

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年6月24日提出
【計算期間】	第4期(自 2019年3月30日至 2020年3月30日)
【ファンド名】	ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号(2020年7月1日以降: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
【連絡場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号(2020年7月1日以降:東京都江東区豊洲二丁目2番1号)
【電話番号】	03-3241-9511
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドは、投資一任口座の資金を運用するためのファンドです。

日本の株式を実質的な投資対象とする投資信託証券を主要投資対象とし、信託財産の成長を目標に運用を行なうことを基本とします。

## 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。

## &lt;商品分類&gt;

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

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

(ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式)

## 《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)
単位型	国内	株式
	海外	債券
追加型	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
--------	------	--------	------

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  <b>日本</b>	ファミリーファンド
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	
不動産投信	その他 ( )	中南米  アフリカ	<b>ファンド・オブ・ファンズ</b>
<b>その他資産</b> <b>(投資信託証券</b> <b>(株式一般))</b>		中近東 (中東)  エマージング	
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型			

ファンドは、ファンド・オブ・ファンズです。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（株式）とが異なります。

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

#### < 商品分類表定義 >

##### [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

##### [ 投資対象地域による区分 ]

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

##### [ 投資対象資産による区分 ]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な

収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

- (5)資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を  
実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[ 独立した区分 ]

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

[ 補足分類 ]

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

< 属性区分表定義 >

[ 投資対象資産による属性区分 ]

株式

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

債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[ 決算頻度による属性区分 ]

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

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

るものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

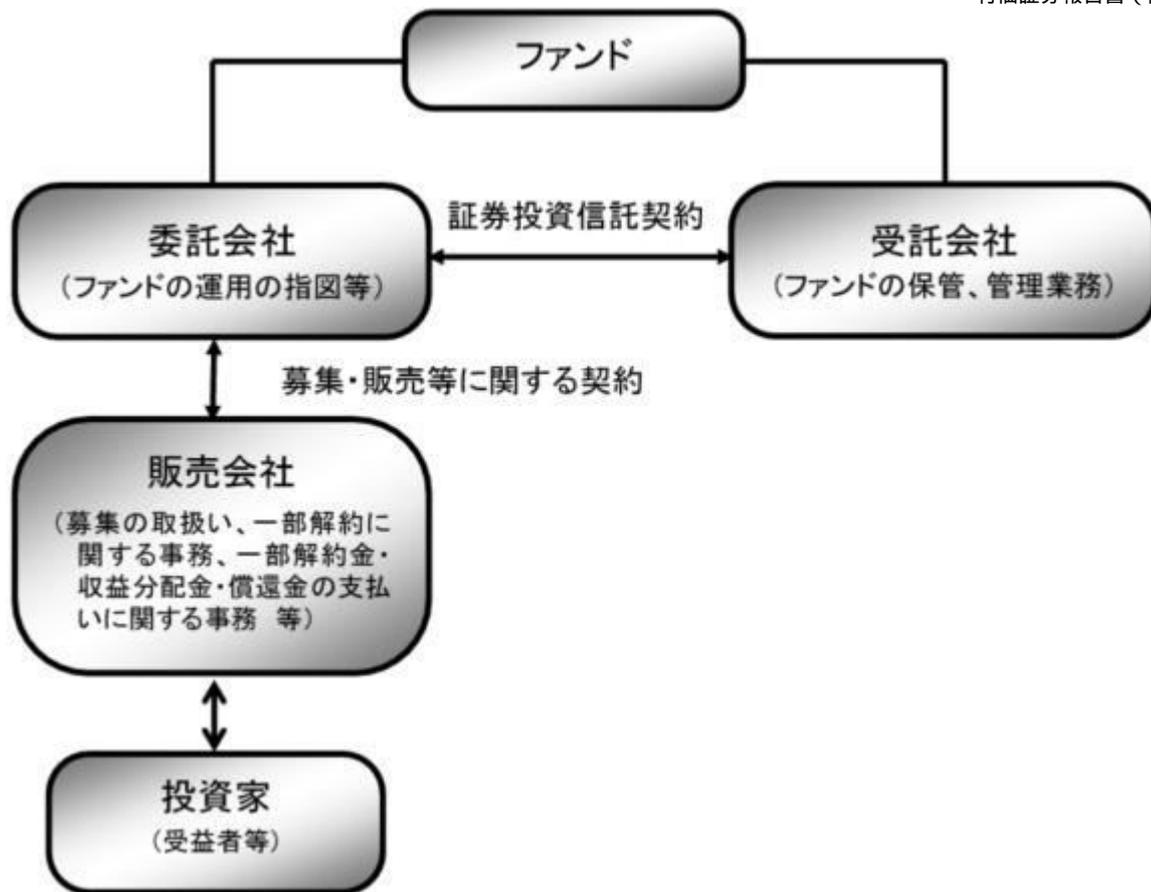
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定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

## ( 2 ) 【ファンドの沿革】

2016年10月20日

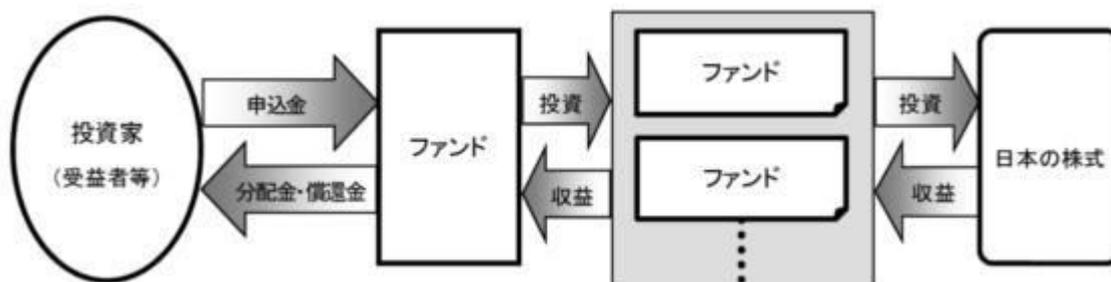
信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

## ( 3 ) 【ファンドの仕組み】



#### 《ファンド・オブ・ファンズ方式について》

ファンドは複数の投資信託証券（ファンド）を投資対象とするファンド・オブ・ファンズ方式で運用します。



ファンド	ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式
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5月末現在）

- ・名称  
野村アセットマネジメント株式会社
- ・本店の所在の場所  
東京都中央区日本橋一丁目12番1号
- ・資本金の額  
17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日	野村証券投資信託委託株式会社として設立
1997年10月1日	投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更
2000年11月1日	野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

日本の株式を実質的な投資対象とする投資信託証券を主要投資対象とし、信託財産の成長を目標に運用を行なうことを基本とします。

日本の株式を投資対象とする円建ての上場投資信託証券（ETF）に投資する場合があります。

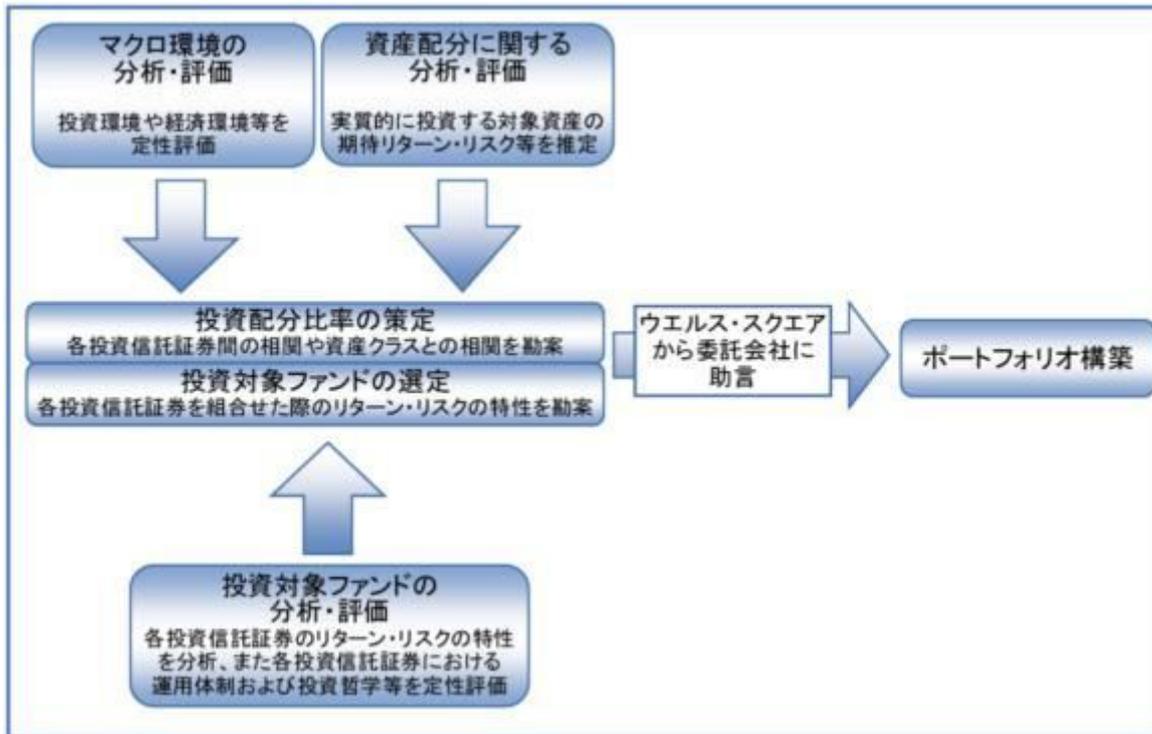
投資信託証券への投資にあたっては、株式会社ウエルス・スクエア（ウエルス・スクエア）からの助言に基づき、定性評価・定量評価等を勘案して指定投資信託証券の選定および投資信託証券への配分比率の決定を行ないます。

ウエルス・スクエアはポートフォリオの構築にあたり、投資信託証券の期待リターンやリスク水準等の定量分析および投資環境等の定性判断等に基づき、投資配分比率に関する助言を行ないます。

