AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	807.55	15,101,185.00
CIPLA LIMITED	20,980	724.60	15,202,108.00
DR.REDDYS LABORATORIES	7,130	4,322.50	30,819,425.00
LUPIN LTD	14,900	945.00	14,080,500.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,927	1,292.40	10,244,854.80
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	47,000	512.45	24,085,150.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,270	2,769.20	9,055,284.00
AXIS BANK LIMITED	149,500	455.20	68,052,400.00

	BANDHAN BANK LTD	28,900	314.45	9,087,605.00	
	ICICI BANK LTD	311,200	372.55	115,937,560.00	
	REC LTD	39,810	109.95	4,377,109.50	
	BAJAJ FINSERV LTD	2,320	6,277.20	14,563,104.00	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	45,500	574.65	26,146,575.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY	10,200	1,290.20	13,160,040.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	17,100	420.90	7,197,390.00	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	25,800	834.55	21,531,390.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	69,600	700.80	48,775,680.00	
	INFOSYS LTD	219,700	919.15	201,937,255.00	
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	58,400	2,288.80	133,665,920.00	
	TECH MAHINDRA LTD	28,300	748.20	21,174,060.00	
	WIPRO LTD	80,400	276.00	22,190,400.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	16,510	214.85	3,547,173.50	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	79,900	523.15	41,799,685.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	127,000	175.05	22,231,350.00	
	GAIL INDIA LTD	94,600	98.05	9,275,530.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	13,500	400.80	5,410,800.00	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	105,800	1,769.70	187,234,260.00	
	LIC HOUSING FINANCE	18,050	295.35	5,331,067.50	
	BAJAJ FINANCE LTD	11,130	3,596.80	40,032,384.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	5,800	687.45	3,987,210.00	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,990	2,416.80	4,809,432.00	
	NTPC LIMITED	142,008	94.70	13,448,157.60	
	DIVIS LABORATORIES LTD	5,900	3,223.15	19,016,585.00	
	DLF LIMITED	26,000	154.85	4,026,100.00	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	70,000	220.40	15,428,000.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	4,860	3,337.90	16,222,194.00	
	小計 銘柄数：85			2,421,471,148.65	
				(3,535,347,877)	
	組入時価比率：7.9%			8.5%	
パキスタンルピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	51,000	113.25	5,775,750.00	
	HABIB BANK LTD	35,600	133.32	4,746,192.00	

	MCB BANK LIMITED	34,000	172.61	5,868,740.00	
小計	銘柄数：3			16,390,682.00	
				(10,490,036)	
	組入時価比率：0.0%			0.0%	
カタールリヤル	QATAR FUEL CO	34,700	17.71	614,537.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING	305,000	2.11	646,295.00	
	INDUSTRIES QATAR	111,700	9.87	1,103,260.90	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	117,900	3.96	467,473.50	
	MASRAF AL RAYAN	237,000	4.11	976,203.00	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	47,000	8.40	394,847.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	64,300	15.89	1,021,727.00	
	QATAR NATIONAL BANK	294,700	17.84	5,257,448.00	
	OOREDOO QSC	43,100	6.47	278,900.10	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	34,400	17.00	584,800.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	113,000	3.40	384,313.00	
小計	銘柄数：11			11,729,804.50	
				(339,695,138)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
エジプトポンド	ELSWEDY ELECTRIC CO	41,500	7.27	301,705.00	
	EASTERN TOBACCO	51,525	12.20	628,605.00	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	91,300	66.30	6,053,190.00	
小計	銘柄数：3			6,983,500.00	
				(46,998,955)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	15,000	131.36	1,970,400.00	
	SASOL LTD	36,200	143.00	5,176,600.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,110	1,234.39	5,073,342.90	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	26,400	463.04	12,224,256.00	
	GOLD FIELDS LTD	59,600	201.15	11,988,540.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	40,800	96.90	3,953,520.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	45,200	159.29	7,199,908.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,900	523.63	2,042,157.00	
	NORTHAM PLATINUM LTD	17,900	162.15	2,902,485.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	161,000	53.20	8,565,200.00	
	BIDVEST GROUP LTD	17,200	133.83	2,301,876.00	
	NASPERS LTD-N SHS	27,940	2,933.42	81,959,754.80	

	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	61,610	30.60	1,885,266.00	
	MR PRICE GROUP LTD	16,700	117.29	1,958,743.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	38,000	9.80	372,400.00	
	BID CORP LTD	22,800	268.61	6,124,308.00	
	CLICKS GROUP LTD	18,300	228.49	4,181,367.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	29,200	116.46	3,400,632.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	15,300	162.54	2,486,862.00	
	TIGER BRANDS LTD	12,800	169.26	2,166,528.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	102,000	16.60	1,693,200.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	21,630	133.94	2,897,122.20	
	ABSA GROUP LTD	42,300	80.40	3,400,920.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,342	870.00	3,777,540.00	
	NEDBANK GROUP LTD	21,300	90.80	1,934,040.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	75,600	100.78	7,618,968.00	
	FIRSTRAND LTD	296,352	36.14	10,710,161.28	
	REMGRO LTD	33,200	85.00	2,822,000.00	
	DISCOVERY LTD	25,800	121.23	3,127,734.00	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS	56,462	15.03	848,623.86	
	OLD MUTUAL LTD	294,000	10.80	3,175,200.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	40,350	29.93	1,207,675.50	
	SANLAM LIMITED	119,300	52.00	6,203,600.00	
	MTN GROUP LTD	109,700	57.80	6,340,660.00	
	VODACOM GROUP	39,800	124.52	4,955,896.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	8,790	315.40	2,772,366.00	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	25,200	74.80	1,884,960.00	
	MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	94.49	2,519,103.40	
	小計 銘柄数：38			235,823,915.94	
				(1,511,631,301)	
				組入時価比率：3.4%	3.6%
UAE デル ム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	173,870	5.51	958,023.70	
	DUBAI ISLAMIC BANK	102,029	4.25	433,623.25	
	EMIRATES NBD PJSC	161,000	10.70	1,722,700.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	173,200	11.46	1,984,872.00	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	118,200	16.60	1,962,120.00	

	ALDAR PROPERTIES PJSC	277,000	2.05	567,850.00	
	EMAAR MALLS PJSC	211,000	1.40	295,400.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	172,000	2.93	503,960.00	
小計	銘柄数：8			8,428,548.95 (244,427,919)	
	組入時価比率：0.5%			0.6%	
サウジアラビア リヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	9,600	14.22	136,512.00	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	142,800	35.85	5,119,380.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,020	56.90	513,238.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	10,000	11.96	119,600.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	29,300	15.78	462,354.00	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	11,900	83.00	987,700.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	58,600	88.10	5,162,660.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	18,700	22.30	417,010.00	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	47,000	9.30	437,100.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	14,300	55.20	789,360.00	
	SAUDI CEMENT	6,400	57.00	364,800.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	28,200	40.00	1,128,000.00	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	1,200	82.90	99,480.00	
	JARIR MARKETING CO	3,730	166.80	622,164.00	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,700	126.80	469,160.00	
	ALMARAI CO	18,000	53.70	966,600.00	
	SAVOLA	16,600	48.30	801,780.00	
	AL RAJHI BANK	80,100	66.00	5,286,600.00	
	ALINMA BANK	61,066	15.54	948,965.64	
	ARAB NATIONAL BANK	32,800	20.42	669,776.00	
	BANK AL - JAZIRA	34,100	13.00	443,300.00	
	BANK ALBILAD	23,300	24.10	561,530.00	
	BANQUE SAUDI FRANSI	37,400	32.00	1,196,800.00	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	88,100	36.95	3,255,295.00	
	RIYAD BANK	80,300	18.60	1,493,580.00	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	65,800	27.35	1,799,630.00	
	SAUDI BRITISH BANK	41,600	25.85	1,075,360.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	3,900	124.00	483,600.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,700	80.60	217,620.00	

		SAUDI TELECOM CO	39,400	97.50	3,841,500.00	
		ETIHAD ETISALAT CO	23,900	27.10	647,690.00	
		SAUDI ELECTRICITY CO	58,200	16.48	959,136.00	
		DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	23,000	8.45	194,350.00	
		EMAAR ECONOMIC CITY	12,000	10.10	121,200.00	
	小計	銘柄数：34			41,792,830.64	
					(1,186,916,390)	
		組入時価比率：2.6%			2.9%	
	合計				41,588,925,308	
					(41,588,925,308)	

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券(2020年9月7日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	バーツ	SRISAWAD CORP PCL-CW25(NVDR)	1,280.00	0.00	
	小計	銘柄数：1	1,280.00	0.00	(0)
		組入時価比率：0.0%		0.0%	
	合計			0	(0)
投資信託受益証券	米ドル	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	500,300	17,675,599.00	
	小計	銘柄数：1	500,300	17,675,599.00	(1,879,976,709)
		組入時価比率：4.2%		98.3%	
	合計			1,879,976,709	(1,879,976,709)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	208,100	3,423,245.00	
	小計	銘柄数：1	208,100	3,423,245.00	(16,910,830)
		組入時価比率：0.0%		0.9%	
	ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	191,000	2,356,940.00	
小計	銘柄数：1	191,000	2,356,940.00		

			(15,107,985)	
		組入時価比率：0.0%	0.8%	
	合計		32,018,815	
			(32,018,815)	
	合計		1,911,995,524	
			(1,911,995,524)	

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 9月 7日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	1,423,532,876	-	1,427,869,173	4,336,297
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	121,933,959	-	122,302,500	368,541
米ドル	121,933,959	-	122,302,500	368,541
売建	42,470,400	-	42,540,000	69,600
米ドル	42,470,400	-	42,540,000	69,600
合計	-	-	-	4,635,238

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年 9月 7日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,857,650,686
国債証券	546,249,675,190
地方債証券	49,366,579,560
特殊債券	59,780,167,191
社債券	30,325,814,550
未収利息	1,837,019,088
前払費用	56,061,786
流動資産合計	696,472,968,051
資産合計	696,472,968,051
負債の部	
流動負債	
未払解約金	406,401,538
未払利息	12,628
流動負債合計	406,414,166
負債合計	406,414,166
純資産の部	
元本等	
元本	524,917,125,574
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	171,149,428,311
元本等合計	696,066,553,885
純資産合計	696,066,553,885
負債純資産合計	696,472,968,051

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 9月 7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	1.3261円
(10,000口当たり純資産額)	(13,261円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7日	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月 7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
2. 時価の算定方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 9月 7日現在	
期首	2019年 9月 7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	485,418,655,642円
同期中における追加設定元本額	119,779,371,640円
同期中における一部解約元本額	80,280,901,708円
期末元本額	524,917,125,574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	445,941,995円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	40,045,922,632円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	17,435,914,349円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	2,851,536,385円
野村資産設計ファンド2015	350,010,194円
野村資産設計ファンド2020	350,096,748円
野村資産設計ファンド2025	316,903,731円
野村資産設計ファンド2030	240,773,202円
野村資産設計ファンド2035	120,291,002円
野村資産設計ファンド2040	175,571,800円
野村日本債券インデックスファンド	895,992,845円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	153,888,056,847円
のむラップ・ファンド（保守型）	12,737,743,342円
のむラップ・ファンド（普通型）	9,099,253,541円
のむラップ・ファンド（積極型）	1,250,005,450円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）	10,824,619,479円
野村資産設計ファンド2045	16,943,618円
野村円債投資インデックスファンド	1,024,546,170円
野村インデックスファンド・国内債券	3,373,655,565円
マイ・ロード	34,301,286,700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	1,277,909,531円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）	15,638,215,622円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,810,946,081円
野村資産設計ファンド2050	21,648,753円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	21,000,797円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	5,788,878円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	3,432,993円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,877,102円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	832,460,994円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	241,138,653円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	55,206,753円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	29,524,847円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	74,822,270円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	13,431,987円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	12,558,430円
野村6資産均等バランス	1,875,249,462円

世界6資産分散ファンド	132,823,222円
野村資産設計ファンド2060	5,860,296円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合運動型上場投信	2,062,393,334円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	14,433,028,355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)	614,399,821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)	133,841,998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)	2,010,014,985円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	1,413,415,962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)	19,959,719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)	10,475,755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)	444,709円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,543,072,011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)	11,415,105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)	88,658,024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)	77,088,187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)	340,972,844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)	328,352,390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)	825,045,278円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	189,504,979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)	288,507,292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)	3,249,081,271円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	6,828,846円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	34,466,000,883円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	43,151,271,998円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	15,560,542,909円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合(確定拠出年金向け)	49,960,542,430円
マイバランスDC30	11,603,169,050円
マイバランスDC50	8,952,597,215円
マイバランスDC70	2,836,658,341円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合	12,695,187,476円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	733,866,933円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,714,511,804円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	757,995,138円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	117,756,507円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	18,797,114円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	18,265,337円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	28,385,576円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	9,894,778円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	4,605,594円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	458,559,104円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	230,053,398円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	70,435,068円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	80,969,006円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	1,596,784円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年9月7日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2020年9月7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406回	3,800,000,000	3,810,906,000	
		国庫債券 利付(2年)第413回	500,000,000	502,250,000	
		国庫債券 利付(5年)第130回	7,500,000,000	7,523,100,000	
		国庫債券 利付(5年)第131回	5,300,000,000	5,319,451,000	
		国庫債券 利付(5年)第132回	3,000,000,000	3,012,570,000	
		国庫債券 利付(5年)第133回	6,200,000,000	6,229,016,000	
		国庫債券 利付(5年)第134回	3,000,000,000	3,015,420,000	
		国庫債券 利付(5年)第135回	3,500,000,000	3,519,950,000	
		国庫債券 利付(5年)第136回	3,300,000,000	3,320,691,000	
		国庫債券 利付(5年)第137回	4,000,000,000	4,027,360,000	
		国庫債券 利付(5年)第138回	4,900,000,000	4,935,476,000	
		国庫債券 利付(5年)第139回	4,400,000,000	4,434,276,000	
		国庫債券 利付(5年)第140回	3,400,000,000	3,428,390,000	
		国庫債券 利付(5年)第141回	4,500,000,000	4,540,095,000	
		国庫債券 利付(5年)第143回	4,970,000,000	5,015,177,300	
		国庫債券 利付(5年)第144回	4,500,000,000	4,539,960,000	
		国庫債券 利付(40年)第1回	2,360,000,000	3,457,588,800	
		国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,280,394,000	
		国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,287,036,000	
		国庫債券 利付(40年)第4回	1,130,000,000	1,625,866,600	
		国庫債券 利付(40年)第5回	1,200,000,000	1,672,020,000	
		国庫債券 利付(40年)第6回	1,300,000,000	1,786,707,000	
		国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,853,138,000	
		国庫債券 利付(40年)第8回	1,500,000,000	1,859,175,000	
		国庫債券 利付(40年)第9回	2,050,000,000	1,902,072,000	
		国庫債券 利付(40年)第10回	2,010,000,000	2,187,382,500	
		国庫債券 利付(40年)第11回	1,750,000,000	1,848,700,000	
		国庫債券 利付(40年)第12回	2,070,000,000	1,977,367,500	
		国庫債券 利付(40年)第13回	1,900,000,000	1,813,208,000	
		国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,879,452,000	