組入投資信託証券については適宜見直しを行ないます。

指定投資信託証券は定性評価、定量評価等を勘案して適宜見直しを行ないます。この際、指定投資信託証券として指定されていた投資信託証券が指定から外れたり、新たな投資信託証券が指定投資信託証券として指定される場合もあります。

## ポートフォリオ構築プロセス



\* 上記のポートフォリオ構築プロセスは、今後変更となる場合があります。

投資信託証券への投資は、高位を維持することを基本とします。

投資信託証券への投資を通じて、実質的な日本の株式(当該投資信託証券が実質的に保有する株式を勘案します。)の組入れが概ね高位となることを目途として、投資信託証券への投資を行なうことを基本とします。

東証株価指数（TOPIX）（配当込み）をベンチマークとします。

(参考) ウェルズ・スクエアについて

ウェルズ・スクエアの概要

株式会社ウェルズ・スクエアは、野村グループの資産運用会社で、主にファンドラップの投資運用サービス等の提供を行ないます。

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】

日本の株式を実質的な投資対象とする投資信託証券を主要投資対象とします。

なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。

ファンドは、以下に示す投資信託証券（「指定投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

指定投資信託証券
国内株式マザーファンド

野村日本株IPストラテジー マザーファンド
野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド
野村RAFI <sup>(R)</sup> 日本株投信マザーファンド
野村日経225 マザーファンド

上記は2020年6月24日現在の指定投資信託証券の一覧です。今後、上記指定投資信託証券の一部が、名称変更となる場合、または繰上償還等により指定投資信託証券から除外される場合、あるいは、ここに記載された以外の投資信託証券が新たに指定投資信託証券に追加となる場合等があります。

#### 投資の対象とする資産の種類(信託約款)

この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）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．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）
  - ハ．金銭債権（イ及びロに掲げるものに該当するものを除きます。）
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ．為替手形

#### 有価証券の指図範囲等(信託約款)

委託者は、信託金を、別に定める投資信託証券（以下「指定投資信託証券」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くものとし、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（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および短期社債等を除きます。）
4. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、公社債にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行なうことができるものとします。

#### 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

#### (参考)指定投資信託証券について

以下はファンドが投資を行なう投資信託証券（「指定投資信託証券」といいます。）の投資方針、関係

法人、信託報酬等について、2020年6月24日現在で委託会社が知りうる情報等を基に記載したものです（個別に時点の記載がある場合を除きます。）。

今後、指定投資信託証券の各委託会社（運用会社）の都合等により、記載の内容が変更となる場合があります。

また、ここに記載した指定投資信託証券は上記日付現在のものであり、今後、繰上償還等により指定投資信託証券から除外される場合、あるいは、ここに記載された以外の投資信託証券が新たに指定投資信託証券に追加となる場合等があります。

指定投資信託証券の名称について、「（適格機関投資家専用）」の部分を省略して記載する場合があります。また、「ファンド」という場合があります。

指定投資信託証券の一部の受託会社について、信託事務処理の一部を他の信託銀行に再信託する場合があります。

## 国内株式マザーファンド

### (A) ファンドの特色

わが国の株式を主要投資対象とし、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いません。

### (B) 信託期間

無期限（設定日：2001年5月11日）

### (C) ファンドの関係法人

関係	名称
委託会社	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社

### (D) 管理報酬等

委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等を信託財産から支払います。

### (E) 投資方針等

**(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) 主な投資制限**

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。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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。

**野村日本株IPストラテジー マザーファンド****(A) ファンドの特色**

わが国の株式を主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行なうことを基本とします。

**(B) 信託期間**

無期限（設定日：2014年9月29日）

**(C) ファンドの関係法人**

関係	名称
委託会社	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社

**(D) 管理報酬等**

委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等を信託財産から支払います。

**(E) 投資方針等**

**(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**

株式への投資にあたっては、企業の収益力と当該企業が行なう投資の関係に着目した独自の評価尺度を用いて銘柄の魅力度評価を行ない、投資候補銘柄を選別します。

ポートフォリオの構築にあたっては、当該投資候補銘柄について、時価総額、流動性、財務リスク等を勘案して組入銘柄および組入比率を決定します。

株式の組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。

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) 主な投資制限**

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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。

同一銘柄の株式への投資割合は、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。

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。

**野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド****(A) ファンドの特色**

わが国の株式を主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行なうことを基本とします。

**(B) 信託期間**

無期限（設定日：2016年9月29日）

**(C) ファンドの関係法人**

関係	名称
委託会社	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社

**(D) 管理報酬等**

委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等を信託財産から支払います。

**(E) 投資方針等**

**(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**

株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行ない、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。

ポートフォリオの最適化にあたっては、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄への投資比率、取引コスト等を勘案します。

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。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%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

**(3) 主な投資制限**

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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。

同一銘柄の株式への投資割合は、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。

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。

**野村RAFI<sup>(R)</sup> 日本株投信マザーファンド****(A) ファンドの特色**

わが国の株式を主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行なうことを基本とします。

**(B) 信託期間**

無期限（設定日：2007年5月30日）

**(C) ファンドの関係法人**

関係	名称
委託会社	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社

**(D) 管理報酬等**

委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等を信託財産から支払います。

**(E) 投資方針等**

## (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

わが国の株式を主要投資対象とし、ファンダメンタル・インデックス構成手法 を活用して、委託会社が独自に銘柄・ウエイトを選定・計算し、これをベースに株式ポートフォリオを構成することを基本とします。

当該手法は、株主資本、配当額、キャッシュフロー等のファンダメンタル指標をもとに銘柄のウエイト付けを行なう運用手法で、2020年5月末現在、リサーチ・アフィリエイツ社（Research Affiliates, LLC）が知的所有権を申請中です。

株式の組入比率は高位を基本とします。

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) 主な投資制限

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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合は、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。

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。

<sup>(R)</sup>「RAFI」は、Research Affiliates, LLCの登録商標であり、野村アセットマネジメント株式会社はその使用を許諾されております。リサーチ・アフィリエイツ社は、野村アセットマネジメントがファンドまたはアカウントの運用のために用いるRAFIインデックスの収益性、有効性に関して、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なうものではなく、いかなる責任も負わないことを明記します。

## 野村日経225 マザーファンド

## (A) ファンドの特色

日経平均株価に採用されているまたは採用が決定された銘柄を主要投資対象とし、日経平均株価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。

## (B) 信託期間

無期限（2013年11月28日設定）

## (C) ファンドの関係法人

関係	名称
委託会社	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社

## (D) 管理報酬等

委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等を信託財産から支払います。

## (E) 投資方針等

## (1) 投資対象

日経平均株価に採用されているまたは採用が決定された銘柄を主要投資対象とし、日経平均株価を対象とした株価指数先物取引を取引対象とします。

## (2) 投資態度

日経平均株価に採用されているまたは採用が決定された銘柄を主要投資対象とし、日経平均株価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。

効率的な運用を行なうため、日経平均株価を対象とした株価指数先物取引を活用し、また、わが国の金融商品取引所に上場している日経平均株価を対象指数とする上場投資信託証券（ETF）を活用する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 主な投資制限

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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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。

## 指数について

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

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。

日経平均株価(日経225)とは、日本経済新聞社が発表している株価指標で、東京証券取引所第一部上場銘柄のうち市場を代表する225銘柄を対象に算出されます。わが国の株式市場全体の動向を示す指標の1つです。

「日経平均」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」自体及び「日経平均」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有している。

「日経」及び「日経平均」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属している。

本件投資信託は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び本件受益権の取引に関して、一切の責任を負わない。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負わない。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有している。

### 指定投資信託証券の委託会社について

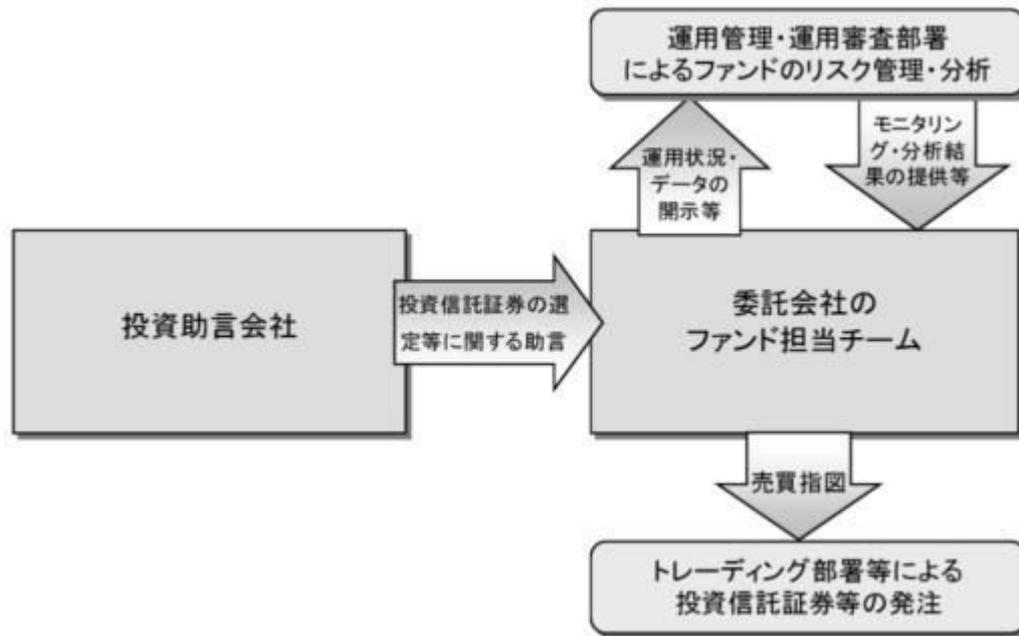
指定投資信託証券の委託会社の沿革は、以下の通りです。

#### 野村アセットマネジメント株式会社

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・マネジメント投資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

### (3)【運用体制】

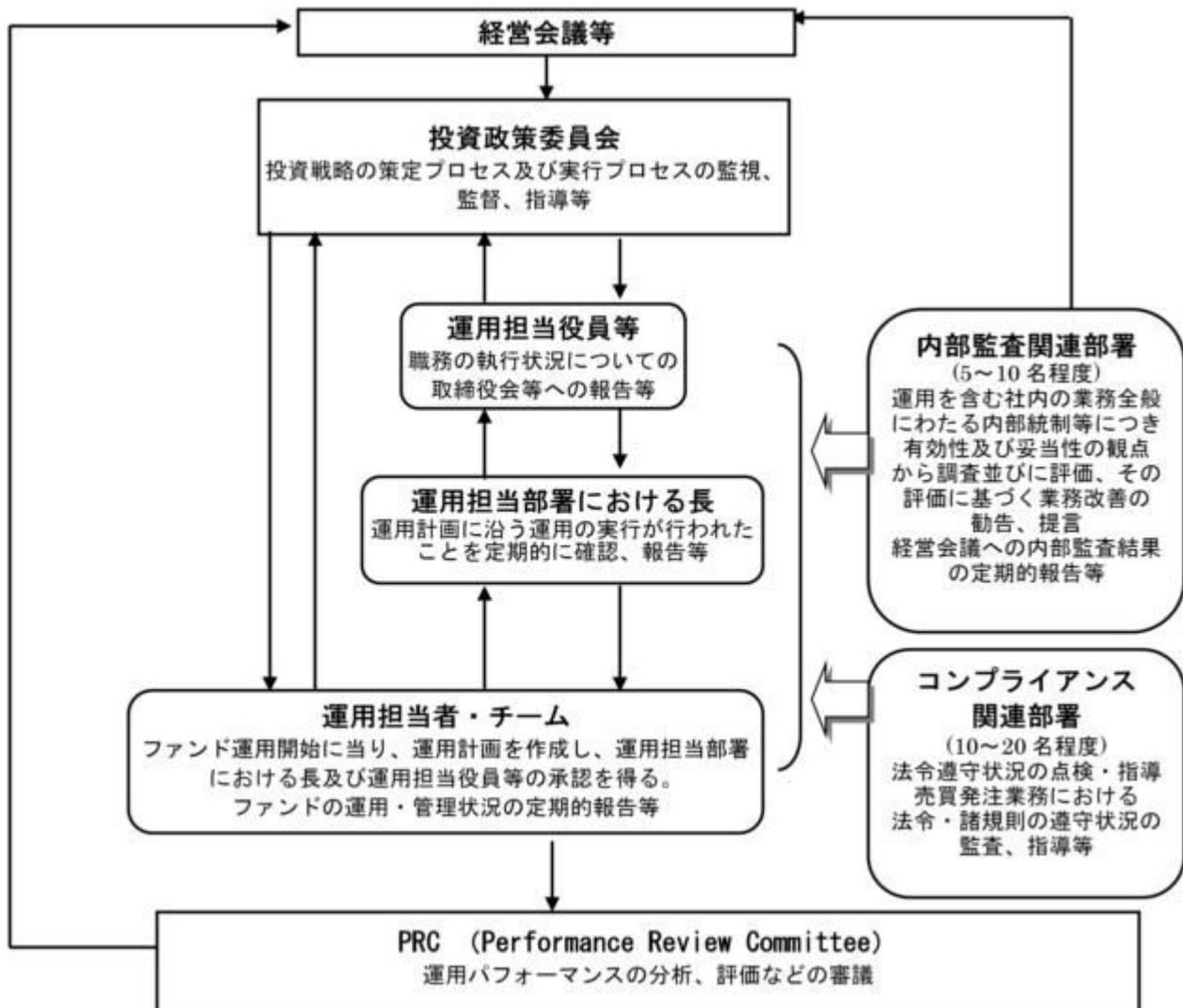
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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

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

す。



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

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

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

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

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

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

ファンドの決算日

原則として**毎年3月29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）

- ・ 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への直接投資は行ないません。
- ・ 株式への直接投資は行ないません。
- ・ デリバティブの直接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。）の実質的な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。

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。

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。

### 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、これらの影響を受けます。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

#### その他の留意点

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

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

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

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

ファンドのベンチマークは、市場の構造変化等によっては今後見直す場合があります。また、ベンチマークに対して一定の投資成果をあげることを保証するものではありません。

ファンドおよびファンドが投資する投資信託証券が投資対象とする各マザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

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

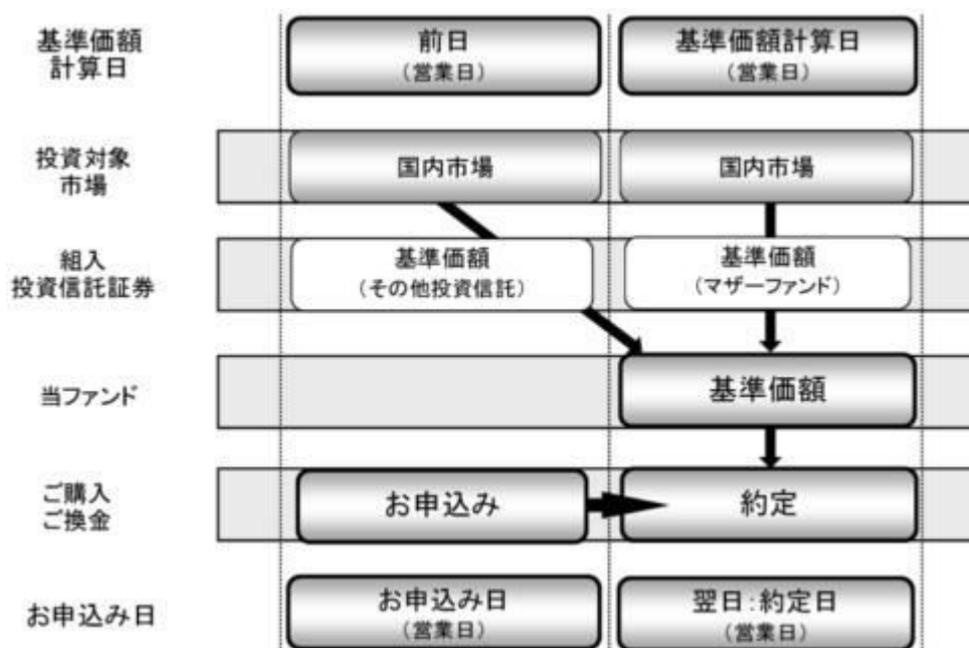
投資者の個別元本（追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本）の状況によっては、分配金額の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。

分配金は、預貯金の利息とは異なりファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後の純資産はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中に運用収益が

あった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行なった場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

ファンドの基準価額は、組入投資信託証券の基準価額をもって毎営業日計算されますが、組入投資信託証券によっていつの基準価額を採用するかは異なります。組入投資信託証券がいわゆるマザーファンドの場合は当日の基準価額となりますが、原則として、その他の投資信託証券の場合は前営業日となります。したがって、ファンドの基準価額において、投資対象資産等の値動きは、下図の通り一般的な投資信託における場合と比較して1営業日遅れて反映される場合がありますので、ご注意ください。

<基準価額の算出イメージ図>



約定日の基準価額（約定価額）は、原則として、実質的にマザーファンドを通じて投資している部分はお申込み日翌日の国内市場を反映し、その他の投資信託証券を通じて投資している部分はお申込み日の国内市場を反映します。

## 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

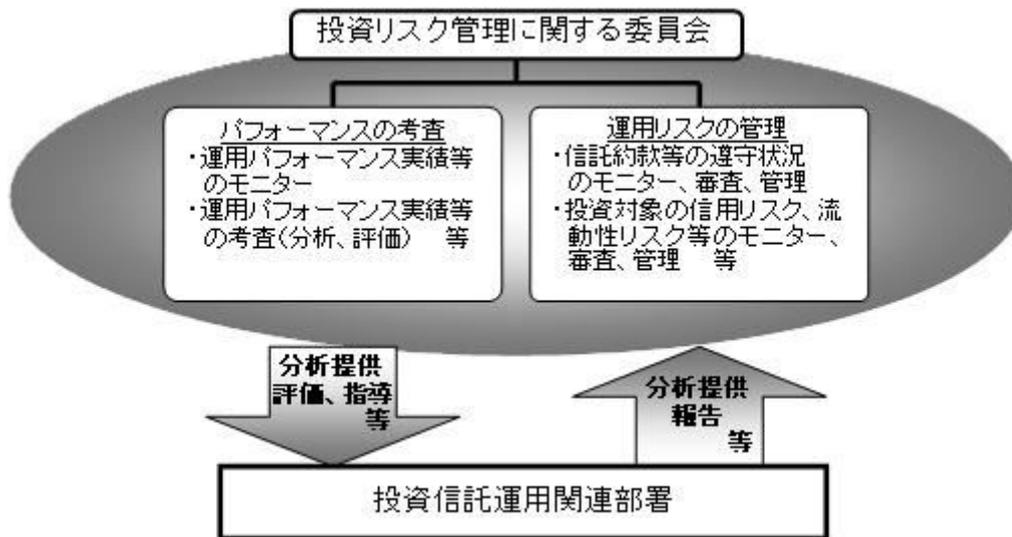
#### パフォーマンスの考査

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

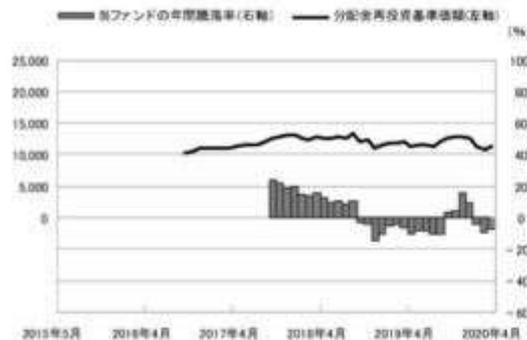


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

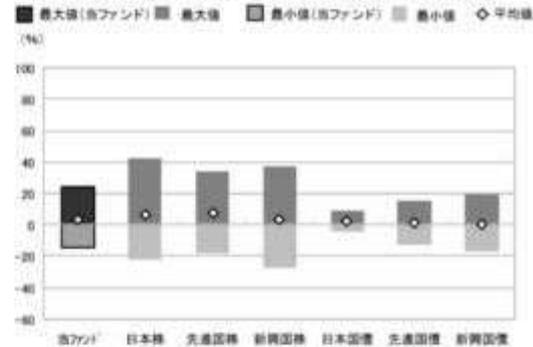
## リスクの定量的比較

(2015年5月末～2020年4月末:月次)