国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,551,240,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,255,872,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,438,232,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	1,700,000,000	1,731,552,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	3,200,000,000	3,253,696,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	4,400,000,000	4,483,380,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,139,648,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,100,000,000	3,165,627,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,250,000,000	5,346,547,500	
国庫債券 利付(10年)第329回	6,000,000,000	6,153,960,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	3,906,400,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,941,629,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	5,400,000,000	5,528,088,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	3,600,000,000	3,691,836,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	6,600,000,000	6,780,444,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	4,600,000,000	4,715,552,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	1,450,000,000	1,488,048,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	3,700,000,000	3,765,268,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	5,000,000,000	5,113,700,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	5,000,000,000	5,117,600,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	3,800,000,000	3,894,126,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	5,300,000,000	5,408,226,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	2,750,000,000	2,778,242,500	
国庫債券 利付(10年)第343回	5,900,000,000	5,963,366,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	5,800,000,000	5,865,018,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	5,000,000,000	5,056,800,000	
	4,900,000,000	4,957,869,000	

国庫債券 利付(10年)第346回			
国庫債券 利付(10年)第347回	5,400,000,000	5,464,368,000	
国庫債券 利付(10年)第348回	4,600,000,000	4,655,246,000	
国庫債券 利付(10年)第349回	5,300,000,000	5,363,971,000	
国庫債券 利付(10年)第350回	5,850,000,000	5,918,503,500	
国庫債券 利付(10年)第351回	5,600,000,000	5,663,392,000	
国庫債券 利付(10年)第352回	6,600,000,000	6,671,742,000	
国庫債券 利付(10年)第353回	5,100,000,000	5,152,887,000	
国庫債券 利付(10年)第354回	4,350,000,000	4,392,717,000	
国庫債券 利付(10年)第355回	5,100,000,000	5,147,022,000	
国庫債券 利付(10年)第356回	4,800,000,000	4,838,976,000	
国庫債券 利付(10年)第357回	1,900,000,000	1,914,079,000	
国庫債券 利付(10年)第358回	5,470,000,000	5,506,375,500	
国庫債券 利付(10年)第359回	4,900,000,000	4,928,616,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	500,000,000	625,330,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	500,000,000	611,975,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	195,017,600	
国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,158,534,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	183,625,500	
国庫債券 利付(30年)第6回	600,000,000	752,010,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	749,994,000	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	119,705,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	265,000,000	304,397,550	
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	278,350,000	
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	190,382,400	
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	273,614,000	
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	357,770,100	
国庫債券 利付(30年)第14回	800,000,000	1,031,832,000	
国庫債券 利付(30年)第15回	900,000,000	1,176,030,000	
国庫債券 利付(30年)第16回	915,000,000	1,198,979,400	
国庫債券 利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,560,072,000	
国庫債券 利付(30年)第18回	1,500,000,000	1,933,800,000	
国庫債券 利付(30年)第19回	2,050,000,000	2,649,010,000	
国庫債券 利付(30年)第20回	1,270,000,000	1,681,568,900	

国庫債券	利付(30年)第21回	1,400,000,000	1,817,102,000
国庫債券	利付(30年)第22回	600,000,000	798,816,000
国庫債券	利付(30年)第23回	840,000,000	1,120,980,000
国庫債券	利付(30年)第24回	700,000,000	937,006,000
国庫債券	利付(30年)第25回	500,000,000	654,730,000
国庫債券	利付(30年)第26回	850,000,000	1,129,318,500
国庫債券	利付(30年)第27回	1,550,000,000	2,095,786,000
国庫債券	利付(30年)第28回	1,200,000,000	1,630,128,000
国庫債券	利付(30年)第29回	1,500,000,000	2,021,580,000
国庫債券	利付(30年)第30回	1,700,000,000	2,272,866,000
国庫債券	利付(30年)第31回	1,200,000,000	1,591,872,000
国庫債券	利付(30年)第32回	1,200,000,000	1,621,800,000
国庫債券	利付(30年)第33回	2,400,000,000	3,120,864,000
国庫債券	利付(30年)第34回	2,100,000,000	2,822,442,000
国庫債券	利付(30年)第35回	2,300,000,000	3,011,022,000
国庫債券	利付(30年)第36回	2,300,000,000	3,020,452,000
国庫債券	利付(30年)第37回	2,300,000,000	2,983,445,000
国庫債券	利付(30年)第38回	1,600,000,000	2,048,112,000
国庫債券	利付(30年)第39回	1,600,000,000	2,085,824,000
国庫債券	利付(30年)第40回	1,300,000,000	1,669,746,000
国庫債券	利付(30年)第41回	1,500,000,000	1,897,140,000
国庫債券	利付(30年)第42回	1,600,000,000	2,025,520,000
国庫債券	利付(30年)第43回	1,300,000,000	1,647,308,000
国庫債券	利付(30年)第44回	1,400,000,000	1,775,676,000
国庫債券	利付(30年)第45回	1,700,000,000	2,081,616,000
国庫債券	利付(30年)第46回	1,800,000,000	2,205,324,000
国庫債券	利付(30年)第47回	1,700,000,000	2,124,014,000
国庫債券	利付(30年)第48回	1,900,000,000	2,285,529,000
国庫債券	利付(30年)第49回	1,900,000,000	2,286,365,000
国庫債券	利付(30年)第50回	1,600,000,000	1,699,040,000
国庫債券	利付(30年)第51回	2,650,000,000	2,494,763,000
国庫債券	利付(30年)第52回	1,900,000,000	1,878,359,000
国庫債券	利付(30年)第53回	1,700,000,000	1,719,516,000
国庫債券	利付(30年)第54回	1,700,000,000	1,802,561,000
国庫債券	利付(30年)第55回	1,500,000,000	1,589,385,000
国庫債券	利付(30年)第56回	1,900,000,000	2,011,777,000
国庫債券	利付(30年)第57回	1,600,000,000	1,692,880,000
国庫債券	利付(30年)第58回	2,100,000,000	2,222,850,000
国庫債券	利付(30年)第59回	1,600,000,000	1,651,856,000
国庫債券	利付(30年)第60回	1,150,000,000	1,244,725,500
国庫債券	利付(30年)第61回	1,000,000,000	1,029,150,000
国庫債券	利付(30年)第62回	500,000,000	488,415,000
国庫債券	利付(30年)第63回	1,400,000,000	1,328,012,000

国庫債券	利付(30年)第64回	1,500,000,000	1,420,545,000
国庫債券	利付(30年)第65回	1,200,000,000	1,134,564,000
国庫債券	利付(30年)第66回	3,000,000,000	2,831,730,000
国庫債券	利付(30年)第67回	1,300,000,000	1,293,461,000
国庫債券	利付(20年)第53回	250,000,000	257,192,500
国庫債券	利付(20年)第54回	100,000,000	103,005,000
国庫債券	利付(20年)第55回	231,000,000	238,586,040
国庫債券	利付(20年)第56回	120,000,000	124,573,200
国庫債券	利付(20年)第57回	210,000,000	217,627,200
国庫債券	利付(20年)第58回	180,000,000	187,446,600
国庫債券	利付(20年)第59回	230,000,000	239,604,800
国庫債券	利付(20年)第60回	780,000,000	807,222,000
国庫債券	利付(20年)第61回	300,000,000	308,559,000
国庫債券	利付(20年)第62回	440,000,000	451,290,400
国庫債券	利付(20年)第63回	300,000,000	316,071,000
国庫債券	利付(20年)第64回	400,000,000	424,592,000
国庫債券	利付(20年)第65回	455,000,000	485,202,900
国庫債券	利付(20年)第66回	300,000,000	318,927,000
国庫債券	利付(20年)第67回	310,000,000	332,130,900
国庫債券	利付(20年)第68回	290,000,000	313,785,800
国庫債券	利付(20年)第69回	560,000,000	603,948,800
国庫債券	利付(20年)第70回	540,000,000	591,570,000
国庫債券	利付(20年)第71回	200,000,000	217,580,000
国庫債券	利付(20年)第72回	1,470,000,000	1,601,917,800
国庫債券	利付(20年)第73回	1,600,000,000	1,745,248,000
国庫債券	利付(20年)第74回	900,000,000	985,572,000
国庫債券	利付(20年)第75回	600,000,000	660,048,000
国庫債券	利付(20年)第76回	910,000,000	992,791,800
国庫債券	利付(20年)第77回	700,000,000	766,871,000
国庫債券	利付(20年)第78回	800,000,000	876,224,000
国庫債券	利付(20年)第79回	860,000,000	946,068,800
国庫債券	利付(20年)第80回	1,400,000,000	1,546,832,000
国庫債券	利付(20年)第81回	360,000,000	397,936,800
国庫債券	利付(20年)第82回	820,000,000	910,560,800
国庫債券	利付(20年)第83回	1,370,000,000	1,528,426,800
国庫債券	利付(20年)第84回	1,200,000,000	1,332,396,000
国庫債券	利付(20年)第85回	400,000,000	448,424,000
国庫債券	利付(20年)第86回	1,400,000,000	1,585,024,000
国庫債券	利付(20年)第87回	500,000,000	563,305,000
国庫債券	利付(20年)第88回	1,100,000,000	1,252,042,000
国庫債券	利付(20年)第89回	470,000,000	532,232,700
国庫債券	利付(20年)第90回	1,500,000,000	1,707,315,000

国庫債券 利付(20年)第91回	250,000,000	286,067,500
国庫債券 利付(20年)第92回	650,000,000	739,232,000
国庫債券 利付(20年)第93回	300,000,000	340,839,000
国庫債券 利付(20年)第94回	200,000,000	228,538,000
国庫債券 利付(20年)第95回	100,000,000	116,147,000
国庫債券 利付(20年)第96回	400,000,000	459,136,000
国庫債券 利付(20年)第97回	300,000,000	348,006,000
国庫債券 利付(20年)第98回	300,000,000	345,888,000
国庫債券 利付(20年)第99回	2,100,000,000	2,431,758,000
国庫債券 利付(20年)第100回	1,520,000,000	1,778,445,600
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	296,287,500
国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	595,220,000
国庫債券 利付(20年)第103回	600,000,000	709,578,000
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	466,808,000
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,225,869,000
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	471,824,000
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	352,908,000
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,855,616,000
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,047,177,000
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,298,671,000
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	954,960,000
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,132,838,000
国庫債券 利付(20年)第113回	2,000,000,000	2,377,220,000
国庫債券 利付(20年)第114回	1,700,000,000	2,027,607,000
国庫債券 利付(20年)第115回	1,000,000,000	1,201,970,000
国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,326,798,000
国庫債券 利付(20年)第117回	1,400,000,000	1,675,352,000
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	595,475,000
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	937,176,000
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	921,584,000

国庫債券 利付(20年)第121回	1,200,000,000	1,420,908,000
国庫債券 利付(20年)第122回	900,000,000	1,056,699,000
国庫債券 利付(20年)第123回	1,500,000,000	1,810,845,000
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,197,020,000
国庫債券 利付(20年)第125回	900,000,000	1,099,206,000
国庫債券 利付(20年)第126回	1,000,000,000	1,200,460,000
国庫債券 利付(20年)第127回	1,200,000,000	1,428,024,000
国庫債券 利付(20年)第128回	1,800,000,000	2,147,850,000
国庫債券 利付(20年)第129回	1,400,000,000	1,655,612,000
国庫債券 利付(20年)第130回	1,400,000,000	1,658,804,000
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	939,160,000
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,529,489,000
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,662,738,000
国庫債券 利付(20年)第134回	1,400,000,000	1,666,504,000
国庫債券 利付(20年)第135回	700,000,000	825,293,000
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	817,341,000
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,180,790,000
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	926,088,000
国庫債券 利付(20年)第139回	1,000,000,000	1,169,200,000
国庫債券 利付(20年)第140回	2,300,000,000	2,721,360,000
国庫債券 利付(20年)第141回	2,600,000,000	3,082,300,000
国庫債券 利付(20年)第142回	950,000,000	1,137,663,000
国庫債券 利付(20年)第143回	1,300,000,000	1,528,046,000
国庫債券 利付(20年)第144回	1,300,000,000	1,512,095,000
国庫債券 利付(20年)第145回	2,300,000,000	2,736,747,000
国庫債券 利付(20年)第146回	2,400,000,000	2,860,896,000
	4,200,000,000	4,960,746,000

国庫債券 利付(20年)第147回			
国庫債券 利付(20年)第148回	2,100,000,000	2,456,349,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	3,850,000,000	4,509,120,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	3,330,000,000	3,859,636,500	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,500,000,000	2,829,450,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	2,650,000,000	3,000,833,500	
国庫債券 利付(20年)第153回	1,600,000,000	1,835,536,000	
国庫債券 利付(20年)第154回	1,220,000,000	1,381,906,200	
国庫債券 利付(20年)第155回	3,600,000,000	3,974,004,000	
国庫債券 利付(20年)第156回	2,650,000,000	2,685,324,500	
国庫債券 利付(20年)第157回	3,190,000,000	3,130,123,700	
国庫債券 利付(20年)第158回	2,100,000,000	2,155,986,000	
国庫債券 利付(20年)第159回	2,000,000,000	2,081,820,000	
国庫債券 利付(20年)第160回	2,300,000,000	2,429,559,000	
国庫債券 利付(20年)第161回	2,100,000,000	2,183,202,000	
国庫債券 利付(20年)第162回	1,700,000,000	1,765,467,000	
国庫債券 利付(20年)第163回	2,750,000,000	2,852,740,000	
国庫債券 利付(20年)第164回	2,600,000,000	2,651,272,000	
国庫債券 利付(20年)第165回	2,200,000,000	2,240,238,000	
国庫債券 利付(20年)第166回	2,300,000,000	2,420,106,000	
国庫債券 利付(20年)第167回	2,600,000,000	2,644,278,000	
国庫債券 利付(20年)第168回	2,700,000,000	2,695,329,000	
国庫債券 利付(20年)第169回	2,530,000,000	2,479,298,800	
国庫債券 利付(20年)第170回	2,000,000,000	1,957,700,000	
国庫債券 利付(20年)第171回	1,300,000,000	1,271,036,000	
国庫債券 利付(20年)第172回	3,840,000,000	3,822,681,600	
	3,400,000,000	3,381,402,000	