## 〈ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移〉



## 〈ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較〉



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	24.1	41.9	34.1	37.2	9.3	15.3	19.3
最小値(%)	△ 14.1	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値(%)	3.0	6.1	7.5	3.5	1.9	1.1	0.4

- 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- 年間騰落率は、2017年10月から2020年4月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 2015年5月から2020年4月の5年間(当ファンドは2017年10月から2020年4月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- 決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

## 〈代表的な資産クラスの指数〉

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

## ■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、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なく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社に帰属する知的財産権の正確性、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 L.L.C.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 L.L.C.の知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income L.L.C.が有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)」(ここでは「指数」とよびます)についてはここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスは法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社(以下、JPM)がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケティングを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または買主になっている可能性もあります。米国のJP Morgan Securities L.L.C.(ここでは「JPMS L.L.C.」と呼びます)「指数スポンサー」は、指数に関する証券、金融商品または取引(ここでは「プロダクト」と呼びます)についての奨励、保障または販売促進を行いません。証券成り又は金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMS L.L.C.はNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JP MorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPM, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

申込手数料はありません。

## （２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

## （３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年0.825%（税抜年0.75%）以内（2020年6月24日現在、年0.605%（税抜年0.55%））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0.47%	年0.05%	年0.03%

\* 上記配分は、2020年6月24日現在の信託報酬率における配分です。

ファンドが投資対象とする投資信託証券については、2020年6月24日現在、信託報酬は収受しておりませんので、ファンドにおける実質的な信託報酬も上記と同じです。

ファンドが指定投資信託証券を通じてETFに投資する場合は、上記の信託報酬に加え、投資するETFに関連する費用がかかります。

### 支払先の役務の内容

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

## （４）【その他の手数料等】

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

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

ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額はファンドから支払われます。

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

ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額 をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.3%以内（2020年6月24日現在0.2%）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、配当控除の適用があります。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

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

損益通算について

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

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

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

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

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。

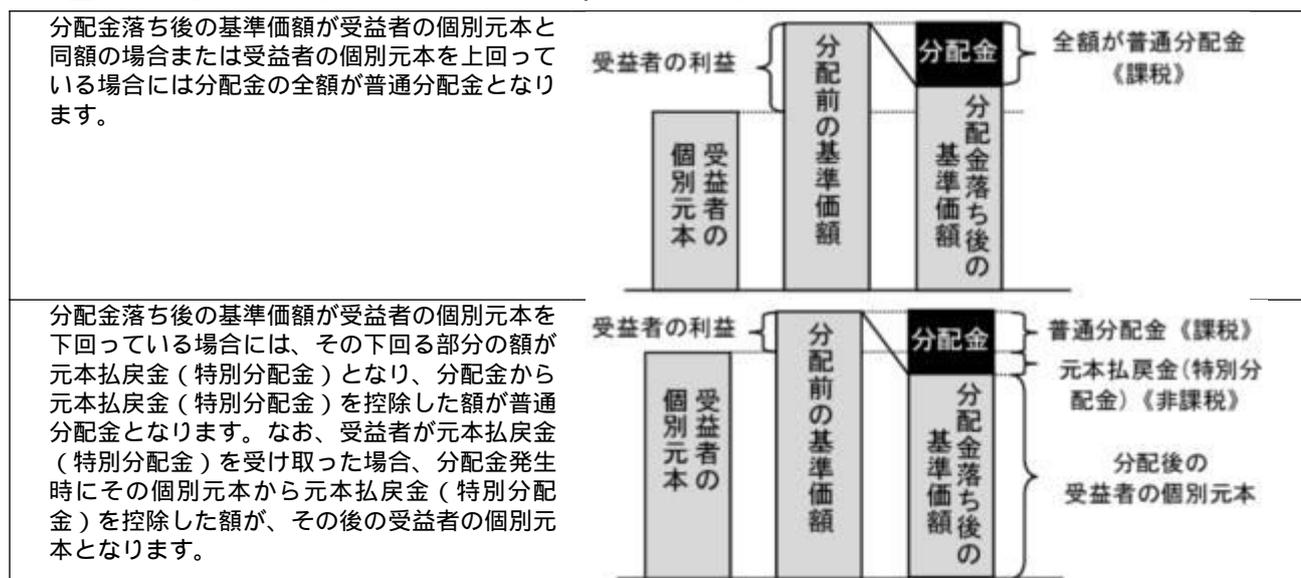
## 個別元本について

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4月末現在）が変更になる場合があります。

## 5【運用状況】

以下は2020年4月30日現在の運用状況であります。

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

## （１）【投資状況】

## ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式

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	3,253,827,567	99.62
現金・預金・その他資産（負債控除後）		12,342,345	0.37
合計（純資産総額）		3,266,169,912	100.00

## （参考）国内株式マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	406,761,825,500	97.70
現金・預金・その他資産（負債控除後）		9,564,679,259	2.29
合計（純資産総額）		416,326,504,759	100.00

## その他の資産の投資状況

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

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

## （参考）野村日本株IPストラテジー 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	24,382,513,590	98.19
現金・預金・その他資産（負債控除後）		447,127,469	1.80
合計（純資産総額）		24,829,641,059	100.00

## （参考）野村日本株最小分散ポートフォリオ 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	13,238,720,050	98.76
現金・預金・その他資産（負債控除後）		164,874,818	1.23
合計（純資産総額）		13,403,594,868	100.00

## （参考）野村RAFI（R）日本株投信マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	3,668,597,750	97.97
現金・預金・その他資産（負債控除後）		75,791,862	2.02
合計（純資産総額）		3,744,389,612	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	58,160,000	1.55

## （参考）野村日経225 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	13,453,845,120	94.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）		721,808,200	5.09
合計（純資産総額）		14,175,653,320	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	641,920,000	4.52

## （2）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式

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	野村日本株IPストラテジー マザーファンド	628,750,947	1.5263	959,675,839	1.5418	969,408,210	29.68
2	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	523,012,371	1.4679	767,744,510	1.4978	783,367,929	23.98
3	日本	親投資信託 受益証券	野村RAFI(R)日本株投信マ ザーファンド	536,486,055	1.2517	671,531,559	1.2609	676,455,266	20.71
4	日本	親投資信託 受益証券	野村日経225 マザーファンド	349,093,581	1.3755	480,195,593	1.4553	508,035,888	15.55
5	日本	親投資信託 受益証券	野村日本株最小分散ポートフォ リオ マザーファンド	253,410,402	1.2620	319,810,809	1.2492	316,560,274	9.69

## 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	99.62
合計	99.62

## (参考) 国内株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	2,205,300	6,631.97	14,625,483,441	6,666.00	14,700,529,800	3.53
2	日本	株式	ソニー	電気機器	1,238,100	5,562.42	6,886,832,202	6,932.00	8,582,509,200	2.06
3	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,538,800	5,300.12	8,155,824,656	4,633.00	7,129,260,400	1.71
4	日本	株式	キーエンス	電気機器	179,100	33,394.44	5,980,944,309	38,770.00	6,943,707,000	1.66
5	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,644,400	4,206.00	6,916,346,400	3,883.00	6,385,205,200	1.53
6	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,592,500	2,404.18	6,232,836,650	2,443.00	6,333,477,500	1.52
7	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	13,334,800	523.94	6,986,635,112	434.30	5,791,303,640	1.39
8	日本	株式	任天堂	その他製品	121,200	37,452.52	4,539,246,233	44,650.00	5,411,580,000	1.29
9	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	1,432,600	2,549.58	3,652,528,308	3,148.00	4,509,824,800	1.08
10	日本	株式	K D D I	情報・通信業	1,445,300	2,620.89	3,787,972,317	3,109.00	4,493,437,700	1.07
11	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,352,900	3,314.12	4,483,672,948	3,182.00	4,304,927,800	1.03
12	日本	株式	第一三共	医薬品	565,600	5,735.87	3,244,208,072	7,382.00	4,175,259,200	1.00
13	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,556,200	2,821.43	4,390,709,366	2,610.50	4,062,460,100	0.97
14	日本	株式	信越化学工業	化学	332,400	9,791.27	3,254,618,148	12,015.00	3,993,786,000	0.95
15	日本	株式	花王	化学	473,200	8,381.86	3,966,296,152	8,316.00	3,935,131,200	0.94
16	日本	株式	H O Y A	精密機器	394,700	7,946.74	3,136,578,278	9,866.00	3,894,110,200	0.93
17	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,348,200	3,829.12	5,162,419,584	2,844.00	3,834,280,800	0.92
18	日本	株式	ダイキン工業	機械	251,800	13,701.68	3,450,083,024	14,005.00	3,526,459,000	0.84
19	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	689,200	5,493.32	3,785,996,144	5,086.00	3,505,271,200	0.84
20	日本	株式	村田製作所	電気機器	580,600	5,075.67	2,946,934,002	6,019.00	3,494,631,400	0.83
21	日本	株式	ファナック	電気機器	187,800	19,129.24	3,592,471,272	17,830.00	3,348,474,000	0.80
22	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	26,488,500	165.37	4,380,403,245	125.80	3,332,253,300	0.80
23	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,366,000	2,817.69	3,848,964,540	2,300.00	3,141,800,000	0.75
24	日本	株式	日立製作所	電気機器	949,700	3,745.31	3,556,920,907	3,241.00	3,077,977,700	0.73
25	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,713,700	1,475.67	2,528,855,679	1,786.50	3,061,525,050	0.73
26	日本	株式	S M C	機械	62,000	42,138.54	2,612,590,011	49,000.00	3,038,000,000	0.72
27	日本	株式	日本電産	電気機器	475,700	7,362.81	3,502,488,717	6,286.00	2,990,250,200	0.71
28	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,361,500	2,007.57	2,733,306,555	2,125.00	2,893,187,500	0.69
29	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	125,400	17,339.68	2,174,396,916	22,940.00	2,876,676,000	0.69
30	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	164,300	21,918.61	3,601,227,623	17,005.00	2,793,921,500	0.67