小計	国庫債券 利付（20年）第173回			
	メキシコ合衆国 第25回円貨社債（2018）	100,000,000	98,217,000	
	銘柄数：259 組入時価比率：78.5%	504,466,000,000	546,249,675,190 79.7%	
合計			546,249,675,190	
地方債証券	日本円	東京都 公募第703回	100,000,000	101,246,000
		東京都 公募第707回	100,000,000	101,296,000
		東京都 公募第708回	100,000,000	101,551,000
		東京都 公募第710回	100,000,000	101,408,000
		東京都 公募第712回	100,000,000	101,526,000
		東京都 公募第715回	100,000,000	101,690,000
		東京都 公募第716回	200,000,000	203,424,000
		東京都 公募第731回	100,000,000	102,168,000
		東京都 公募第736回	100,000,000	101,955,000
		東京都 公募第745回	300,000,000	307,353,000
		東京都 公募第760回	100,000,000	99,879,000
		東京都 公募第761回	100,000,000	100,059,000
		東京都 公募第769回	500,000,000	504,550,000
		東京都 公募第778回	100,000,000	100,599,000
		東京都 公募（30年）第7回	100,000,000	135,036,000
		東京都 公募第10回	200,000,000	266,478,000
		東京都 公募第1回	300,000,000	312,678,000
		東京都 公募（20年）第3回	200,000,000	215,798,000
		東京都 公募第7回	100,000,000	110,759,000
		東京都 公募（20年）第13回	100,000,000	115,036,000
		東京都 公募（20年）第16回	200,000,000	231,298,000
		東京都 公募（20年）第17回	200,000,000	232,612,000
		東京都 公募第23回	100,000,000	119,643,000
		東京都 公募（20年）第26回	100,000,000	117,248,000
		北海道 公募平成24年度第6回	100,000,000	101,583,000
		北海道 公募平成24年度第9回	100,000,000	101,609,000
		北海道 公募平成25年度第1回	300,000,000	304,257,000
		北海道 公募平成26年度第13回	100,000,000	101,807,000
		北海道 公募平成27年度第7回	100,000,000	102,426,000
		北海道 公募平成28年度第13回	200,000,000	199,942,000
		北海道 公募平成29年度第5回	200,000,000	201,150,000
		北海道 公募平成29年度第6回	700,000,000	699,601,000
		北海道 公募平成29年度第7回	100,000,000	100,832,000
北海道 公募平成29年度第9回	100,000,000	100,779,000		
宮城県 公募第32回2号	100,000,000	100,241,000		
神奈川県 公募第188回	200,000,000	203,142,000		

神奈川県 公募第196回	100,000,000	101,664,000	
神奈川県 公募第200回	100,000,000	102,442,000	
神奈川県 公募第205回	100,000,000	102,271,000	
神奈川県 公募第206回	100,000,000	102,397,000	
神奈川県 公募第210回	200,000,000	203,690,000	
神奈川県 公募第231回	200,000,000	202,100,000	
神奈川県 公募(30年)第3回	100,000,000	134,742,000	
神奈川県 公募第7回	300,000,000	342,036,000	
神奈川県 公募(20年)第14回	100,000,000	117,795,000	
神奈川県 公募(20年)第17回	200,000,000	237,792,000	
神奈川県 公募(20年)第26回	100,000,000	115,277,000	
大阪府 公募第356回	100,000,000	101,336,000	
大阪府 公募第378回	104,000,000	106,226,640	
大阪府 公募第381回	100,000,000	102,248,000	
大阪府 公募第382回	100,000,000	102,267,000	
大阪府 公募第383回	100,000,000	102,394,000	
大阪府 公募第384回	100,000,000	102,361,000	
大阪府 公募第387回	300,000,000	305,784,000	
大阪府 公募第389回	100,000,000	102,048,000	
大阪府 公募第396回	200,000,000	204,892,000	
大阪府 公募第417回	102,000,000	103,102,620	
大阪府 公募第423回	100,000,000	100,728,000	
大阪府 公募第429回	179,000,000	180,369,350	
大阪府 公募第452回	100,000,000	99,046,000	
大阪府 公募第5回	100,000,000	119,318,000	
大阪府 公募第8回	100,000,000	117,740,000	
大阪府 公募(5年)第137回	1,024,000,000	1,023,426,560	
大阪府 公募(5年)第141回	230,000,000	229,843,600	
京都府 公募平成24年度第2回	100,000,000	101,587,000	
京都府 公募平成24年度第6回	100,000,000	101,653,000	
京都府 公募平成25年度第15回	200,000,000	204,512,000	
京都府 公募平成26年度第5回	100,000,000	115,047,000	
京都府 公募平成26年度第7回	200,000,000	204,384,000	
京都府 公募(20年)平成27年度第5回	200,000,000	224,518,000	
京都府 公募(15年)平成27年度第8回	100,000,000	106,047,000	
京都府 公募(20年)平成28年度第5回	100,000,000	98,534,000	
京都府 公募平成29年度第4回	100,000,000	100,776,000	
兵庫県 公募平成26年度第17回	100,000,000	101,897,000	
兵庫県 公募平成29年度第22回	100,000,000	100,719,000	
兵庫県 公募(30年)第2回	200,000,000	269,344,000	
兵庫県 公募(15年)第1回	300,000,000	327,888,000	

兵庫県	公募(15年)第3回	200,000,000	217,244,000
兵庫県	公募(12年)第3回	300,000,000	307,242,000
兵庫県	公募(15年)第11回	100,000,000	105,415,000
兵庫県	公募第2回	100,000,000	115,964,000
兵庫県	公募第9回	100,000,000	119,114,000
兵庫県	公募(20年)第11回	200,000,000	232,988,000
兵庫県	公募(20年)第14回	100,000,000	116,854,000
兵庫県	公募(20年)第22回	100,000,000	114,235,000
静岡県	公募平成24年度第5回	100,060,000	101,606,927
静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	101,668,000
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	103,631,050
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	169,039,200
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	102,201,000
静岡県	公募平成26年度第9回	200,000,000	204,404,000
静岡県	公募平成27年度第11回	115,400,000	115,685,038
静岡県	公募平成28年度第2回	300,000,000	300,246,000
静岡県	公募平成29年度第3回	100,000,000	100,649,000
静岡県	公募(31年)第1回	174,000,000	173,631,120
静岡県	公募(15年)第5回	200,000,000	215,946,000
静岡県	公募(15年)第9回	100,000,000	105,662,000
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	116,666,000
静岡県	公募(20年)第14回	200,000,000	234,404,000
静岡県	公募(20年)第18回	100,000,000	115,279,000
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	115,896,000
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	101,455,000
愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	101,573,000
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	116,613,000
愛知県	公募平成24年度第8回	150,000,000	152,413,500
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	435,816,000
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	118,877,000
愛知県	公募(30年)平成25年度第8回	120,000,000	155,660,400
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	125,640,000
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	113,919,000
愛知県	公募(15年)平成27年度第2回	100,000,000	105,703,000
愛知県	公募平成27年度第15回	100,000,000	102,119,000
愛知県	公募平成29年度第8回	100,000,000	100,833,000
愛知県	公募平成29年度第9回	100,000,000	100,523,000
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	101,756,000
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	204,754,000
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	111,140,143

広島県	公募平成29年度第3回	100,000,000	100,526,000	
広島県	公募平成29年度第4回	211,300,000	213,497,520	
埼玉県	公募平成24年度第4回	300,000,000	304,620,000	
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	102,588,000	
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	151,550,520	
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	102,254,000	
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	102,251,000	
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	102,402,000	
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	204,324,000	
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	407,832,000	
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	101,826,000	
埼玉県	公募平成27年度第9回	100,000,000	100,926,000	
埼玉県	公募平成28年度第5回	100,000,000	99,911,000	
埼玉県	公募平成30年度第4回	200,000,000	201,624,000	
埼玉県	公募平成30年度第7回	200,000,000	200,000,000	
埼玉県	公募(15年)第1回	100,000,000	107,258,000	
埼玉県	公募(15年)第3回	100,000,000	102,217,000	
埼玉県	公募(20年)第6回	100,000,000	117,277,000	
埼玉県	公募(20年)第16回	100,000,000	112,054,000	
埼玉県	公募(20年)第20回	100,000,000	102,889,000	
福岡県	公募平成23年度第5回	100,000,000	101,131,000	
福岡県	公募平成26年度第1回	100,000,000	102,407,000	
福岡県	公募平成27年度第1回	300,000,000	308,025,000	
福岡県	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,844,000	
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	108,804,000	
福岡県	公募(15年)令和元年度第1回	100,000,000	98,867,000	
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	135,514,000	
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	125,912,000	
福岡県	公募(30年・定時償還)平成29年度第2回	100,000,000	106,542,000	
福岡県	公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	115,978,000	
福岡県	公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	116,186,000	
千葉県	公募平成24年度第1回	100,000,000	101,678,000	
千葉県	公募平成24年度第2回	100,000,000	101,523,000	
千葉県	公募平成24年度第7回	100,000,000	101,648,000	
千葉県	公募平成24年度第8回	100,000,000	101,953,000	
千葉県	公募平成25年度第3回	100,000,000	102,424,000	
千葉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	102,588,000	
千葉県	公募平成26年度第3回	200,000,000	204,580,000	
千葉県	公募平成28年度第4回	200,000,000	200,240,000	

千葉県 公募平成29年度第4回	100,000,000	100,525,000	
千葉県 公募平成29年度第8回	100,000,000	100,861,000	
千葉県 公募(20年)第1回	400,000,000	442,012,000	
千葉県 公募(20年)第8回	100,000,000	119,468,000	
千葉県 公募(20年)第16回	200,000,000	232,500,000	
千葉県 公募(20年)第17回	100,000,000	114,447,000	
群馬県 公募第8回	100,000,000	101,228,000	
群馬県 公募第12回	100,000,000	102,461,000	
群馬県 公募(20年)第3回	100,000,000	116,666,000	
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	190,717,005	
大分県 公募平成23年度第1回	902,000,000	912,084,360	
共同発行市場地方債 公募第103回	100,000,000	101,108,000	
共同発行市場地方債 公募第104回	200,000,000	202,456,000	
共同発行市場地方債 公募第108回	200,000,000	203,058,000	
共同発行市場地方債 公募第110回	200,000,000	202,978,000	
共同発行市場地方債 公募第111回	200,000,000	203,120,000	
共同発行市場地方債 公募第112回	100,000,000	101,540,000	
共同発行市場地方債 公募第113回	800,000,000	811,776,000	
共同発行市場地方債 公募第114回	243,700,000	247,677,184	
共同発行市場地方債 公募第115回	100,000,000	101,661,000	
共同発行市場地方債 公募第116回	200,000,000	203,456,000	
共同発行市場地方債 公募第118回	100,000,000	101,953,000	
共同発行市場地方債 公募第119回	200,000,000	203,844,000	
共同発行市場地方債 公募第120回	300,000,000	305,028,000	
共同発行市場地方債 公募第121回	100,000,000	101,444,000	
共同発行市場地方債 公募第122回	400,000,000	406,496,000	
共同発行市場地方債 公募第124回	300,000,000	307,677,000	
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	102,407,000	
共同発行市場地方債 公募第128回	700,000,000	714,385,000	
共同発行市場地方債 公募第129回	100,000,000	102,274,000	
	100,000,000	102,502,000	

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	102,267,000	
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	204,580,000	
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	204,318,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	158,352,650	
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	550,314,000	
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,017,850,000	
共同発行市場地方債 公募第156回	200,000,000	200,386,000	
共同発行市場地方債 公募第157回	300,000,000	300,252,000	
共同発行市場地方債 公募第161回	300,000,000	299,910,000	
共同発行市場地方債 公募第172回	600,000,000	605,946,000	
共同発行市場地方債 公募第184回	100,000,000	100,586,000	
共同発行市場地方債 公募第186回	400,000,000	404,636,000	
共同発行市場地方債 公募第190回	610,000,000	612,275,300	
共同発行市場地方債 公募第191回	100,000,000	100,167,000	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	117,864,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	122,871,000	
島根県 公募平成28年度第3回	100,000,000	99,976,000	
佐賀県 公募平成28年度第1回	100,000,000	100,061,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	204,010,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	102,032,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	144,847,100	
栃木県 公募平成24年度第1回	100,000,000	101,716,000	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	102,032,000	
熊本市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,827,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	238,584,588	
新潟市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,977,000	
奈良県 公募平成28年度第1回	100,000,000	99,976,000	
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,377,000	
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	102,161,000	
大阪市 公募平成26年度第5回	100,000,000	102,321,000	
大阪市 公募(5年)平成28年度第5回	100,000,000	99,976,000	
大阪市 公募(15年)第1回	100,000,000	109,851,000	

大阪市 公募(20年)第1回	300,000,000	347,859,000
大阪市 公募(20年)第5回	100,000,000	118,953,000
大阪市 公募(20年)第6回	100,000,000	117,292,000
大阪市 公募(20年)第17回	100,000,000	117,540,000
名古屋市 公募第478回	100,000,000	101,591,000
名古屋市 公募第481回	100,000,000	101,653,000
名古屋市 公募第488回	300,000,000	306,990,000
名古屋市 公募第489回	100,000,000	101,888,000
名古屋市 公募第501回	100,000,000	100,702,000
名古屋市 公募第503回	100,000,000	100,899,000
名古屋市 公募第504回	200,000,000	201,698,000
名古屋市 公募(12年)第1回	200,000,000	209,682,000
名古屋市 公募(15年)第2回	100,000,000	106,943,000
京都市 公募平成23年度第4回	100,000,000	101,351,000
京都市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,900,000
京都市 公募平成29年度第4回	101,280,000	102,417,374
京都市 公募(20年)第2回	100,000,000	110,558,000
京都市 公募(20年)第5回	200,000,000	228,638,000
京都市 公募(20年)第6回	100,000,000	116,115,000
京都市 公募(20年)第13回	100,000,000	113,814,000
神戸市 公募平成26年度第17回	300,000,000	303,420,000
神戸市 公募平成28年度第1回	200,000,000	200,166,000
横浜市 公募公債平成24年度2回	200,000,000	203,352,000
横浜市 公募公債平成25年度1回	200,000,000	203,466,000
横浜市 公募公債平成25年度5回	200,000,000	204,054,000
横浜市 公募公債平成26年度5回	200,000,000	203,844,000
横浜市 公募平成28年度第5回	300,000,000	303,081,000
横浜市 公募平成29年度第3回	100,000,000	100,965,000
横浜市 公募(30年)第2回	200,000,000	259,920,000
横浜市 公募(20年)第18回	100,000,000	118,017,000
横浜市 公募(20年)第26回	100,000,000	118,269,000
横浜市 公募(20年)第30回	100,000,000	114,103,000
札幌市 公募(15年)平成23年度第9回	200,000,000	218,228,000
札幌市 公募(20年)平成24年度第1回	100,000,000	117,726,000
札幌市 公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	118,531,000
札幌市 公募平成26年度第4回	100,000,000	101,966,000
札幌市 公募平成26年度第9回	200,000,000	203,510,000
川崎市 公募第85回	100,000,000	101,598,000
川崎市 公募(20年)第17回	100,000,000	115,324,000
川崎市 公募(20年)第19回	100,000,000	113,831,000
川崎市 公募(30年)第11回	100,000,000	103,522,000