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.20
		建設業	2.58
		食料品	3.92
		繊維製品	0.50
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.23
		医薬品	6.48
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.62
		ガラス・土石製品	0.73
		鉄鋼	0.54
		非鉄金属	0.64
		金属製品	0.52
		機械	4.93
		電気機器	14.36
		輸送用機器	7.21
		精密機器	2.52
		その他製品	2.40
		電気・ガス業	1.62
		陸運業	4.19
		海運業	0.13
		空運業	0.34
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	9.57
		卸売業	4.55
		小売業	4.64
		銀行業	5.05
		証券、商品先物取引業	0.76
		保険業	2.14
その他金融業	1.06		
不動産業	2.12		
サービス業	5.02		
合 計			97.70

(参考) 野村日本株IPストラテジー 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	日本電信電話	情報・通信業	300,800	2,546.67	766,039,214	2,443.00	734,854,400	2.95
2	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	220,500	2,890.76	637,413,971	3,148.00	694,134,000	2.79
3	日本	株式	第一三共	医薬品	81,300	6,576.73	534,688,940	7,382.00	600,156,600	2.41
4	日本	株式	花王	化学	71,700	8,358.66	599,316,274	8,316.00	596,257,200	2.40
5	日本	株式	H O Y A	精密機器	56,200	8,720.55	490,094,956	9,866.00	554,469,200	2.23
6	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	287,200	1,623.15	466,169,626	1,786.50	513,082,800	2.06
7	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	157,700	3,377.91	532,696,910	3,182.00	501,801,400	2.02
8	日本	株式	日立製作所	電気機器	145,200	3,611.44	524,381,792	3,241.00	470,593,200	1.89
9	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	20,400	22,393.16	456,820,624	22,940.00	467,976,000	1.88
10	日本	株式	キヤノン	電気機器	179,900	2,733.58	491,772,109	2,284.50	410,981,550	1.65
11	日本	株式	キリンホールディングス	食料品	194,000	2,198.13	426,438,812	2,078.50	403,229,000	1.62
12	日本	株式	富士通	電気機器	36,900	8,783.26	324,102,579	10,535.00	388,741,500	1.56
13	日本	株式	資生堂	化学	56,700	7,450.45	422,440,861	6,378.00	361,632,600	1.45
14	日本	株式	三菱電機	電気機器	265,300	1,359.13	360,578,039	1,340.50	355,634,650	1.43
15	日本	株式	オリンパス	精密機器	205,400	1,370.67	281,536,628	1,725.50	354,417,700	1.42
16	日本	株式	パナソニック	電気機器	428,300	878.09	376,089,080	826.80	354,118,440	1.42
17	日本	株式	エーザイ	医薬品	46,200	6,878.07	317,766,934	7,530.00	347,886,000	1.40
18	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	101,300	3,843.03	389,299,842	3,378.00	342,191,400	1.37
19	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	88,400	3,713.76	328,297,150	3,553.00	314,085,200	1.26
20	日本	株式	ダイキン工業	機械	21,800	13,687.61	298,389,994	14,005.00	305,309,000	1.22
21	日本	株式	オムロン	電気機器	45,900	5,461.60	250,687,460	6,360.00	291,924,000	1.17
22	日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	55,600	5,144.62	286,041,271	5,139.00	285,728,400	1.15
23	日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	65,500	3,999.16	261,945,078	4,255.00	278,702,500	1.12
24	日本	株式	塩野義製薬	医薬品	44,100	5,848.31	257,910,658	5,929.00	261,468,900	1.05
25	日本	株式	日本電気	電気機器	56,300	4,169.22	234,727,398	4,165.00	234,489,500	0.94
26	日本	株式	ユニ・チャーム	化学	59,200	3,477.73	205,881,946	3,950.00	233,840,000	0.94
27	日本	株式	バンダイナムコホールディングス	その他製品	35,500	5,541.74	196,732,117	5,431.00	192,800,500	0.77
28	日本	株式	スズキ	輸送用機器	53,600	3,962.32	212,380,478	3,469.00	185,938,400	0.74
29	日本	株式	アドバンテスト	電気機器	35,000	4,102.91	143,601,948	5,270.00	184,450,000	0.74
30	日本	株式	キッコーマン	食料品	37,000	4,795.20	177,422,635	4,980.00	184,260,000	0.74

## 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	0.16
		建設業	0.55
		食料品	9.63
		繊維製品	0.84
		化学	11.18
		医薬品	10.67
		ゴム製品	1.71

	ガラス・土石製品	0.78
	非鉄金属	0.01
	金属製品	0.45
	機械	3.42
	電気機器	19.83
	輸送用機器	1.55
	精密機器	5.05
	その他製品	2.54
	電気・ガス業	0.67
	陸運業	0.06
	情報・通信業	9.54
	卸売業	1.82
	小売業	12.26
	銀行業	0.02
	証券、商品先物取引業	0.21
	保険業	0.27
	その他金融業	0.23
	不動産業	0.03
	サービス業	4.58
合 計		98.19

## (参考) 野村日本株最小分散ポートフォリオ 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	日本電信電話	情報・通信業	143,500	2,662.50	382,069,273	2,443.00	350,570,500	2.61
2	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	91,000	3,201.29	291,317,766	3,148.00	286,468,000	2.13
3	日本	株式	K D D I	情報・通信業	91,000	3,269.28	297,504,726	3,109.00	282,919,000	2.11
4	日本	株式	キヤノン	電気機器	98,900	2,485.00	245,766,767	2,284.50	225,937,050	1.68
5	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	62,700	3,882.87	243,456,217	3,553.00	222,773,100	1.66
6	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	151,400	1,452.70	219,938,903	1,464.00	221,649,600	1.65
7	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	16,200	14,253.86	230,912,685	13,680.00	221,616,000	1.65
8	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	119,800	1,812.50	217,138,095	1,786.50	214,022,700	1.59
9	日本	株式	中外製薬	医薬品	16,700	12,316.55	205,686,471	12,810.00	213,927,000	1.59
10	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	105,000	2,137.54	224,442,100	2,014.50	211,522,500	1.57
11	日本	株式	セコム	サービス業	21,300	9,321.59	198,550,069	9,005.00	191,806,500	1.43
12	日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	44,000	4,479.73	197,108,176	4,255.00	187,220,000	1.39
13	日本	株式	三井物産	卸売業	118,600	1,705.15	202,231,031	1,514.00	179,560,400	1.33
14	日本	株式	ニトリホールディングス	小売業	10,500	16,352.19	171,698,058	16,520.00	173,460,000	1.29

15	日本	株式	オービック	情報・通信業	10,600	14,863.90	157,557,413	16,220.00	171,932,000	1.28
16	日本	株式	近鉄グループホールディングス	陸運業	32,200	5,188.38	167,066,001	5,160.00	166,152,000	1.23
17	日本	株式	パン・パシフィック・インターナショナルホ	小売業	79,000	2,002.85	158,225,204	2,082.00	164,478,000	1.22
18	日本	株式	東京瓦斯	電気・ガス業	69,300	2,454.16	170,073,946	2,358.00	163,409,400	1.21
19	日本	株式	第一三共	医薬品	22,100	7,348.57	162,403,514	7,382.00	163,142,200	1.21
20	日本	株式	積水ハウス	建設業	85,800	2,111.19	181,140,734	1,858.50	159,459,300	1.18
21	日本	株式	大東建託	建設業	15,200	11,393.68	173,183,963	10,315.00	156,788,000	1.16
22	日本	株式	東武鉄道	陸運業	42,400	3,602.91	152,763,783	3,665.00	155,396,000	1.15
23	日本	株式	大阪瓦斯	電気・ガス業	77,400	1,938.45	150,036,108	1,999.00	154,722,600	1.15
24	日本	株式	日清食品ホールディングス	食料品	17,400	8,915.87	155,136,292	8,840.00	153,816,000	1.14
25	日本	株式	京王電鉄	陸運業	25,100	6,070.11	152,359,850	6,100.00	153,110,000	1.14
26	日本	株式	サントリー食品インターナショナル	食料品	37,000	4,283.66	158,495,453	4,055.00	150,035,000	1.11
27	日本	株式	ツルハホールディングス	小売業	10,400	13,725.07	142,740,768	14,380.00	149,552,000	1.11
28	日本	株式	アズビル	電気機器	52,400	2,841.27	148,882,628	2,844.00	149,025,600	1.11
29	日本	株式	名古屋鉄道	陸運業	47,900	3,113.34	149,129,395	3,095.00	148,250,500	1.10
30	日本	株式	小田急電鉄	陸運業	62,000	2,357.07	146,138,598	2,373.00	147,126,000	1.09

## 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	0.29
		建設業	7.38
		食料品	13.90
		繊維製品	0.60
		化学	2.46
		医薬品	10.67
		機械	0.53
		電気機器	4.25
		精密機器	1.00
		電気・ガス業	3.53
		陸運業	14.32
		情報・通信業	14.41
		卸売業	4.02
		小売業	14.34
サービス業	6.97		
合計			98.76

(参考) 野村 R A F I ( R ) 日本株投信マザーファンド

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	30,200	7,145.20	215,785,040	6,666.00	201,313,200	5.37
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	229,000	524.47	120,105,631	434.30	99,454,700	2.65
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	37,500	2,599.94	97,497,910	2,443.00	91,612,500	2.44
4	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	26,000	3,684.20	95,789,350	2,844.00	73,944,000	1.97
5	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	25,300	2,852.61	72,171,264	2,610.50	66,045,650	1.76
6	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	14,100	4,214.40	59,423,040	4,633.00	65,325,300	1.74
7	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	20,500	2,655.22	54,432,010	3,148.00	64,534,000	1.72
8	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	457,900	157.84	72,276,776	125.80	57,603,820	1.53
9	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	142,900	663.26	94,781,165	369.80	52,844,420	1.41
10	日本	株式	K D D I	情報・通信業	15,700	2,912.16	45,720,912	3,109.00	48,811,300	1.30
11	日本	株式	三菱商事	卸売業	17,600	2,909.61	51,209,136	2,300.00	40,480,000	1.08
12	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	19,700	2,467.68	48,613,296	2,014.50	39,685,650	1.05
13	日本	株式	ソニー	電気機器	5,100	5,973.28	30,463,728	6,932.00	35,353,200	0.94
14	日本	株式	三井物産	卸売業	21,700	1,791.35	38,872,467	1,514.00	32,853,800	0.87
15	日本	株式	キヤノン	電気機器	14,100	3,048.04	42,977,406	2,284.50	32,211,450	0.86
16	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	21,400	1,440.36	30,823,704	1,464.00	31,329,600	0.83
17	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	8,000	3,804.40	30,435,207	3,883.00	31,064,000	0.82
18	日本	株式	デンソー	輸送用機器	7,900	4,678.44	36,959,700	3,812.00	30,114,800	0.80
19	日本	株式	東京電力ホールディングス	電気・ガス業	82,300	522.43	42,995,989	363.00	29,874,900	0.79
20	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	5,600	5,694.48	31,889,088	5,086.00	28,481,600	0.76
21	日本	株式	日立製作所	電気機器	8,400	3,730.37	31,335,108	3,241.00	27,224,400	0.72
22	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	12,600	2,156.38	27,170,388	2,125.00	26,775,000	0.71
23	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	7,800	4,268.22	33,292,128	3,378.00	26,348,400	0.70
24	日本	株式	日本製鉄	鉄鋼	27,200	1,415.31	38,496,697	911.90	24,803,680	0.66
25	日本	株式	オリックス	その他金融業	19,000	1,594.52	30,296,040	1,289.00	24,491,000	0.65
26	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	3,100	10,087.03	31,269,793	7,873.00	24,406,300	0.65
27	日本	株式	S U B A R U	輸送用機器	11,000	2,671.64	29,388,112	2,175.00	23,925,000	0.63
28	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	1,400	21,770.00	30,478,000	17,005.00	23,807,000	0.63
29	日本	株式	ファナック	電気機器	1,300	17,993.07	23,390,996	17,830.00	23,179,000	0.61
30	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	6,500	3,861.22	25,097,930	3,553.00	23,094,500	0.61

## 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	0.42
		建設業	2.74

食料品	3.51
繊維製品	0.50
パルプ・紙	0.38
化学	5.67
医薬品	3.68
石油・石炭製品	0.73
ゴム製品	1.00
ガラス・土石製品	0.74
鉄鋼	1.44
非鉄金属	0.81
金属製品	0.58
機械	3.91
電気機器	9.61
輸送用機器	13.16
精密機器	0.89
その他製品	1.16
電気・ガス業	3.17
陸運業	3.39
海運業	0.18
空運業	0.50
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	10.72
卸売業	5.45
小売業	3.91
銀行業	10.22
証券、商品先物取引業	0.76
保険業	2.58
その他金融業	1.57
不動産業	1.60
サービス業	2.56
合 計	97.97

## (参考) 野村日経225 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	ファーストリテイリング	小売業	24,000	66,660.00	1,599,840,000	51,500.00	1,236,000,000	8.71
2	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	144,000	4,268.00	614,592,000	4,633.00	667,152,000	4.70
3	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	24,000	22,645.00	543,480,000	22,940.00	550,560,000	3.88
4	日本	株式	KDDI	情報・通信業	144,000	3,178.00	457,632,000	3,109.00	447,696,000	3.15
5	日本	株式	ファナック	電気機器	24,000	20,825.00	499,800,000	17,830.00	427,920,000	3.01

6	日本	株式	テルモ	精密機器	96,000	3,864.00	370,944,000	3,572.00	342,912,000	2.41
7	日本	株式	ダイキン工業	機械	24,000	15,815.00	379,560,000	14,005.00	336,120,000	2.37
8	日本	株式	中外製薬	医薬品	24,000	9,612.00	230,688,000	12,810.00	307,440,000	2.16
9	日本	株式	信越化学工業	化学	24,000	11,815.00	283,560,000	12,015.00	288,360,000	2.03
10	日本	株式	京セラ	電気機器	48,000	7,427.00	356,496,000	5,779.00	277,392,000	1.95
11	日本	株式	アドバンテスト	電気機器	48,000	5,350.00	256,800,000	5,270.00	252,960,000	1.78
12	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	72,000	4,023.00	289,656,000	3,182.00	229,104,000	1.61
13	日本	株式	TDK	電気機器	24,000	11,690.00	280,560,000	9,380.00	225,120,000	1.58
14	日本	株式	エムスリー	サービス業	57,600	3,020.00	173,952,000	3,890.00	224,064,000	1.58
15	日本	株式	セコム	サービス業	24,000	9,450.00	226,800,000	9,005.00	216,120,000	1.52
16	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	120,000	1,878.00	225,360,000	1,786.50	214,380,000	1.51
17	日本	株式	花王	化学	24,000	8,613.00	206,712,000	8,316.00	199,584,000	1.40
18	日本	株式	エーザイ	医薬品	24,000	8,074.00	193,776,000	7,530.00	180,720,000	1.27
19	日本	株式	第一三共	医薬品	24,000	6,945.00	166,680,000	7,382.00	177,168,000	1.24
20	日本	株式	ファミリーマート	小売業	96,000	2,605.00	250,080,000	1,833.00	175,968,000	1.24
21	日本	株式	ソニー	電気機器	24,000	6,897.00	165,528,000	6,932.00	166,368,000	1.17
22	日本	株式	オリンパス	精密機器	96,000	1,655.00	158,880,000	1,725.50	165,648,000	1.16
23	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	24,000	7,724.00	185,376,000	6,666.00	159,984,000	1.12
24	日本	株式	資生堂	化学	24,000	7,882.00	189,168,000	6,378.00	153,072,000	1.07
25	日本	株式	オムロン	電気機器	24,000	6,420.00	154,080,000	6,360.00	152,640,000	1.07
26	日本	株式	塩野義製薬	医薬品	24,000	6,499.00	155,976,000	5,929.00	142,296,000	1.00
27	日本	株式	エヌ・ティ・ティ・データ	情報・通信業	120,000	1,496.00	179,520,000	1,105.00	132,600,000	0.93
28	日本	株式	トレンドマイクロ	情報・通信業	24,000	5,990.00	143,760,000	5,470.00	131,280,000	0.92
29	日本	株式	バンダイナムコホールディングス	その他製品	24,000	6,784.00	162,816,000	5,431.00	130,344,000	0.91
30	日本	株式	日東電工	化学	24,000	6,220.00	149,280,000	5,410.00	129,840,000	0.91

## 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	0.11
		鉱業	0.04
		建設業	2.02
		食料品	3.79
		繊維製品	0.16
		パルプ・紙	0.11
		化学	8.07
		医薬品	9.26
		石油・石炭製品	0.23
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.98
		鉄鋼	0.06
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.21

	機械	4.26
	電気機器	19.01
	輸送用機器	4.15
	精密機器	3.82
	その他製品	1.99
	電気・ガス業	0.19
	陸運業	1.88
	海運業	0.07
	空運業	0.03
	倉庫・運輸関連業	0.20
	情報・通信業	10.61
	卸売業	1.74
	小売業	11.49
	銀行業	0.56
	証券、商品先物取引業	0.28
	保険業	0.86
	その他金融業	0.20
	不動産業	1.32
	サービス業	5.62
合 計		94.90

#### 【投資不動産物件】

ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式

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）野村日本株IPストラテジー マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）野村RAFI（R）日本株投信マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）野村日経225 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】

ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

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

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

（参考）野村日本株 I P ストラテジー マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）野村 R A F I ( R ) 日本株投信マザーファンド

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2020年06月限)	買建	4	日本円	56,843,680	58,160,000	1.55

（参考）野村日経 2 2 5 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	日経平均株価先物(2020年06月 限)	買建	32	日本円	624,935,840	641,920,000	4.52

（ 3 ） 【運用実績】

【純資産の推移】

ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式

2020年4月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2017年 3月29日)	152	152	1.1169	1.1169
第2計算期間 (2018年 3月29日)	780	780	1.2338	1.2343
第3計算期間 (2019年 3月29日)	2,054	2,055	1.1882	1.1887
第4計算期間 (2020年 3月30日)	3,543	3,545	1.0996	1.1001
2019年 4月末日	2,131		1.2001	
5月末日	2,145		1.1283	
6月末日	2,357		1.1530	
7月末日	2,309		1.1626	
8月末日	2,427		1.1287	
9月末日	2,692		1.1923	
10月末日	2,877		1.2515	
11月末日	3,062		1.2761	
12月末日	3,283		1.2917	
2020年 1月末日	3,296		1.2661	
2月末日	3,083		1.1370	
3月末日	3,467		1.0761	
4月末日	3,266		1.1180	

### 【分配の推移】

ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年10月20日～2017年 3月29日	0.0000円
第2計算期間	2017年 3月30日～2018年 3月29日	0.0005円
第3計算期間	2018年 3月30日～2019年 3月29日	0.0005円
第4計算期間	2019年 3月30日～2020年 3月30日	0.0005円