		北九州市 公募（20年）第3回	200,000,000	231,338,000	
		北九州市 公募（20年）第14回	100,000,000	117,309,000	
		福岡市 公募（20年）平成21年度第3回	200,000,000	235,886,000	
		福岡市 公募（20年）平成23年度第4回	100,000,000	118,167,000	
		福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	115,525,000	
		福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	102,146,000	
		福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	163,232,000	
		広島市 公募平成26年度第2回	100,000,000	101,872,000	
		広島市 公募平成27年度第2回	500,000,000	510,535,000	
		広島市 公募（10年）平成30年度第6回	241,000,000	241,522,970	
		千葉市 公募平成24年度第1回	100,000,000	101,678,000	
		三重県 公募平成24年度第1回	140,660,000	143,000,582	
		三重県 公募平成28年度第1回	155,000,000	155,922,250	
		鹿児島県 公募（5年）平成28年度第1回	100,000,000	99,977,000	
		福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	101,156,000	
		福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	200,224,000	
		山梨県 公募平成24年度第1回	200,000,000	203,336,000	
		岡山県 公募平成28年度第2回	168,900,000	170,388,009	
		愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第96回	100,000,000	116,635,000	
		愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回	300,000,000	354,474,000	
		福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	115,940,000	
		福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	104,792,000	
	小計	銘柄数：282 組入時価比率：7.1%	47,012,820,000	49,366,579,560	7.2%
	合計			49,366,579,560	
特殊債券	日本円	フランス預金供託公庫 第4回円貨債券（2014）	100,000,000	102,179,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	153,509,620	
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	195,851,400	
		新関西国際空港債券 政府保証第5回	117,000,000	117,957,060	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	107,648,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第22回	200,000,000	200,000,000	
		日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	106,188,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000	304,581,000	

日本政策投資銀行社債 財投機関債 第47回	100,000,000	107,675,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第78回	200,000,000	201,440,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第82回	100,000,000	101,052,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第86回	300,000,000	302,001,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第96回	200,000,000	200,774,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 16回	102,000,000	103,752,360	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 19回	159,000,000	161,774,550	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 38回	1,500,000,000	1,500,945,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 42回	300,000,000	302,610,000	
道路債券 財投機関債第17回	300,000,000	310,344,000	
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	131,649,000	
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	225,970,000	
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	113,522,000	
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	346,497,000	
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	309,248,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第39回	200,000,000	235,264,000	
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	119,275,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第80回	100,000,000	101,375,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第84回	400,000,000	406,104,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第86回	200,000,000	202,820,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第89回	100,000,000	116,448,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第100回	200,000,000	203,442,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第102回	100,000,000	101,608,000	
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	408,450,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第105回	100,000,000	118,739,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第107回	100,000,000	102,514,000	
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	408,268,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第122回	100,000,000	102,339,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第123回	100,000,000	102,290,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第130回	200,000,000	203,928,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第134回	200,000,000	203,694,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第136回	200,000,000	204,374,000	
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	356,055,000	
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	120,564,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第157回	100,000,000	106,458,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第164回	100,000,000	110,467,000	
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	93,417,000	
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	102,187,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	200,000,000	236,696,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回	200,000,000	237,110,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回	200,000,000	239,342,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回	200,000,000	238,214,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	200,000,000	235,048,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	100,000,000	129,867,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第149回	140,000,000	141,790,600	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回	100,000,000	101,316,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回	140,000,000	141,943,200	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第163回	1,000,000,000	1,016,270,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回	100,000,000	125,334,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回	100,000,000	101,662,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回	100,000,000	116,451,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	218,000,000	221,631,880	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	100,000,000	115,702,000	
	300,000,000	382,041,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第173回	200,000,000	203,482,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回	200,000,000	203,506,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第180回	200,000,000	203,502,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	900,000,000	918,558,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回	100,000,000	117,963,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回	196,000,000	198,924,320	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回	400,000,000	406,868,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回	1,000,000,000	1,025,480,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回	272,000,000	278,974,080	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	300,000,000	306,873,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第211回	137,000,000	140,142,780	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	145,000,000	148,324,850	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第216回	100,000,000	115,731,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第217回	100,000,000	124,283,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第219回	100,000,000	115,765,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	100,000,000	102,450,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第224回	100,000,000	124,393,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回	190,000,000	194,200,900	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第229回	630,000,000	644,080,500	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回	100,000,000	101,983,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第239回	500,000,000	558,505,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第261回	401,000,000	408,578,900	
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	150,998,490	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第297回	100,000,000	100,409,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第306回	403,000,000	406,300,570	
	100,000,000	100,748,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 1 5 回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 2 1 回	600,000,000	605,646,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 2 4 回	100,000,000	100,387,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 3 5 回	100,000,000	104,659,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 3 9 回	500,000,000	505,630,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 4 2 回	131,000,000	131,936,650	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 5 1 回	100,000,000	100,660,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 5 4 回	200,000,000	201,100,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 5 7 回	100,000,000	101,143,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第1 3 回	130,000,000	135,950,100	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第2 8 回	400,000,000	528,312,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第3 3 回	100,000,000	133,935,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第3 8 回	1,000,000,000	1,089,440,000	
公営企業債券 3 0 年第4 回財投機関債	100,000,000	134,233,000	
地方公営企業等金融機構債券(2 0 年) 第1 回	100,000,000	115,809,000	
地方公共団体金融機構債券 2 0 年第4 回	100,000,000	117,923,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 6 回	100,000,000	112,260,000	
地方公共団体金融機構債券 2 0 年第6 回	300,000,000	358,446,000	
地方公共団体金融機構債券 F 2 4 回	100,000,000	104,189,000	
地方公共団体金融機構債券(2 0 年) 第1 0 回	300,000,000	346,197,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 0 4 回	100,000,000	105,765,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 0 6 回	100,000,000	104,369,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 2 2 回	100,000,000	108,724,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 2 4 回	100,000,000	108,715,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第3 7 回	604,000,000	614,026,400	
地方公共団体金融機構債券 第3 7 回	400,000,000	406,080,000	
	194,000,000	197,160,260	

政保 地方公共団体金融機構債券 第38回			
地方公共団体金融機構債券 F13 2回	500,000,000	525,895,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	100,000,000	101,630,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第40回	101,000,000	102,726,090	
政保 地方公共団体金融機構債券 第41回	102,000,000	103,758,480	
地方公共団体金融機構債券 第41 回	600,000,000	610,020,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 2回	100,000,000	104,160,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 5回	200,000,000	209,308,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 7回	100,000,000	107,621,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第42回	108,000,000	109,960,200	
地方公共団体金融機構債券 第42 回	100,000,000	101,736,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第43回	202,000,000	205,486,520	
政保 地方公共団体金融機構債券 第44回	145,000,000	147,952,200	
地方公共団体金融機構債券 第44 回	100,000,000	101,841,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第45回	223,000,000	227,584,880	
地方公共団体金融機構債券 F16 0回	100,000,000	106,963,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第48回	500,000,000	508,460,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第49回	13,000,000	13,326,690	
地方公共団体金融機構債券（20 年）第29回	100,000,000	117,504,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第50回	100,000,000	102,666,000	
地方公共団体金融機構債券 第51 回	600,000,000	614,628,000	
地方公共団体金融機構債券 第52 回	300,000,000	307,260,000	
地方公共団体金融機構債券（15 年）第2回	200,000,000	216,770,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第56回	591,000,000	605,863,650	
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回	116,000,000	118,788,640	
地方公共団体金融機構債券（20 年）第38回	100,000,000	115,055,000	
	300,000,000	325,005,000	

地方公共団体金融機構債券 F 2 4 0 回			
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	102,184,000	
地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	102,203,000	
地方公共団体金融機構債券(20 年) 第 3 9 回	100,000,000	114,316,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 5 回	400,000,000	408,852,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 9 回	320,000,000	325,817,600	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 2 回	189,000,000	193,481,190	
地方公共団体金融機構債券 第 7 4 回	300,000,000	307,158,000	
地方公共団体金融機構債券 第 7 7 回	100,000,000	102,145,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 8 回	509,000,000	518,584,470	
地方公共団体金融機構債券 第 7 9 回	400,000,000	408,636,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (8年) 第 5 回	500,000,000	502,935,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 8 3 回	116,000,000	115,998,840	
地方公共団体金融機構債券 第 9 5 回	200,000,000	201,118,000	
地方公共団体金融機構債券 第 1 0 1 回	400,000,000	402,828,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 0 8 回	157,000,000	158,081,730	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 0 回	100,000,000	100,547,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 3 回	110,000,000	111,423,400	
公営企業債券(20年) 第 2 回財 投機関債	100,000,000	103,266,000	
公営企業債券(20年) 第 5 回財 投機関債	200,000,000	212,680,000	
公営企業債券(20年) 第 1 9 回 財投機関債	100,000,000	114,203,000	
公営企業債券(20年) 第 2 0 回 財投機関債	100,000,000	113,865,000	
公営企業債券(20年) 第 2 4 回 財投機関債	100,000,000	116,236,000	
公営企業債券(20年) 第 2 5 回 財投機関債	100,000,000	118,222,000	
都市再生債券 財投機関債第 9 6 回	200,000,000	204,504,000	
都市再生債券 財投機関債第 9 7 回	100,000,000	107,586,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 0 1 回	100,000,000	106,884,000	
	100,000,000	107,045,000	

都市再生債券 財投機関債第109回			
都市再生債券 財投機関債第113回	300,000,000	319,671,000	
都市再生債券 財投機関債第127回	100,000,000	99,879,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	110,441,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第16回	360,000,000	367,844,400	
東京交通債券 第342回	200,000,000	208,462,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	167,790,610	
関西国際空港社債 財投機関債第38回	100,000,000	101,402,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機関債	100,000,000	101,641,000	
中部国際空港債券 政府保証第18回	368,000,000	374,473,120	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	200,000,000	227,802,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第6回	200,000,000	231,548,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	100,000,000	106,397,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	100,000,000	108,589,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第49回	100,000,000	118,549,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	100,000,000	117,535,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	100,000,000	119,473,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回	300,000,000	328,659,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	100,000,000	119,439,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第85回	200,000,000	234,774,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回	200,000,000	218,728,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第120回	100,000,000	118,257,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第123回	100,000,000	117,689,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回	100,000,000	133,738,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第132回	200,000,000	214,180,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第137回	100,000,000	109,011,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第143回	100,000,000	108,373,000	
	250,000,000	255,380,000	

住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回			
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第198回	300,000,000	301,122,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第223回	100,000,000	101,147,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第244回	130,000,000	131,316,900	
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	203,686,000	
成田国際空港 第17回	400,000,000	407,440,000	
商工債券 利付第806回い号	300,000,000	300,252,000	
商工債券 利付第811回い号	300,000,000	300,723,000	
商工債券 利付第815回い号	100,000,000	100,261,000	
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	100,286,000	
商工債券 利付第819回い号	300,000,000	300,972,000	
商工債券 利付第829回い号	200,000,000	200,226,000	
商工債券 利付第831回い号	200,000,000	199,840,000	
商工債券 利付第833回い号	100,000,000	99,794,000	
しんきん中金債券 利付第327回	200,000,000	200,132,000	
しんきん中金債券 利付第335回	200,000,000	200,298,000	
商工債券 利付(3年)第231回	200,000,000	200,080,000	
商工債券 利付(3年)第236回	500,000,000	499,535,000	
商工債券 利付(10年)第15回	200,000,000	203,296,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関債	200,000,000	238,290,000	
東日本高速道路 第61回	200,000,000	198,678,000	
中日本高速道路 第63回	100,000,000	102,386,000	
西日本高速道路 第20回	200,000,000	204,298,000	
西日本高速道路 第22回	400,000,000	409,776,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	102,084,000	
西日本高速道路 第30回	300,000,000	300,933,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第62回	100,000,000	102,211,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第68回	200,000,000	204,262,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第69回	100,000,000	114,312,000	
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	510,220,000	
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	30,459,000	30,665,207	
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	56,765,000	57,543,815	
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	34,662,000	35,222,484	
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	38,133,000	39,553,454	
	12,002,000	12,305,530	

貸付債権担保第 7 回 S 種住宅金融公庫債券			
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融公庫債券	25,800,000	26,563,680	
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融公庫債券	29,630,000	30,932,831	
貸付債権担保第 1 5 回住宅金融公庫債券	33,084,000	33,480,346	
貸付債権担保第 3 2 回住宅金融公庫債券	54,276,000	55,826,665	
貸付債権担保第 2 0 回住宅金融公庫債券	56,860,000	57,860,736	
貸付債権担保第 4 4 回住宅金融公庫債券	51,224,000	52,990,203	
貸付債権担保第 8 回住宅金融支援機構債券	84,750,000	87,712,012	
貸付債権担保第 7 回住宅金融支援機構債券	14,214,000	14,791,372	
貸付債権担保第 2 5 回住宅金融支援機構債券	22,373,000	24,081,626	
貸付債権担保第 2 8 回住宅金融支援機構債券	71,643,000	76,537,649	
貸付債権担保 S 種第 1 6 回住宅金融支援機構債券	13,881,000	14,093,101	
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融支援機構債券	76,234,000	80,441,354	
貸付債権担保 S 種第 1 7 回住宅金融支援機構債券	27,846,000	28,303,509	
貸付債権担保第 4 5 回住宅金融支援機構債券	91,200,000	96,997,584	
貸付債権担保第 5 2 回住宅金融支援機構債券	69,228,000	73,156,689	
貸付債権担保第 2 4 回住宅金融支援機構債券	39,852,000	42,617,330	
貸付債権担保第 4 8 回住宅金融支援機構債券	86,676,000	92,257,067	
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融支援機構債券	94,023,000	98,381,906	
貸付債権担保第 6 2 回住宅金融支援機構債券	132,855,000	139,278,539	
貸付債権担保第 6 0 回住宅金融支援機構債券	128,634,000	135,551,936	
貸付債権担保第 6 1 回住宅金融支援機構債券	82,766,000	86,907,610	
貸付債権担保第 5 1 回住宅金融支援機構債券	32,039,000	33,923,533	
貸付債権担保第 4 3 回住宅金融支援機構債券	74,278,000	78,902,548	
貸付債権担保第 7 9 回住宅金融支援機構債券	42,930,000	44,719,751	
貸付債権担保第 8 1 回住宅金融支援機構債券	92,342,000	96,309,935	
	41,806,000	43,562,688	

貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	24,106,000	24,602,583	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	125,364,000	131,582,054	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	26,974,000	28,829,811	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	29,349,000	31,428,963	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	27,749,000	29,509,951	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	30,895,000	32,941,484	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	84,388,000	89,253,812	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	119,967,000	126,679,153	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	40,151,000	42,425,152	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	81,066,000	84,893,125	
貸付債権担保5種第3回住宅金融公庫債券	11,088,000	11,246,447	
貸付債権担保5種第14回住宅金融支援機構債券	56,725,000	57,148,735	
貸付債権担保5種第15回住宅金融支援機構債券	23,298,000	23,473,666	
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	77,792,000	82,733,347	
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	78,762,000	83,908,309	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	151,475,000	159,348,670	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	85,696,000	90,542,108	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	139,779,000	146,330,441	
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	122,334,000	127,361,927	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	94,296,000	99,436,074	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	81,008,000	85,030,857	
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	196,332,000	204,528,861	
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	338,611,000	352,307,814	
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	51,301,000	53,180,668	
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	53,905,000	55,951,772	
	55,272,000	57,136,324	

貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	115,010,000	118,124,470	
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	120,664,000	123,000,055	
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	64,505,000	66,460,146	
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	67,872,000	69,720,154	
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	202,134,000	208,660,906	
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	208,485,000	216,063,429	
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	139,488,000	144,400,767	
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	68,467,000	70,759,275	
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	69,079,000	71,576,896	
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	251,532,000	253,275,116	
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	168,730,000	170,761,509	
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券	169,526,000	171,311,108	
貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券	84,836,000	85,792,101	
貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券	170,112,000	171,904,980	
貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券	85,837,000	86,409,532	
貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券	86,149,000	86,883,850	
貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券	87,530,000	88,436,810	
貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券	350,348,000	352,989,623	
貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券	264,426,000	266,565,206	
貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券	176,796,000	178,100,754	
貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券	179,094,000	180,872,403	
貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券	183,134,000	184,024,031	
貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券	91,647,000	92,084,156	
貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券	92,047,000	92,877,263	
貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券	93,102,000	93,515,372	
	283,407,000	283,336,148	

		貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券	284,166,000	284,225,674	
		貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券	485,255,000	480,315,104	
		貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券	195,856,000	195,846,207	
		貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券	197,404,000	196,851,268	
	小計	銘柄数：310	56,905,786,000	59,780,167,191	
		組入時価比率：8.6%		8.7%	
	合計			59,780,167,191	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行(BFCM)第14回円貨社債	200,000,000	199,864,000	
		フランス相互信用連合銀行(BFCM)第29回円貨社債	200,000,000	196,524,000	
		フランス相互信用連合銀行(BFCM)第31回円貨社債	100,000,000	95,712,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー第14回円貨社債	100,000,000	99,217,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー第1回非上位円貨社債	200,000,000	200,602,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー第6回円貨社債(2014)	100,000,000	101,657,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー第15回円貨社債(2018)	100,000,000	99,688,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー第16回円貨社債(2018)	100,000,000	99,026,000	
		スタンダード・チャータード第3回円貨社債(2015)	100,000,000	100,287,000	
		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	100,609,000	
		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	100,674,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー第1回円貨社債	100,000,000	100,116,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー第6回円貨社債	100,000,000	98,832,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー第7回円貨社債	100,000,000	95,679,000	
		サントナデル銀行第1回円貨社債	100,000,000	98,800,000	
		フランス電力第4回円貨社債(2017)	100,000,000	102,518,000	
		現代キャピタル・サービス・インク第15回円貨社債	200,000,000	195,162,000	
		ビー・エヌ・ピー・パリバ第1回円貨社債(2017)	100,000,000	99,788,000	
		ウエストバック・バンキング・コーポレーション第12回円貨社	200,000,000	200,418,000	

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	199,354,000	
ソシエテ・ジェネラル 第1回非上 位円貨社債(2017)	100,000,000	99,611,000	
長谷工コーポレーション 第13回 社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,922,000	
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	199,812,000	
大和ハウス工業 第9回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	97,550,000	
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	199,788,000	
明治ホールディングス 第8回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	99,779,000	
アサヒグループホールディングス 第8回特定社債間限定同順位特	100,000,000	100,299,000	
味の素 第24回特定社債間限定同 順位特約付	200,000,000	199,652,000	
日本たばこ産業 第13回	100,000,000	100,076,000	
三越伊勢丹ホールディングス 第6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,634,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	101,437,000	
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	196,170,000	
森ビル 第23回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	98,926,000	
東急不動産ホールディングス 第2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,087,000	
東レ 第30回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	99,302,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	99,015,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	199,458,000	
王子ホールディングス 第34回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	100,114,000	
住友化学 第56回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,666,000	
三井化学 第48回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,517,000	
三菱ケミカルホールディングス 第 29回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,372,000	
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	99,470,000	
電通 第1回社債間限定同順位特約 付	100,000,000	99,558,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約 付	100,000,000	99,958,000	
電通 第4回社債間限定同順位特約 付	300,000,000	299,883,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	99,842,000	

第一三共 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,796,000	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,707,000	
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,724,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,206,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,196,000	
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,619,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,812,000	
日本特殊陶業 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,677,000	
新日鐵住金 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,758,000	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	300,000,000	296,874,000	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,691,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順位	100,000,000	98,346,000	
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	300,000,000	299,811,000	
DOWAホールディングス 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,530,000	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,814,000	
LIXILグループ 第11回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,679,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	216,660,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,557,000	
日本電産 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,415,000	
日本電気 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,752,000	
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,310,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,782,000	
ソニー 第32回	200,000,000	200,090,000	
東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,384,000	
三菱重工業 第35回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,188,000	
J A三井リース 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,024,000	
J A三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,988,000	

三井住友トラスト・パナソニック ファイナンス 第2回社債間限定	100,000,000	100,057,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定 同等特約付	100,000,000	102,230,000	
アイシン精機 第15回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	101,209,000	
楽天カード 第3回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	98,832,000	
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	100,130,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,655,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	103,643,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順 位特約付	200,000,000	207,286,000	
三井物産 第71回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	107,314,000	
住友商事 第45回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	101,546,000	
住友商事 第49回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	107,289,000	
住友商事 第53回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,940,000	
丸井グループ 第28回社債間限定 同順位特約付	200,000,000	200,760,000	
クレディセゾン 第50回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	102,011,000	
クレディセゾン 第65回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	99,273,000	
クレディセゾン 第81回社債間限 定同順位特約付	200,000,000	199,730,000	
イオン 第20回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	101,373,000	
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	101,441,000	
りそなホールディングス 第20回 社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,697,000	
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	201,852,000	
みずほコーポレート銀行 第8回特 定社債間限定同順位特約付	100,000,000	114,310,000	
東京三菱銀行 第57回特定社債間 限定同順位特約付	100,000,000	104,454,000	
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	303,723,000	
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	101,523,000	
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	104,154,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約 付	300,000,000	307,086,000	
	100,000,000	101,717,000	

セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付			
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,500,000	
セブン銀行 第12回社債間限定同順位特約付	300,000,000	303,237,000	
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	202,614,000	
みずほ銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	113,135,000	
みずほリース 第3回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,382,000	
NTTファイナンス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,194,000	
トヨタファイナンス 第77回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,903,000	
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	99,929,000	
リコーリース 第28回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,374,000	
アコム 第77回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,755,000	
ジャックス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,397,000	
ジャックス 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,870,000	
日立キャピタル 第61回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,613,000	
日立キャピタル 第80回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,084,000	
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	99,290,000	
三菱UFJリース 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,040,000	
三菱UFJリース 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,943,000	
三菱UFJリース 第76回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,461,000	
大和証券グループ本社 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,075,000	
三井不動産 第71回社債間限定同順位特約付	200,000,000	196,880,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	104,032,000	
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	101,551,000	
三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	99,147,000	
東京建物 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,071,000	
ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,282,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,397,000	

日本ビルファンド投資法人 第13回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	102,191,000	
野村不動産オフィスファンド投資法人 第7回特定投資法人債間限	100,000,000	115,361,000	
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	101,514,000	
東武鉄道 第102回社債間限定同順位特約付	200,000,000	210,194,000	
相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付	200,000,000	202,268,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,524,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,325,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	214,734,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,342,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,840,000	
東日本旅客鉄道 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,231,000	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	200,000,000	235,086,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	116,059,000	
東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,387,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	114,536,000	
東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,960,000	
東日本旅客鉄道 第145回社債間限定同順位特約付	200,000,000	189,950,000	
西日本旅客鉄道 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,887,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	300,000,000	344,751,000	
西日本旅客鉄道 第66回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,710,000	
東海旅客鉄道 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	217,092,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	236,886,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,514,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	120,094,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	100,268,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	101,235,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	106,107,000	
西武ホールディングス 第1回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,762,000	

西日本鉄道 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,110,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,233,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,035,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,703,000	
日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,746,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,228,000	
九州旅客鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,928,000	
九州旅客鉄道 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,506,000	
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	91,888,000	
澁澤倉庫 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,270,000	
K D D I 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,026,000	
K D D I 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,124,000	
東京電力 第548回	100,000,000	109,970,000	
東京電力 第560回	100,000,000	108,291,000	
中部電力 第500回	200,000,000	205,614,000	
中部電力 第524回	100,000,000	101,024,000	
中部電力 第530回	200,000,000	199,706,000	
関西電力 第496回	100,000,000	103,089,000	
関西電力 第509回	100,000,000	100,819,000	
関西電力 第511回	100,000,000	100,376,000	
関西電力 第514回	200,000,000	200,474,000	
関西電力 第527回	200,000,000	200,866,000	
中国電力 第377回	400,000,000	412,188,000	
中国電力 第378回	100,000,000	102,838,000	
中国電力 第400回	100,000,000	100,483,000	
中国電力 第402回	300,000,000	301,416,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	102,735,000	
北陸電力 第304回	100,000,000	102,743,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	104,690,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	102,512,000	
北陸電力 第326回	100,000,000	100,215,000	
東北電力 第475回	100,000,000	102,673,000	
東北電力 第481回	200,000,000	205,976,000	
東北電力 第484回	100,000,000	101,686,000	
東北電力 第491回	100,000,000	101,017,000	

東北電力 第521回	100,000,000	100,843,000
四国電力 第281回	200,000,000	206,240,000
九州電力 第424回	300,000,000	310,587,000
九州電力 第428回	105,000,000	108,140,550
九州電力 第449回	200,000,000	201,688,000
九州電力 第451回	100,000,000	100,953,000
九州電力 第476回	100,000,000	100,627,000
北海道電力 第321回	100,000,000	102,989,000
北海道電力 第323回	100,000,000	108,516,000
北海道電力 第338回	100,000,000	101,518,000
北海道電力 第345回	300,000,000	301,143,000
電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,686,000
電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,730,000
電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,410,000
電源開発 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,713,000
電源開発 第59回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,545,000
東京電力パワーグリッド 第2回	100,000,000	100,579,000
東京電力パワーグリッド 第6回	100,000,000	101,106,000
東京電力パワーグリッド 第11回	300,000,000	301,491,000
東京電力パワーグリッド 第14回	100,000,000	100,393,000
東京電力パワーグリッド 第28回	100,000,000	101,235,000
東京電力パワーグリッド 第35回	100,000,000	102,205,000
東京電力パワーグリッド 第38回	200,000,000	200,682,000
東京電力パワーグリッド 第40回	400,000,000	404,376,000
東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	126,082,000
東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付	100,000,000	94,139,000
大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,523,000
東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,994,000
北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,148,000
北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,448,000
広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,967,000
東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,699,000
ファーストリテイリング 第3回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,652,000
ファーストリテイリング 第4回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,158,000

		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	99,818,000	
		ソフトバンクグループ 第54回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,579,000	
	小計	銘柄数：225 組入時価比率：4.4%	29,805,000,000	30,325,814,550	4.4%
	合計			30,325,814,550	
	合計			685,722,236,491	

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年9月7日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	581,970,092
コール・ローン	215,224,938
国債証券	592,988,207,632
派生商品評価勘定	4,200
未収入金	305,478,408
未収利息	4,330,308,667
前払費用	333,456,245
その他未収収益	19,350,562
流動資産合計	598,774,000,744
資産合計	598,774,000,744
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	689,432
未払金	363,933,328
未払解約金	552,783,034
未払利息	306
その他未払費用	13,000,032
流動負債合計	930,406,132
負債合計	930,406,132
純資産の部	
元本等	
元本	240,582,717,160
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	357,260,877,452
元本等合計	597,843,594,612
純資産合計	597,843,594,612
負債純資産合計	598,774,000,744

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 9月 7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	2.4850円
(10,000口当たり純資産額)	(24,850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	165,029,232,098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	176,296,346,042円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7日	
1. 金融商品に対する取組方針	
当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月 7日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、	附属明細表に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 9月 7日現在	
期首	2019年 9月 7日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	262,423,252,183円
同期中における追加設定元本額	37,733,468,567円
同期中における一部解約元本額	59,574,003,590円
期末元本額	240,582,717,160円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	79,236,315円
バランスセレクト50	79,020,319円
バランスセレクト70	67,461,298円
野村外国債券インデックスファンド	289,774,322円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,595,762,845円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	23,483,818,157円

野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,536,189,506円
野村資産設計ファンド2015	20,429,797円
野村資産設計ファンド2020	20,436,527円
野村資産設計ファンド2025	36,807,805円
野村資産設計ファンド2030	35,949,851円
野村資産設計ファンド2035	25,146,476円
野村資産設計ファンド2040	45,877,254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)	98,175,489,384円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	5,582,154,868円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	12,103,714,991円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	2,578,702,561円
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	587,074,565円
野村資産設計ファンド2045	5,902,960円
野村インデックスファンド・外国債券	815,055,150円
マイ・ロード	8,657,901,612円
ネクストコア	273,452,949円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	163,011,675円
野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	8,163,480,563円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,039,514,993円
野村資産設計ファンド2050	7,557,738円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,665,451円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,833,778円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,300,260円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	868,016円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	521,945,884円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	392,333,457円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,935,691円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,331,792円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,431,281円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,455,415円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,588,626円
野村6資産均等バランス	1,010,282,923円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	7,123,866,484円
世界6資産分散ファンド	71,557,875円
野村資産設計ファンド2060	2,052,189円
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信	2,511,730,884円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	1,556,442,280円
野村外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	8,275,283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)	1,324,278,369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)	288,415,540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)	1,516,042,125円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	1,269,120,025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)	2,933,243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)	8,467,217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)	239,629円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,181,971,243円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	13,838,667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)	71,651,784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)	15,574,055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)	160,765,570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)	176,891,041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)	1,778,283,008円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	101,961,266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)	639,197,401円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	1,038,206,346円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	2,759,280円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,641,669円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	6,295,144円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	5,254,005円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	580,784,223円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,051,005,220円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,810,624,269円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	4,166,122,269円
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	17,041,940,223円
マイバランスDC30	1,695,568,824円
マイバランスDC50	1,202,515,393円
マイバランスDC70	760,200,781円
野村DC外国債券インデックスファンド	6,502,588,516円
野村DC運用戦略ファンド	4,328,220,542円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	429,690,381円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	159,756,261円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	242,343,489円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	117,024,514円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	10,573,477円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	25,317,171円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	9,840,566円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	4,238,172円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	2,585,403円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	1,607,848円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	61,761,709円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	41,455,902円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	18,973,302円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	21,810,858円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	559,170円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年9月7日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2020年9月7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	50,500,000.00	55,196,893.90	
		US TREASURY BOND	38,800,000.00	45,709,732.92	
		US TREASURY BOND	45,100,000.00	48,884,169.62	
		US TREASURY BOND	72,200,000.00	94,139,204.62	
		US TREASURY BOND	10,800,000.00	15,113,250.00	
		US TREASURY BOND	46,200,000.00	63,965,341.44	
		US TREASURY BOND	48,000,000.00	66,011,246.40	
		US TREASURY BOND	27,500,000.00	38,061,718.75	
		US TREASURY BOND	100,000.00	153,421.87	
		US TREASURY BOND	13,200,000.00	17,149,686.84	
		US TREASURY BOND	4,500,000.00	6,656,132.70	
		US TREASURY N/B	12,200,000.00	12,421,600.80	
		US TREASURY N/B	17,900,000.00	18,276,179.24	
		US TREASURY N/B	9,650,000.00	9,750,645.64	
		US TREASURY N/B	30,400,000.00	31,046,000.00	
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,924,046.78	
		US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,202,108.40	
		US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,663,769.25	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,021,289.00	
		US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,773,421.69	
		US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,717,750.00	
		US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,862,265.29	
		US TREASURY N/B	80,800,000.00	83,353,401.20	
		US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,397,718.75	
		US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,333,593.40	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,339,081.83	
		US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,669,967.52	
		US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,959,375.00	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,588,867.10	
		US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,996,281.25	
US TREASURY N/B	500,000.00	513,593.75			