### 【収益率の推移】

ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年10月20日～2017年 3月29日	11.7%
第2計算期間	2017年 3月30日～2018年 3月29日	10.5%
第3計算期間	2018年 3月30日～2019年 3月29日	3.7%
第4計算期間	2019年 3月30日～2020年 3月30日	7.4%

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】

##### ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式

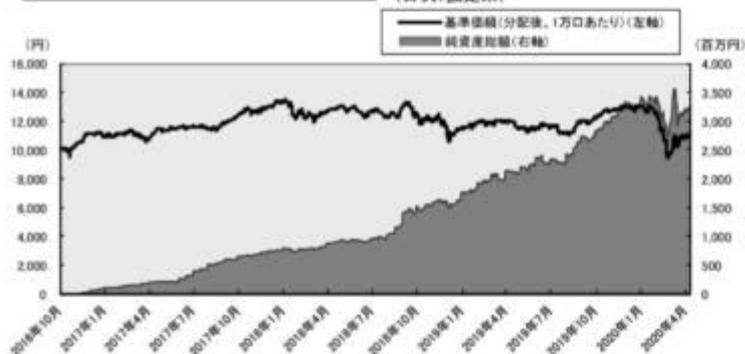
	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年10月20日～2017年 3月29日	138,826,300	2,578,150	136,248,150
第2計算期間	2017年 3月30日～2018年 3月29日	686,095,423	190,073,566	632,270,007
第3計算期間	2018年 3月30日～2019年 3月29日	1,313,737,346	216,746,322	1,729,261,031
第4計算期間	2019年 3月30日～2020年 3月30日	2,361,623,280	868,209,588	3,222,674,723

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### 参考情報

**運用実績**（2020年4月30日現在）**基準価額・純資産の推移**

（日次：設定来）

**分配の推移**

（1万口あたり、課税前）

2020年3月	5 円
2019年3月	5 円
2018年3月	5 円
2017年3月	0 円
—	—
設定来累計	15 円

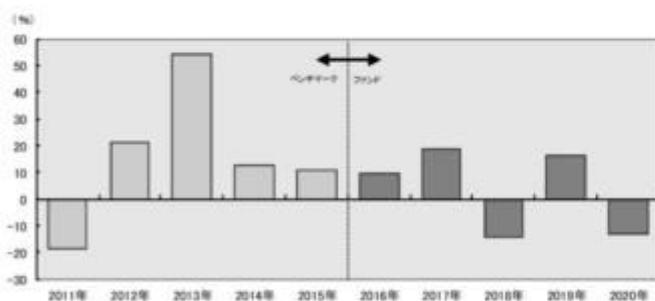
**主要な資産の状況**

## 銘柄別投資比率

順位	銘柄	投資比率 (%)
1	野村日本株IPストラテジー マザーファンド	29.7
2	国内株式マザーファンド	24.0
3	野村RAFI <sup>®</sup> 日本株投信マザーファンド	20.7
4	野村日経225 マザーファンド	15.6
5	野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド	9.7

**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2015年はベンチマークの年間収益率。
- ・2016年は設定日（2016年10月20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。●ベンチマーク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】**

- ・ファンドは、投資一任口座の資金を運用するためのファンドです。ファンドの買付けの申込みを行なう投資家は、投資一任口座を開設した者等に限るものとします。  
当該契約については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約を使用することがあります。
- ・申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。
- ・取得申込の受付については、午後3時まで取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。

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

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

- ・販売の単位は、1円以上1円単位(当初元本1口=1円)とします。
- ・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号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。)等における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取り消す場合があります。

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

## 2【換金(解約)手続等】

- ・受益者は、委託者に1口単位で一部解約の実行を請求することができます。
- ・受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
- ・一部解約の実行の請求の受付については、午後3時まで、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込み分とします。
- ・換金価額は、換金のお申込み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6営業日目から販売会社において支払います。
- ・金融商品取引所等における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### < 基準価額の計算方法 >

基準価額とは、計算日において、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当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
投資信託証券	原則として、基準価額計算日の前営業日の基準価額で評価します。
上場投資信託証券 (ETF)	原則として、基準価額計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

マザーファンド受益証券については、原則として基準価額計算日とします。

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(2016年10月20日設定)。

## (4)【計算期間】

原則として、毎年3月30日から翌年3月29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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ( )上記( )の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ( )上記( )の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- ( )上記( )から( )までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記( )から( )までに規定するこの信託契約の解約の手続を行なうことが困難な場合には適用しません。
- ( )委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託

契約を解約し信託を終了させます。

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

(c) 運用報告書

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

(d) 信託約款の変更等

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

- ( ) 委託者は、上記( )の事項（上記( )の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

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

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

- ( ) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

- ( ) 上記( )から( )までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

- ( ) 上記( )から( )の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

- ( ) 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、

裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、上記「(d)信託約款の変更等」にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行なう場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

( )委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(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

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、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4期計算期間(2019年3月30日から2020年3月30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】

## 【ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 (2019年 3月29日現在)	第4期 (2020年 3月30日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	16,209,147	32,293,429
親投資信託受益証券	2,049,965,164	3,525,335,290
流動資産合計	2,066,174,311	3,557,628,719
資産合計	2,066,174,311	3,557,628,719
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	864,630	1,611,337
未払解約金	5,683,461	2,903,031
未払受託者報酬	265,142	510,899
未払委託者報酬	4,595,730	8,855,594
未払利息	32	28
その他未払費用	26,446	51,031
流動負債合計	11,435,441	13,931,920
負債合計	11,435,441	13,931,920
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,729,261,031	3,222,674,723
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	325,477,839	321,022,076
（分配準備積立金）	46,224,872	76,257,566
元本等合計	2,054,738,870	3,543,696,799
純資産合計	2,054,738,870	3,543,696,799
負債純資産合計	2,066,174,311	3,557,628,719

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自 2018年 3月30日 至 2019年 3月29日		自 2019年 3月30日 至 2020年 3月30日	
営業収益				
有価証券売買等損益		64,890,515		196,166,299
営業収益合計		64,890,515		196,166,299
営業費用				
支払利息		8,377		16,473
受託者報酬		425,249		884,184
委託者報酬		7,370,857		15,325,785
その他費用		42,394		88,300
営業費用合計		7,846,877		16,314,742
営業利益又は営業損失（ ）		72,737,392		212,481,041
経常利益又は経常損失（ ）		72,737,392		212,481,041
当期純利益又は当期純損失（ ）		72,737,392		212,481,041
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（ ）		1,533,574		13,956,795
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		147,795,690		325,477,839
剰余金増加額又は欠損金減少額		302,134,745		384,242,881
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		302,134,745		384,242,881
剰余金減少額又は欠損金増加額		52,384,148		160,649,471
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		52,384,148		160,649,471
分配金		864,630		1,611,337
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		325,477,839		321,022,076

## (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3月30日から2020年3月30日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年3月29日現在	第4期 2020年3月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,729,261,031口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 3,222,674,723口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.1882円 (10,000口当たり純資産額) (11,882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 1.0996円 (10,000口当たり純資産額) (10,996円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年 3月30日 至 2019年 3月29日	第4期 自 2019年 3月30日 至 2020年 3月30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>26,870,861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>279,252,967円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>20,218,641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>326,342,469円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,729,261,031口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>1,887円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>864,630円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	26,870,861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	279,252,967円	分配準備積立金額	D	20,218,641円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	326,342,469円	当ファンドの期末残存口数	F	1,729,261,031口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,887円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	864,630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>46,748,607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>244,764,510円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>31,120,296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>322,633,413円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,222,674,723口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>1,001円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>1,611,337円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	46,748,607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	244,764,510円	分配準備積立金額	D	31,120,296円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	322,633,413円	当ファンドの期末残存口数	F	3,222,674,723口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,001円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	1,611,337円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	26,870,861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	279,252,967円																																																											
分配準備積立金額	D	20,218,641円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	326,342,469円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,729,261,031口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,887円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	864,630円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	46,748,607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	244,764,510円																																																											
分配準備積立金額	D	31,120,296円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	322,633,413円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,222,674,723口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,001円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	1,611,337円																																																											

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

<p style="text-align: center;">第3期 自 2018年 3月30日 至 2019年 3月29日</p>	<p style="text-align: center;">第4期 自 2019年 3月30日 至 2020年 3月30日</p>
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p style="padding-left: 2em;">市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p style="padding-left: 2em;">信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p style="padding-left: 2em;">流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

<p style="text-align: center;">第3期 2019年 3月29日現在</p>	<p style="text-align: center;">第4期 2020年 3月30日現在</p>
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2018年 3月30日 至 2019年 3月29日	第4期 自 2019年 3月30日 至 2020年 3月30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3期 自 2018年 3月30日 至 2019年 3月29日	第4期 自 2019年 3月30日 至 2020年 3月30日
期首元本額 632,270,007円	期首元本額 1,729,261,031円
期中追加設定元本額 1,313,737,346円	期中追加設定元本額 2,361,623,280円
期中一部解約元本額 216,746,322円	期中一部解約元本額 868,209,588円

2 有価証券関係  
売買目的有価証券

種類	第3期 自 2018年 3月30日 至 2019年 3月29日	第4期 自 2019年 3月30日 至 2020年 3月30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	60,557,203	205,282,466
合計	60,557,203	205,282,466

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2020年3月30日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2020年3月30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	576,920,769	846,977,380	
		野村 R A F I ( R ) 日本株投信マザーファンド	588,657,936	737,176,333	
		野村日経 2 2 5 マザーファンド	371,116,692	510,211,228	
		野村日本株 I P ストラテジー マザーファンド	698,478,475	1,066,227,392	
		野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド	288,905,313	364,742,957	
	小計	銘柄数 : 5 組入時価比率 : 99.5%	2,524,079,185	3,525,335,290	100.0%
合計			3,525,335,290		