US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,343,925.70	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,666,123.36	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	26,029,350.93	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	9,038,218.64	
US TREASURY N/B	200,000.00	205,937.50	
US TREASURY N/B	900,000.00	924,890.58	
US TREASURY N/B	33,400,000.00	34,338,069.06	
US TREASURY N/B	16,400,000.00	16,982,967.52	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,906.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,492.18	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,032,500.00	
US TREASURY N/B	900,000.00	925,593.75	
US TREASURY N/B	31,200,000.00	32,255,436.72	
US TREASURY N/B	900,000.00	929,742.12	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,559,062.50	
US TREASURY N/B	7,600,000.00	7,843,139.96	
US TREASURY N/B	15,100,000.00	15,783,037.93	
US TREASURY N/B	47,900,000.00	49,711,218.75	
US TREASURY N/B	400,000.00	417,781.24	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,664,062.00	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	15,169,171.16	
US TREASURY N/B	400,000.00	413,562.48	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,574,218.00	
US TREASURY N/B	34,800,000.00	36,268,125.00	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,564,405.56	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,432,359.16	
US TREASURY N/B	41,100,000.00	44,147,178.66	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,940,272.95	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,284,906.25	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	36,473,247.36	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	12,331,000.00	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	46,054,591.62	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,770,687.04	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,580,468.00	
US TREASURY N/B	43,000,000.00	45,912,574.90	

US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,400,953.06	
US TREASURY N/B	800,000.00	870,250.00	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,815,945.27	
US TREASURY N/B	20,900,000.00	22,648,740.62	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,887,834.61	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,077,577.84	
US TREASURY N/B	42,700,000.00	45,945,866.12	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,897,000.00	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	37,032,187.50	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,480,765.51	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	18,199,187.50	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	2,110,038.92	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	36,184,593.75	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	38,623,826.40	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	8,736,136.11	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,581,750.00	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,852,437.24	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	29,231,717.40	
US TREASURY N/B	29,200,000.00	33,130,591.56	
US TREASURY N/B	50,300,000.00	55,259,263.11	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,136,562.40	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	9,562,125.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,926,281.16	
US TREASURY N/B	21,100,000.00	22,459,960.41	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,684,374.40	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	6,007,750.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	14,252,265.30	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,196,093.00	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,595,968.75	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,023,905.40	
US TREASURY N/B	38,000,000.00	42,776,717.80	
US TREASURY N/B	11,200,000.00	12,544,874.72	
US TREASURY N/B	500,000.00	580,898.40	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,114,578.08	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,442,906.16	

US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,827,898.31	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,593,296.79	
US TREASURY N/B	18,000,000.00	17,863,592.40	
US TREASURY N/B	30,200,000.00	44,450,625.00	
US TREASURY N/B	16,850,000.00	25,446,131.97	
US TREASURY N/B	200,000.00	323,390.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	155,757.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	139,859.37	
US TREASURY N/B	100,000.00	152,820.31	
US TREASURY N/B	100,000.00	157,507.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	155,601.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	160,375.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	156,328.12	
US TREASURY N/B	200,000.00	294,953.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	154,671.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	164,328.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	157,632.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	146,226.56	
US TREASURY N/B	300,000.00	403,687.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	134,906.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	132,398.43	
US TREASURY N/B	200,000.00	255,203.12	
US TREASURY N/B	990,000.00	1,336,190.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	145,156.25	
US TREASURY N/B	8,100,000.00	11,791,195.11	
US TREASURY N/B	15,200,000.00	21,371,437.12	
US TREASURY N/B	25,000,000.00	33,904,295.00	
US TREASURY N/B	37,100,000.00	49,377,781.25	
US TREASURY N/B	39,900,000.00	48,924,254.82	
US TREASURY N/B	21,900,000.00	29,209,125.00	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	22,901,756.50	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,950,773.16	
US TREASURY N/B	51,500,000.00	63,304,763.05	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	34,697,014.92	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	40,569,843.75	

	US TREASURY N/B	14,200,000.00	18,695,187.50	
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,294,867.06	
	US TREASURY N/B	11,400,000.00	14,740,733.52	
	US TREASURY N/B	9,300,000.00	12,039,866.49	
	US TREASURY N/B	9,500,000.00	12,865,819.60	
	US TREASURY N/B	5,100,000.00	7,068,281.25	
	US TREASURY N/B	10,500,000.00	14,274,257.55	
	US TREASURY N/B	2,470,000.00	3,368,269.34	
	US TREASURY N/B	100,000.00	133,546.87	
	US TREASURY N/B	9,250,000.00	10,977,870.40	
	US TREASURY N/B	300,000.00	365,531.25	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,892,187.40	
	US TREASURY N/B	15,000,000.00	14,657,812.50	
小計	銘柄数：149	2,136,360,000.00	2,437,182,913.41	
			(259,218,774,670)	
	組入時価比率：43.4%		43.8%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	22,100,000.00	23,068,864.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,005,790.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	301,344.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,400,000.00	10,558,808.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	311,124.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,460,000.00	4,610,748.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,156,474.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	533,855.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	7,353,656.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	17,000,000.00	17,692,410.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	4,030,114.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	319,170.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,250,000.00	10,885,802.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	207,774.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	111,549.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,080,000.00	14,553,806.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,147,130.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	9,166,227.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	6,239,904.00	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	10,644,788.00
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	15,349,168.50
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,829,269.00
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	496,356.00
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	158,017.00
	銘柄数：24	114,640,000.00	141,732,148.40 (11,527,075,629)
	組入時価比率：1.9%		1.9%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	99,900,000.00	103,243,932.72
	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,400,000.00	45,879,470.16
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	315,375.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	59,382,596.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	47,733,200.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	51,300,000.00	52,718,445.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	112,300,000.00	125,070,756.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	45,300,000.00	53,748,450.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	83,500,000.00	94,949,937.50
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	11,324,000.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,300,000.00	75,796,690.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	35,800,000.00	42,500,328.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	61,200,000.00	67,166,388.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	48,134,200.00
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	87,100,000.00	95,774,289.00
小計	銘柄数：15	823,700,000.00	923,738,057.38 (4,563,266,003)
組入時価比率：0.8%		0.8%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	735,952.00
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	858,388.00
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	660,480.00
	BELGIUM KINGDOM	9,100,000.00	9,844,270.80
	BELGIUM KINGDOM	2,900,000.00	2,978,300.00
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,494,400.00
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,046,516.20
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,814,914.56
	BELGIUM KINGDOM	6,000,000.00	7,703,287.20
	BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,593,440.62

BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,170,174.00
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,092,648.00
BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	7,190,836.90
BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,686,893.85
BELGIUM KINGDOM	1,900,000.00	2,809,298.77
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	116,690.00
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	605,719.15
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	129,510.00
BELGIUM KINGDOM	3,400,000.00	6,057,661.00
BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	7,143,000.00
BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,691,770.80
BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	5,325,984.00
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,875,097.32
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,624,547.30
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	16,695,895.50
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	18,927,687.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,700,000.00	10,765,751.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	20,650,000.00	22,485,929.55
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,350,000.00	4,412,074.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,059,100.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	17,223,996.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,292,727.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	6,106,008.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,600,000.00	17,186,039.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,900,000.00	7,955,010.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	507,759.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	977,931.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	18,733,925.23
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,611,745.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,477,517.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	30,389,430.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,417,750.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,201,002.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,516,500.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	13,086,030.00

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,321,256.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	6,620,400.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,168,639.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	2,616,862.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,700,000.00	9,845,224.11	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,400,000.00	17,774,121.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	4,544,119.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,800,000.00	12,184,074.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	5,094,048.00	
BUNDES OblIGATION	100,000.00	100,739.00	
BUNDES OblIGATION	3,700,000.00	3,741,144.00	
BUNDES OblIGATION	750,000.00	761,175.00	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,019,250.00	
BUNDES OblIGATION	2,000,000.00	2,060,300.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	411,628.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,400,000.00	7,735,072.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	731,220.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	411,625.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,200,000.00	9,758,440.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,580,000.00	2,790,141.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	23,900,000.00	29,533,230.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,848,240.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,800,000.00	11,703,960.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000.00	8,662,545.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,849,715.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,886,695.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,800,000.00	22,192,560.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,042,100.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	742,735.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	30,323,230.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	216,420.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,200,000.00	26,784,940.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	651,720.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	10,451,410.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,200,000.00	31,745,280.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,200,000.00	11,795,760.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,600,000.00	14,879,156.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,200,000.00	22,714,348.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,800,000.00	7,103,628.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	10,467,272.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,430,000.00	2,526,017.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	9,513,183.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,200,000.00	18,840,640.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	12,250,000.00	16,771,475.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	800,000.00	808,456.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,500,000.00	17,303,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,900,000.00	6,063,725.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,050,000.00	10,115,325.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,600,000.00	2,677,844.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,600,000.00	21,095,676.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,200,000.00	6,324,992.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,946,930.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	407,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,200,000.00	9,104,460.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,193,837.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	31,400,000.00	35,108,340.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,902,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	102,390.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,229,943.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	568,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	23,924,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,700,000.00	16,894,710.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	318,060.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,590,540.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,929,830.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,090,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	20,243,462.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	838,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,150,081.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,723,800.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,231,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,900,000.00	14,423,990.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,171,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,100,000.00	25,330,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,500,000.00	24,396,750.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	7,541,740.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000.00	41,148,380.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,000,000.00	23,801,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	526,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	16,476,440.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,594,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,400,000.00	22,425,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	10,020,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	3,653,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	607,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	7,716,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	245,940.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,200,000.00	20,502,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	13,725,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	7,033,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,739,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	9,926,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,000,000.00	9,979,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,594,589.80	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	505,289.50	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	104,659.26	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,670.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	408,016.00	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	767,725.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,419,900.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	107,577.90	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,121,188.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,137,335.40	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,587,200.00	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	887,961.60	

FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	234,447.00	
FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,112,602.80	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	624,915.16	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	400,158.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,009,310.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,600,000.00	2,642,120.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,672,725.10	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	102,190.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,600,000.00	10,635,974.40	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,848,105.72	
FRANCE (GOVT OF)	11,000,000.00	11,570,680.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,905,300.00	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,914,074.30	
FRANCE (GOVT OF)	7,700,000.00	8,458,989.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,176,672.00	
FRANCE (GOVT OF)	11,600,000.00	12,653,976.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,141,580.00	
FRANCE (GOVT OF)	8,500,000.00	10,785,654.25	
FRANCE (GOVT OF)	10,500,000.00	12,302,108.70	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	117,860.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	128,895.60	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	14,945,226.20	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,566,702.20	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	532,407.25	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,700,000.00	1,774,990.23	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,500,000.00	9,005,291.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,400,000.00	3,437,706.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	23,000,000.00	24,398,400.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,900,000.00	13,542,160.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	31,172,850.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,302,625.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,500,000.00	26,188,500.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,494,100.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000.00	41,970,280.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,693,000.00	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	40,798,134.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,500,000.00	15,934,995.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000.00	34,554,854.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,400,000.00	26,125,792.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	507,331.29	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	13,370,256.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,550,000.00	47,999,142.19	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,900,000.00	10,278,141.51	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,900,000.00	13,045,867.60	
IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,088,576.89	
IRISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,377,243.20	
IRISH TSY 0.8% 2022	1,200,000.00	1,225,494.48	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	670,260.00	
IRISH TSY 1.3% 2033	2,400,000.00	2,799,501.60	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,309,910.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	1,500,000.00	1,916,229.15	
IRISH TSY 1.7% 2037	5,100,000.00	6,377,348.55	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,989,068.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	3,700,000.00	4,631,049.50	
IRISH TSY 2% 2045	3,100,000.00	4,295,077.90	
IRISH TSY 2022	9,000,000.00	9,114,242.40	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,100,000.00	6,967,151.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	605,339.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	105,461.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	221,101.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,700,000.00	6,806,370.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	428,033.04	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	102,241.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	8,700,000.00	9,609,412.74	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,565,942.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	2,023,690.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,723,335.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	17,853,450.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,099,080.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,400,000.00	3,613,860.00	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	9,500,000.00	12,832,885.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3,700,000.00	6,266,236.75	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	557,564.80	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	2,742,646.50	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	6,900,000.00	11,975,812.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,648,945.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	729,735.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	3,424,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	101,396.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	218,211.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	917,055.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	161,425.15	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,331,720.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	767,756.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,423,338.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,058,880.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,162,978.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	11,177,669.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	8,178,360.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,800,000.00	6,468,029.28	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	677,720.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	5,495,163.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,100,000.00	9,497,670.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,294,298.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	450,000.00	1,056,324.24	
	REPUBLIC OF IRELAND	4,450,000.00	4,964,153.00	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,792,928.00	
	SPANISH GOVERNMENT	31,800,000.00	51,414,240.00	
	SPANISH GOVERNMENT	2,500,000.00	3,861,475.00	
小計	銘柄数：249	1,489,900,000.00	1,947,633,204.83 (245,148,591,491)	
	組入時価比率：41.0%		41.3%	
英ポンド	UK TREASURY	470,000.00	487,794.20	
	UK TREASURY	6,650,000.00	7,055,916.00	
	UK TREASURY	400,000.00	414,756.00	

UK TREASURY	9,300,000.00	9,340,920.00	
UK TREASURY	14,000,000.00	14,345,800.00	
UK TREASURY	1,100,000.00	1,177,374.00	
UK TREASURY	1,600,000.00	1,663,696.00	
UK TREASURY	7,450,000.00	8,297,810.00	
UK TREASURY	9,950,000.00	12,224,868.50	
UK TREASURY	200,000.00	206,408.00	
UK TREASURY	200,000.00	220,724.00	
UK TREASURY	160,000.00	174,355.20	
UK TREASURY	400,000.00	432,852.00	
UK TREASURY	9,630,000.00	12,543,171.30	
UK TREASURY	200,000.00	224,382.00	
UK TREASURY	7,900,000.00	11,667,036.00	
UK TREASURY	6,000,000.00	8,731,200.00	
UK TREASURY	5,550,000.00	8,018,640.00	
UK TREASURY	16,300,000.00	25,106,890.00	
UK TREASURY	2,600,000.00	4,012,060.00	
UK TREASURY	100,000.00	170,480.00	
UK TREASURY	600,000.00	980,100.00	
UK TREASURY	500,000.00	830,450.00	
UK TREASURY	400,000.00	436,480.00	
UK TREASURY	570,000.00	1,005,252.00	
UK TREASURY	18,440,000.00	29,411,800.00	
UK TREASURY	6,300,000.00	11,418,120.00	
UK TREASURY	8,200,000.00	9,553,000.00	
UK TREASURY	16,100,000.00	19,918,920.00	
UK TREASURY	5,350,000.00	10,143,600.00	
UK TREASURY	6,750,000.00	12,370,725.00	
UK TREASURY	1,000,000.00	1,245,800.00	
UK TREASURY	700,000.00	919,240.00	
UK TREASURY	100,000.00	166,650.00	
UK TREASURY	200,000.00	423,480.00	
UK TSY 3 1/4% 2044	27,450,000.00	41,759,685.00	
UNITED KINGDOM(GOVERNMEN	6,800,000.00	14,056,960.00	
小計 銘柄数 : 37	199,620,000.00	281,157,395.20	

			(39,623,511,705)	
	組入時価比率：6.6%		6.7%	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	36,050,000.00	38,459,582.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	7,900,000.00	8,365,926.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	32,250,000.00	36,476,362.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,913,353.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,800,000.00	17,957,778.72	
	SWEDISH GOVERNMENT	14,300,000.00	15,352,337.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	15,600,000.00	24,371,602.32	
小計	銘柄数：7	134,900,000.00	153,896,942.34	
			(1,874,464,757)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,300,000.00	10,795,430.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	38,900,000.00	42,640,235.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,999,625.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,982,940.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,384,320.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,991,280.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	22,000,000.00	24,217,600.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,888,244.00	
小計	銘柄数：8	100,100,000.00	108,899,674.00	
			(1,296,995,117)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	14,400,000.00	15,013,036.80	
	KINGDOM OF DENMARK	400,000.00	407,720.00	
	KINGDOM OF DENMARK	27,270,000.00	29,137,995.00	
	KINGDOM OF DENMARK	29,300,000.00	32,830,650.00	
	KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	16,809,990.00	
	KINGDOM OF DENMARK	21,400,000.00	23,107,720.00	
	KINGDOM OF DENMARK	38,100,000.00	71,870,697.00	
小計	銘柄数：7	146,570,000.00	189,177,808.80	
			(3,200,888,524)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	45,400,000.00	47,041,632.22	
	POLAND GOVERNMENT BOND	33,600,000.00	36,127,973.28	
	POLAND GOVERNMENT BOND	48,300,000.00	53,552,571.87	

小計	銘柄数：3 組入時価比率：0.6%	127,300,000.00	136,722,177.37 (3,862,401,510) 0.7%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	10,028,496.80
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,340,000.00	14,689,474.40
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	80,000.00	83,460.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	6,137,847.36
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,838,280.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	15,200,000.00	17,193,723.20
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	15,439,354.41
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,100,000.00	15,359,029.73
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,667,823.04
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,800,000.00	19,790,040.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,428,943.79
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	12,145,999.42
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	15,486,520.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,500,000.00	13,218,105.75
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,415,679.20
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	10,847,495.12
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,175,500.70
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,000,000.00	10,877,805.60
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	898,310.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	482,588.16
AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	6,719,340.00	
小計	銘柄数：21 組入時価比率：2.4%	160,200,000.00	187,923,816.68 (14,564,095,792) 2.5%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,426,640.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	409,718.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,100,000.00	3,278,250.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	310,590.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,600,000.00	3,844,800.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,530,040.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,095,510.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,199,170.50
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	761,460.00

小計	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,598,100.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	568,150.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	350,850.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,842,176.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,530,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	2,415,021.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,750,000.00	3,471,875.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,305,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,164,505.00	
	銘柄数：18	30,100,000.00	34,102,455.50	(2,657,263,332)
組入時価比率：0.4%			0.4%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,136,030.83	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	431,470.68	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	3,036,663.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,700,000.00	2,946,599.37	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	482,352.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,200,000.00	6,353,569.04	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	512,212.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	7,735,458.75	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	520,803.45	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	14,049,869.85	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,674,131.65	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,321,065.56	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	6,261,959.56	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	654,575.46	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,724,998.08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	5,055,917.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,514,815.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,392,568.86	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	3,225,271.23	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	309,232.08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	12,700,000.00	14,681,981.05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	5,019,307.48	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	450,516.28	

小計	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	870,935.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	1,020,301.65	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	11,744,541.75	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,100,000.00	4,822,734.06	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	359,705.31	
	銘柄数：28	107,180,000.00	118,309,588.63	(3,033,457,852)
	組入時価比率：0.5%			0.5%
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	2,600,000.00	2,797,988.18	
	ISRAEL FIXED BOND	6,900,000.00	6,987,072.48	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,125,291.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,523,099.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,206,349.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,618,808.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,344,822.00	
	ISRAEL FIXED BOND	6,500,000.00	8,790,764.45	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,490,164.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,661,972.50	
	ISRAEL FIXED BOND	2,000,000.00	2,057,332.80	
	ISRAEL FIXED BOND	6,000,000.00	10,646,395.80	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	7,323,308.00	
	銘柄数：13	64,000,000.00	76,573,368.71	(2,417,421,250)
組入時価比率：0.4%			0.4%	
合計			592,988,207,632	(592,988,207,632)

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(3)貸付有価証券の明細(2020年 9月 7日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	1,445,000	
		US TREASURY N/B	33,000,000	
		US TREASURY N/B	10,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	10,227,000	

US TREASURY N/B	5,500,000
US TREASURY N/B	6,400,000
US TREASURY N/B	5,000,000
US TREASURY N/B	12,000,000
US TREASURY N/B	7,586,000
US TREASURY N/B	8,000,000
US TREASURY N/B	18,000,000
US TREASURY N/B	31,000,000
US TREASURY N/B	10,000,000
US TREASURY N/B	12,000,000
US TREASURY N/B	12,000,000
US TREASURY BOND	23,000,000
US TREASURY BOND	41,000,000
US TREASURY N/B	23,000,000
US TREASURY BOND	36,000,000
US TREASURY BOND	50,000,000
US TREASURY BOND	9,403,000
US TREASURY BOND	1,000,000
US TREASURY BOND	32,000,000
US TREASURY BOND	25,000,000
US TREASURY BOND	17,000,000
US TREASURY N/B	29,000,000
US TREASURY N/B	7,875,000
US TREASURY N/B	8,400,000
US TREASURY N/B	17,000,000
US TREASURY N/B	1,700,000
US TREASURY N/B	1,300,000
US TREASURY N/B	12,500,000
US TREASURY N/B	25,000,000
US TREASURY N/B	8,525,000
US TREASURY N/B	20,600,000
US TREASURY N/B	5,000,000
US TREASURY N/B	29,000,000
US TREASURY N/B	17,000,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	40,000,000
US TREASURY N/B	650,000
US TREASURY N/B	19,600,000
US TREASURY N/B	16,000,000
US TREASURY N/B	5,000,000
US TREASURY N/B	425,000
US TREASURY N/B	22,000,000
US TREASURY N/B	20,600,000
US TREASURY N/B	2,000,000
US TREASURY N/B	1,098,000
US TREASURY N/B	8,814,000
US TREASURY N/B	72,000
US TREASURY N/B	25,000,000
US TREASURY N/B	5,000,000

	US TREASURY N/B	36,000,000
	US TREASURY N/B	7,369,000
	US TREASURY N/B	6,069,000
	US TREASURY N/B	6,826,000
	US TREASURY N/B	19,700,000
	US TREASURY N/B	3,341,000
	US TREASURY N/B	33,000,000
	US TREASURY N/B	35,000,000
	US TREASURY BOND	38,000,000
	US TREASURY N/B	30,000,000
	US TREASURY N/B	2,000,000
	US TREASURY N/B	1,000,000
	US TREASURY N/B	4,186,000
	US TREASURY N/B	41,000,000
	US TREASURY N/B	27,000,000
	US TREASURY N/B	17,000,000
	US TREASURY N/B	765,000
	US TREASURY N/B	1,105,000
	US TREASURY N/B	12,000,000
	US TREASURY N/B	155,000
	US TREASURY N/B	26,000,000
	US TREASURY N/B	36,000,000
	US TREASURY N/B	34,000,000
	US TREASURY N/B	1,300,000
	US TREASURY N/B	25,000,000
	US TREASURY N/B	25,000,000
	US TREASURY N/B	16,000,000
ユーロ	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,300,000

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 9月 7日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	368,005,768	-	368,691,000	685,232
米ドル	201,658,238	-	202,065,000	406,762
ユーロ	150,761,330	-	151,044,000	282,670
シンガポールドル	15,586,200	-	15,582,000	4,200
合計	368,005,768	-	368,691,000	685,232

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2020年 9月 7日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	59,852,344
コール・ローン	23,787,450
国債証券	7,550,479,438
派生商品評価勘定	20,357
未収入金	286,942,086
未収利息	81,600,696
前払費用	17,131,744
流動資産合計	8,019,814,115
資産合計	8,019,814,115
負債の部	
流動負債	
未払金	288,642,285
未払解約金	8,843,350
未払利息	33
その他未払費用	698,900
流動負債合計	298,184,568
負債合計	298,184,568
純資産の部	
元本等	
元本	5,804,673,377
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,916,956,170
元本等合計	7,721,629,547
純資産合計	7,721,629,547
負債純資産合計	8,019,814,115

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

2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 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。
3. 費用・収益の計上基準	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。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

(貸借対照表に関する注記)

2020年 9月 7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	1.3302円
(10,000口当たり純資産額)	(13,302円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。
	当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。
	これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
	当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月 7日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 9月 7日現在	
期首	2019年 9月 7日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	5,687,016,039円
同期中における追加設定元本額	2,356,994,639円
同期中における一部解約元本額	2,239,337,301円
期末元本額	5,804,673,377円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	20,519,919円
野村資産設計ファンド2020	20,537,774円
野村資産設計ファンド2025	37,553,142円
野村資産設計ファンド2030	36,673,535円
野村資産設計ファンド2035	25,674,122円
野村資産設計ファンド2040	46,804,062円
野村資産設計ファンド2045	6,021,760円
野村インデックスファンド・新興国債券	911,265,293円
ネクストコア	23,872,555円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	304,346,875円
野村資産設計ファンド2050	7,664,953円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	4,724,554円

野村ターゲットデートファンド2016	2029 - 2031年目標型	1,905,435円
野村ターゲットデートファンド2016	2032 - 2034年目標型	1,326,049円
野村ターゲットデートファンド2016	2035 - 2037年目標型	881,107円
世界6資産分散ファンド		133,600,205円
野村資産設計ファンド2060		2,063,109円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国債券(適格機関投資家専用)		3,263,890,210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)		429,307円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信(適格機関投資家専用)		144,599,668円
野村DC新興国債券(現地通貨建て)インデックスファンド		389,684,258円
野村DC運用戦略ファンド		378,383,704円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)		33,091,358円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030		4,327,806円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040		2,639,815円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050		1,630,657円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060		562,145円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年9月7日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2020年9月7日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,600,000.00	8,887,866.08	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	11,000,000.00	11,366,535.40	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	3,400,000.00	3,574,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	11,141,200.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,900,000.00	13,007,297.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,900,000.00	8,118,435.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	13,850,000.00	15,425,022.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	15,100,000.00	17,916,150.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,600,000.00	7,505,025.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,200,000.00	4,756,080.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	3,635,010.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,600,000.00	10,209,576.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,700,000.00	7,353,183.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,500,000.00	9,514,900.00	
		MEXICAN FIXED RATE BONDS		17,800,000.00	19,572,702.00
小計		銘柄数: 15	135,850,000.00	151,983,231.48	

			(750,797,163)	
	組入時価比率：9.7%		10.0%	
リアル	LETRA TESOURO NACIONAL	3,300,000.00	3,181,023.45	
	LETRA TESOURO NACIONAL	4,900,000.00	4,607,313.20	
	LETRA TESOURO NACIONAL	3,900,000.00	3,435,087.63	
	LETRA TESOURO NACIONAL	5,000,000.00	4,237,594.50	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000.00	6,994,156.30	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	411,000.00	4,859,257.93	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000.00	3,837,007.68	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	250,000.00	3,041,500.25	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	60,000.00	736,621.86	
小計	銘柄数：9	18,751,000.00	34,929,562.80	
			(700,687,029)	
	組入時価比率：9.1%		9.3%	
チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	100,000,000.00	108,847,710.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	210,000,000.00	220,820,691.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	300,000,000.00	347,563,710.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	195,000,000.00	234,255,625.50	
	BONOS TESORERIA PESOS	240,000,000.00	300,996,552.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	215,000,000.00	314,696,489.00	
小計	銘柄数：6	1,260,000,000.00	1,527,180,777.50	
			(210,140,074)	
	組入時価比率：2.7%		2.8%	
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,160,000,000.00	2,217,590,568.00	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	4,810,000,000.00	6,238,089,000.00	
	TITULOS DE TESORERIA	950,000,000.00	1,166,628,025.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	958,508,370.00	
	TITULOS DE TESORERIA	800,000,000.00	940,527,920.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,600,000,000.00	1,756,747,680.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,400,000,000.00	1,531,769,960.00	
小計	銘柄数：7	12,620,000,000.00	14,809,861,523.00	
			(423,562,039)	
	組入時価比率：5.5%		5.6%	
ソル	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	821,230.20	
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	709,157.88	
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	698,435.76	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	744,108.96	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	698,693.73	
	PERU BONO SOBERANO	700,000.00	930,138.02	
	PERU BONO SOBERANO	1,300,000.00	1,621,695.92	
	PERU BONO SOBERANO	620,000.00	741,953.00	
	REPUBLIC OF PERU	1,100,000.00	1,335,316.84	
小計	銘柄数：9	7,020,000.00	8,300,730.31	

			(250,184,011)	
	組入時価比率：3.2%		3.3%	
ウルグアイペソ	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	4,130,000.00	
小計	銘柄数：1	4,000,000.00	4,130,000.00	
			(10,366,300)	
	組入時価比率：0.1%		0.1%	
ドミニカペソ	DOMINICAN REPUBLIC	8,000,000.00	8,211,920.00	
小計	銘柄数：1	8,000,000.00	8,211,920.00	
			(14,945,694)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	250,000.00	239,500.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,168,800.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	790,000.00	731,145.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,400,000.00	1,377,600.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,270,000.00	2,002,140.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	481,863.20	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,110,000.00	976,800.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	843,540.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	400,000.00	363,200.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,079,400.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	700,000.00	611,100.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,720,800.00	
小計	銘柄数：12	12,660,000.00	11,595,888.20	
			(165,937,160)	
	組入時価比率：2.1%		2.2%	
チェココルナ	CZECH REPUBLIC	14,000,000.00	14,017,498.60	
	CZECH REPUBLIC	23,600,000.00	23,897,728.16	
	CZECH REPUBLIC	12,500,000.00	12,001,077.50	
	CZECH REPUBLIC	13,200,000.00	13,044,094.80	
	CZECH REPUBLIC	6,500,000.00	7,172,100.00	
小計	銘柄数：5	69,800,000.00	70,132,499.06	
			(333,129,370)	
	組入時価比率：4.3%		4.4%	
フォリント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,225,000.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	17,000,000.00	18,962,650.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	93,000,000.00	94,849,026.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	77,000,000.00	88,827,200.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	68,000,000.00	72,460,800.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	45,000,000.00	47,317,995.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	75,153,015.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	86,000,000.00	91,013,800.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	82,000,000.00	88,379,001.40	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	57,000,000.00	77,491,500.00	

小計	HUNGARY GOVERNMENT BOND	60,000,000.00	64,189,176.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	30,000,000.00	32,736,195.00	
	銘柄数：12	688,000,000.00	761,605,358.40 (266,104,912)	
	組入時価比率：3.4%		3.5%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	3,833,789.41	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,324,335.86	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,300,949.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000.00	4,278,800.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,100,000.00	6,654,765.11	
	POLAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	886,999.12	
	小計	銘柄数：6	20,600,000.00	22,279,638.70 (629,399,793)
	組入時価比率：8.2%		8.3%	
ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,000,000.00	20,642,000.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	22,500,000.00	23,778,000.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	12,726,600.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	29,000,000.00	30,583,400.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	14,000,000.00	14,724,570.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	37,300,000.00	40,379,488.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	41,000,000.00	44,339,450.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,000,000.00	30,186,270.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	47,700,000.00	53,686,350.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	12,184,800.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,700,000.00	20,124,940.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	10,645,250.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,000,000.00	22,310,000.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	26,500,000.00	31,469,280.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,500,000.00	30,841,250.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	10,855,000.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,000,000.00	20,595,780.00	
	小計	銘柄数：17	393,200,000.00	430,072,428.00 (610,702,847)
		組入時価比率：7.9%		8.1%
レイ	ROMANIA	500,000.00	507,470.00	
	ROMANIA	900,000.00	907,965.00	
	ROMANIA	1,000,000.00	1,013,830.00	
	ROMANIA	550,000.00	590,419.50	
	ROMANIA	400,000.00	415,598.12	
	ROMANIA	500,000.00	501,980.00	
	ROMANIA	1,000,000.00	1,047,210.00	
	ROMANIA	920,000.00	977,086.00	
	ROMANIA	500,000.00	539,610.00	

小計	ROMANIA	760,000.00	867,282.20	
	ROMANIA	800,000.00	878,272.00	
	ROMANIA	600,000.00	589,905.00	
	銘柄数：12	8,430,000.00	8,836,627.82 (229,133,759)	
	組入時価比率：3.0%		3.0%	
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	300,000.00	323,603.01	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,000,000.00	2,205,120.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	873,066.48	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,000,000.00	1,205,881.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,331,751.98	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	832,584.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,889,553.42	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,263,097.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,807,085.32	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,090,959.10	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	655,891.26	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,536,896.48	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	3,153,840.77	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	2,098,360.57	
	小計	銘柄数：14	19,600,000.00	21,267,692.67 (545,303,640)
		組入時価比率：7.1%		7.2%
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,200,000.00	7,487,688.24	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,360,024.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,161,975.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	16,700,000.00	18,082,748.31	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,171,687.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,900,000.00	24,543,540.96	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,602,714.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	17,700,000.00	18,866,575.14	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,900,000.00	14,497,986.21	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	13,158,903.72	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,800,000.00	16,052,739.96	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	7,271,510.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,200,000.00	10,132,223.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,965,765.20	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	15,387,366.25	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	1,900,000.00	2,257,423.44	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,300,000.00	15,301,095.39	
	小計	銘柄数：17	179,300,000.00	197,301,967.52 (666,880,650)
		組入時価比率：8.6%		8.8%

		CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,450,200.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,534,081.00	
	小計	銘柄数：3	27,500,000.00	28,568,083.75	
		組入時価比率：5.8%		(444,519,383)	
				5.9%	
	合計			7,550,479,438	
				(7,550,479,438)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 9月 7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	11,678,143	-	11,698,500	20,357
米ドル	11,678,143	-	11,698,500	20,357
合計	11,678,143	-	11,698,500	20,357

(注)時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

世界6資産分散ファンド

2020年9月30日現在

資産総額	1,040,983,271円
負債総額	578,238円
純資産総額（ - ）	1,040,405,033円
発行済口数	1,023,250,830口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0168円

（参考）国内株式マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	505,922,190,203円
負債総額	50,957,102,808円
純資産総額（ - ）	454,965,087,395円
発行済口数	270,880,440,393口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6796円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	701,033,646,075円
負債総額	4,958,161,433円
純資産総額（ - ）	696,075,484,642円
発行済口数	231,449,229,089口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0075円

（参考）新興国株式マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	44,520,089,188円
負債総額	275,590,993円
純資産総額（ - ）	44,244,498,195円
発行済口数	34,924,688,086口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2669円

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	704,693,920,066円
負債総額	7,042,885,883円
純資産総額（ - ）	697,651,034,183円
発行済口数	524,569,817,805口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3299円

（参考）外国債券マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	596,625,524,856円
負債総額	815,655,869円
純資産総額（ - ）	595,809,868,987円
発行済口数	240,898,074,685口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4733円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	7,563,042,297円
負債総額	18,942,903円
純資産総額（ - ）	7,544,099,394円
発行済口数	5,855,228,766口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2884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

2020年10月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2020年9月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

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

追加型株式投資信託	991	31,472,667
単位型株式投資信託	189	830,380
追加型公社債投資信託	14	5,687,903
単位型公社債投資信託	472	1,630,568
合計	1,666	39,621,517

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(2019年4月1日から2020年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人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 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金			1,562		2,626
金銭の信託			45,493		41,524
有価証券			19,900		24,399
前払費用			27		106
未収入金			500		522
未収委託者報酬			25,246		23,936
未収運用受託報酬			5,933		4,336
その他			269		71
貸倒引当金			15		14
流動資産計			98,917		97,509
固定資産					
有形固定資産					
建物	2	320		295	
器具備品	2	393		349	
無形固定資産					
ソフトウェア		6,437		5,893	
その他		0		0	

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

区分	注記 番号	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			145		157
未払金			16,709		15,279
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		25		3	
未払手数料		7,724		6,948	
関係会社未払金		7,422		7,262	
その他未払金		1,535		1,063	
未払費用	1		11,704		10,290
未払法人税等			1,560		1,564
前受収益			29		26
賞与引当金			3,792		3,985
その他			-		67
流動負債計			33,942		31,371
固定負債					
退職給付引当金			3,219		3,311
時効後支払損引当金			558		572
固定負債計			3,777		3,883
負債合計			37,720		35,254
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			86,924		85,270
資本剰余金			17,180		17,180
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			56,014		54,360
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		55,329		53,675	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,723		29,069	
評価・換算差額等			33		10
その他有価証券評価差額金			33		10

純資産合計		86,958	85,281
負債・純資産合計		124,679	120,536

(2) 【損益計算書】

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

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
--	--	--

区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	6,538		4,936	
受取利息		0		0	
その他		424		309	
営業外収益計			6,964		5,246
営業外費用					
支払利息	1	1		-	
金銭の信託運用損		489		230	
投資事業組合等評価損		-		146	
時効後支払損引当金繰入額		43		18	
為替差損		34		23	
その他		17		23	
営業外費用計			585		443
經常利益			38,222		35,555
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		21	
関係会社清算益	3	29		-	
株式報酬受入益		85		59	
特別利益計			135		81
特別損失					
投資有価証券等評価損		938		119	
関係会社株式評価損		161		1,591	
固定資産除却損	2	310		67	
投資損失引当金繰入額		707		-	
特別損失計			2,118		1,778
税引前当期純利益			36,239		33,858
法人税、住民税及び事業税			10,196		9,896
法人税等調整額			370		34
当期純利益			25,672		23,996

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金			
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金		利益 剰余金 合計	
						別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078
当期変動額									
剰余金の配当							24,826	24,826	24,826

当期純利益							25,672	25,672	25,672
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	846	846	846
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924
当期変動額									
剰余金の配当							25,650	25,650	25,650
当期純利益							23,996	23,996	23,996
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純 額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,653	1,653	1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	33	33	86,958
当期変動額			
剰余金の配当			25,650
当期純利益			23,996
株主資本以外の項目 の当期変動額（純 額）	23	23	23
当期変動額合計	23	23	1,676
当期末残高	10	10	85,281

[重要な会計方針]

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

<p>5 . 消費税等の会計処理方法</p> <p>6 . 連結納税制度の適用</p>	<p>(3) 退職給付引当金 従業員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。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理してあります。</p> <p>連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</p>
---	--

[未適用の会計基準等]

- ・ 「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）
- ・ 「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日）

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）

(1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針（以下「時価算定会計基準等」という。）が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

また「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」が改訂され、金融商品の時価のレベルごとの内訳等の注記事項が定められました。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「会計方針の開示、会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 2020年3月31日）

(1) 概要

関連する会計基準等の定めが明らかでない場合に、採用した会計処理の原則及び手続きの概要を示すことを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

- ・「会計上の見積りの開示に関する会計基準（企業会計基準第31号 2020年3月31日）

(1) 概要

当年度の財務諸表に計上した金額が会計上の見積りによるもののうち、翌年度の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目における会計上の見積りの内容について、財務諸表利用者の理解に資する情報を開示することを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2019年3月31日)	当事業年度末 (2020年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 未払費用 1,434百万円	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 1,296百万円

2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額		2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額	
建物	736百万円	建物	761百万円
器具備品	3,106	器具備品	2,347
合計	3,842	合計	3,109

損益計算書関係

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 6,531百万円 支払利息 1	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 4,931百万円
2. 固定資産除却損 器具備品 3百万円 ソフトウェア 307 合計 310	2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソフトウェア 59 合計 67
3. 関係会社清算益 関係会社清算益は、関係会社の清算にともなう清算配当です。	

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	25,650百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,980円

基準日 2019年3月31日
効力発生日 2019年6月28日

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

当事業年度（自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

2020年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額

(1)現金・預金	2,626	2,626	-
(2)金銭の信託	41,524	41,524	-
(3)未収委託者報酬	23,936	23,936	-
(4)未収運用受託報酬	4,336	4,336	-
(5)有価証券及び投資有価証券	24,399	24,399	-
その他有価証券	24,399	24,399	-
資産計	96,823	96,823	-
(6)未払金	15,279	15,279	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	3	3	-
未払手数料	6,948	6,948	-
関係会社未払金	7,262	7,262	-
その他未払金	1,063	1,063	-
(7)未払費用	10,290	10,290	-
(8)未払法人税等	1,564	1,564	-
負債計	27,134	27,134	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

 その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

ます。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,437百万円、関係会社株式10,171百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。当事業年度において、非上場株式について2,416百万円（投資有価証券117百万円、関係会社株式2,298百万円）減損処理を行っております。なお、関係会社株式に係る評価損は、過年度に計上しておりました関係会社株式に対する投資損失引当金の戻入益707百万円と相殺し、関係会社株式評価損1,591百万円を特別損失に計上しております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	2,626	-	-	-
金銭の信託	41,524	-	-	-
未収委託者報酬	23,936	-	-	-
未収運用受託報酬	4,336	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	24,399	-	-	-
合計	96,823	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1．売買目的有価証券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2019年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2019年3月31日)

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

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	19,900	19,900	-
小計	19,900	19,900	-
合計	19,900	19,900	-

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

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1．売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2020年3月31日)

区分	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	4,400	4,400	-
コマーシャル・ペーパー	19,999	19,999	-
小計	24,399	24,399	-
合計	24,399	24,399	-

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,551 百万円
勤務費用	1,034
利息費用	154
数理計算上の差異の発生額	138
退職給付の支払額	858
その他	17
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>23,761</u>

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	17,469 百万円
期待運用収益	436
数理計算上の差異の発生額	393
事業主からの拠出額	566
退職給付の支払額	666
<u>年金資産の期末残高</u>	<u>17,413</u>

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

積立型制度の退職給付債務	20,462 百万円
年金資産	17,413
	3,048
非積立型制度の退職給付債務	3,299
未積立退職給付債務	6,347
未認識数理計算上の差異	4,764
未認識過去勤務費用	185
<u>貸借対照表上に計上された負債と資産の純額</u>	<u>1,766</u>
退職給付引当金	3,311
前払年金費用	1,545
<u>貸借対照表上に計上された負債と資産の純額</u>	<u>1,766</u>

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	1,034 百万円
利息費用	154
期待運用収益	436
数理計算上の差異の費用処理額	572
過去勤務費用の費用処理額	35
<u>確定給付制度に係る退職給付費用</u>	<u>1,289</u>

(5) 年金資産に関する事項	
年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	57%
株式	24%
生保一般勘定	12%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%
長期期待運用収益率の設定方法	
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。	
(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企業年金制度の割引率	0.6%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%
3. 確定拠出制度	
当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。	

税効果会計関係

前事業年度末 (2019年3月31日)		当事業年度末 (2020年3月31日)	
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
繰延税金資産	百万円	繰延税金資産	百万円
賞与引当金	1,175	賞与引当金	1,235
退職給付引当金	998	退職給付引当金	1,026
関係会社株式評価減	51	関係会社株式評価減	762
投資有価証券評価減	708	投資有価証券評価減	462
未払事業税	288	未払事業税	285
時効後支払損引当金	172	時効後支払損引当金	177
減価償却超過額	171	減価償却超過額	171
ゴルフ会員権評価減	192	ゴルフ会員権評価減	167
関係会社株式売却損	148	関係会社株式売却損	148
未払社会保険料	82	未払社会保険料	97
その他	633	その他	219
繰延税金資産小計	4,625	繰延税金資産小計	4,754
評価性引当額	1,295	評価性引当額	1,532
繰延税金資産合計	3,329	繰延税金資産合計	3,222
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	15	その他有価証券評価差額金	4
前払年金費用	620	前払年金費用	478
繰延税金負債合計	635	繰延税金負債合計	483
繰延税金資産の純額	2,694	繰延税金資産の純額	2,738

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率 (調整)	法定実効税率 (調整)
31.0%	31.0%
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
0.1%	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	受取配当金等永久に益金に算入されない項目
5.6%	4.4%
タックスヘイブン税制	タックスヘイブン税制
2.6%	2.6%
外国税額控除	外国税額控除
0.6%	0.7%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税
0.3%	0.2%
その他	その他
1.3%	0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	税効果会計適用後の法人税等の負担率
29.1%	29.1%

セグメント情報等

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

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

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1)	31,378	未払手数料	5,536
							コマーシャル・ペーパーの購入(*2)	20,000	有価証券	19,999
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

野村ホールディングス㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、

ニューヨーク証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,882円89銭	1株当たり純資産額	16,557円31銭
1株当たり当期純利益	4,984円30銭	1株当たり当期純利益	4,658円88銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	25,672百万円	損益計算書上の当期純利益	23,996百万円
普通株式に係る当期純利益	25,672百万円	普通株式に係る当期純利益	23,996百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳		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。		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。)

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

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

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託者

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

* 2020年9月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
株式会社SBI証券	48,323百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
SMB C日興証券株式会社	10,000百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社東京スター銀行	26,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

* 2020年9月末現在

2【関係業務の概要】

(1)受託者

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

(2)販売会社

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ないます。

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

独立監査人の監査報告書

2020年6月10日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成すること

が適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2020年10月16日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界6資産分散ファンドの2019年9月7日から2020年9月7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、世界6資産分散ファンドの2020年9月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。