(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」、「野村日本株 I P ストラテジー マザーファンド」、「野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド」、「野村 R A F I ( R ) 日本株投信マザーファンド」および「野村日経 2 2 5 マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内株式マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(2020年 3月30日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	49,668,711,290
株式	395,375,350,680
派生商品評価勘定	277,288,404
未収入金	274,355,552
未収配当金	5,104,587,792
未収利息	2,357,274
その他未収収益	23,983,025
差入委託証拠金	398,332,696

(2020年 3月30日現在)

流動資産合計	451,124,966,713
資産合計	451,124,966,713
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	281,046,110
未払金	275,839,429
未払解約金	747,680,704
未払利息	43,613
有価証券貸借取引受入金	37,711,945,027
流動負債合計	39,016,554,883
負債合計	39,016,554,883
純資産の部	
元本等	
元本	280,713,005,343
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	131,395,406,487
元本等合計	412,108,411,830
純資産合計	412,108,411,830
負債純資産合計	451,124,966,713

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2.費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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 3月30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	1,4681円
(10,000口当たり純資産額)	(14,681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	
	37,374,788,000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 3月30日 至 2020年 3月30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 3月30日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式、新株予約権証券</p> <p>    (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>    デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>    これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており</p> <p>ます。</p>

## (その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 3月30日現在		
期首		2019年 3月30日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額		251,042,165,705円
同期中における追加設定元本額		75,687,395,773円
同期中における一部解約元本額		46,016,556,135円
期末元本額		280,713,005,343円
期末元本額の内訳*		
バランスセレクト30		178,625,645円
バランスセレクト50		403,590,894円
バランスセレクト70		501,910,546円
野村世界6資産分散投信(安定コース)		2,848,447,312円
野村世界6資産分散投信(分配コース)		3,751,411,538円
野村世界6資産分散投信(成長コース)		8,106,021,557円
野村資産設計ファンド2015		51,297,659円
野村資産設計ファンド2020		57,954,310円
野村資産設計ファンド2025		95,516,666円
野村資産設計ファンド2030		117,498,437円
野村資産設計ファンド2035		90,685,901円
野村資産設計ファンド2040		192,239,856円
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)		93,294,607,216円
のむらップ・ファンド(保守型)		3,340,349,497円
のむらップ・ファンド(普通型)		9,435,134,309円
のむらップ・ファンド(積極型)		2,420,340,745円
野村資産設計ファンド2045		28,651,695円
野村インデックスファンド・TOPIX		2,077,336,603円
マイ・ロード		4,576,376,784円
ネクストコア		6,897,993円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型		1,517,798,630円
野村TOPIXインデックス(野村SMA・EW向け)		3,467,876,146円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)		1,084,905,367円
野村資産設計ファンド2050		47,226,820円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型		15,473,449円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型		6,979,716円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型		5,605,359円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型		3,547,973円
のむらップ・ファンド(やや保守型)		331,144,444円
のむらップ・ファンド(やや積極型)		332,654,577円
インデックス・ブレンド(タイプ)		5,180,972円
インデックス・ブレンド(タイプ)		5,013,812円
インデックス・ブレンド(タイプ)		19,482,474円
インデックス・ブレンド(タイプ)		5,693,457円
インデックス・ブレンド(タイプ)		20,890,847円
野村6資産均等バランス		1,180,101,295円
世界6資産分散ファンド		123,850,911円
野村資産設計ファンド2060		15,582,392円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式		576,920,769円

グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	452,132,748円
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	330,580,794円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	700,070,044円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	794,731,729円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	4,885,870円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	10,540,086円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	1,330,050円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,252,211,666円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	15,065,834円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	134,965,736円
野村・国内株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	104,512,906円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	34,370,255円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	113,393,310円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	281,808,563円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	4,751,464,664円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	81,274,083円
ノムラ日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	229,097,175円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用)	3,444,053,456円
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	231,250,800円
野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)	848,059,661円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	69,354円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	7,162,546円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	29,674,772円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	39,044,925円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	135,512,405円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	10,715,841,412円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	26,403,617,855円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	28,109,972,967円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)	32,129,747,227円
マイバランスDC30	3,656,927,430円
マイバランスDC50	5,522,654,869円
マイバランスDC70	4,888,842,402円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,010,941,173円
野村DC運用戦略ファンド	100,305,935円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,671,185円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	885,784,488円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	680,063,547円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	514,104,340円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	6,531,361円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	3,520,720円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	42,636,116円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	8,707,120円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	6,585,481円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	6,652,689円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	261,133,103円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	192,918,004円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	88,376,351円

マイターゲット2060(確定拠出年金向け)

99,278,423円

野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060

2,103,140円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年3月30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	2,619.00	24,356,700	貸付有価証券 200株
		日本水産	265,800	517.00	137,418,600	貸付有価証券 200株
		マルハニチロ	38,400	2,329.00	89,433,600	
		カネコ種苗	8,000	1,350.00	10,800,000	
		サカタのタネ	31,700	3,365.00	106,670,500	貸付有価証券 15,000株
		ホクト	20,300	1,915.00	38,874,500	貸付有価証券 700株
		ホクリヨウ	4,100	616.00	2,525,600	
		住石ホールディングス	53,700	120.00	6,444,000	貸付有価証券 1,600株
		日鉄鉱業	6,100	4,525.00	27,602,500	
		三井松島ホールディングス	10,300	904.00	9,311,200	
		国際石油開発帝石	1,066,300	599.20	638,926,960	貸付有価証券 505,400株(7,800株)
		石油資源開発	34,700	1,789.00	62,078,300	貸付有価証券 16,300株
		K&Oエナジーグループ	12,900	1,487.00	19,182,300	貸付有価証券 6,100株
		ヒノキヤグループ	6,600	1,509.00	9,959,400	
		ショーボンドホールディングス	41,400	4,255.00	176,157,000	貸付有価証券 19,600株(1,300株)
ミライト・ホールディングス	79,000	1,375.00	108,625,000			

タマホーム	14,300	1,227.00	17,546,100	貸付有価証券 1,500株
サンヨーホームズ	2,300	637.00	1,465,100	貸付有価証券 1,000株
日本アクア	10,600	635.00	6,731,000	貸付有価証券 3,500株(100株)
ファーストコーポレーション	8,100	460.00	3,726,000	
ベステラ	4,600	933.00	4,291,800	貸付有価証券 2,100株(1,200株)
TATERU	54,800	111.00	6,082,800	貸付有価証券 12,100株(10,900株)
キャンディル	2,400	417.00	1,000,800	貸付有価証券 900株
スペースパリュールホールディングス	32,400	375.00	12,150,000	
ダイセキ環境ソリューション	5,100	829.00	4,227,900	
第一カッター興業	3,300	1,610.00	5,313,000	
明豊ファシリティワークス	6,400	469.00	3,001,600	貸付有価証券 200株
安藤・間	158,300	687.00	108,752,100	貸付有価証券 57,100株(11,400株)
東急建設	77,800	581.00	45,201,800	
コムシスホールディングス	94,200	2,807.00	264,419,400	貸付有価証券 600株
ピーアールホールディングス	28,900	501.00	14,478,900	貸付有価証券 600株
高松コンストラクショングループ	16,500	2,347.00	38,725,500	
東建コーポレーション	8,200	8,000.00	65,600,000	貸付有価証券 3,800株
ソネック	2,700	662.00	1,787,400	
ヤマウラ	11,500	817.00	9,395,500	貸付有価証券 5,300株
大成建設	204,700	3,355.00	686,768,500	
大林組	613,800	956.00	586,792,800	貸付有価証券 400株
清水建設	622,900	867.00	540,054,300	貸付有価証券 2,600株
飛鳥建設	17,600	1,015.00	17,864,000	貸付有価証券 500株

長谷工コーポレーション	237,600	1,203.00	285,832,800	
松井建設	24,200	730.00	17,666,000	貸付有価証券 200株
銭高組	2,700	3,245.00	8,761,500	
鹿島建設	481,900	1,155.00	556,594,500	
不動テトラ	16,000	1,283.00	20,528,000	
大末建設	7,100	771.00	5,474,100	
鉄建建設	13,300	2,360.00	31,388,000	
西松建設	47,300	2,080.00	98,384,000	
三井住友建設	148,300	492.00	72,963,600	
大豊建設	13,800	2,279.00	31,450,200	貸付有価証券 500株
前田建設工業	153,700	779.00	119,732,300	貸付有価証券 68,300株
佐田建設	13,200	325.00	4,290,000	
ナカノフドー建設	16,800	384.00	6,451,200	
奥村組	33,300	2,274.00	75,724,200	
東鉄工業	26,300	2,959.00	77,821,700	
イチケン	4,400	1,255.00	5,522,000	
富士ピー・エス	9,000	537.00	4,833,000	
浅沼組	6,900	3,790.00	26,151,000	
戸田建設	254,900	641.00	163,390,900	
熊谷組	28,400	2,481.00	70,460,400	貸付有価証券 300株
北野建設	3,700	2,623.00	9,705,100	
植木組	2,700	2,565.00	6,925,500	
矢作建設工業	27,100	812.00	22,005,200	
ピーエス三菱	20,200	526.00	10,625,200	
日本ハウスホールディングス	41,900	305.00	12,779,500	貸付有価証券 100株
大東建託	73,500	10,560.00	776,160,000	
新日本建設	26,100	864.00	22,550,400	
N I P P O	50,800	2,351.00	119,430,800	
東亜道路工業	3,800	3,065.00	11,647,000	
前田道路	54,200	2,036.00	110,351,200	貸付有価証券 14,800株
日本道路	5,900	6,880.00	40,592,000	
東亜建設工業	19,100	1,442.00	27,542,200	貸付有価証券

				3,200株(1,000株)
日本国土開発	44,800	539.00	24,147,200	貸付有価証券 5,500株
若築建設	11,000	1,263.00	13,893,000	
東洋建設	68,800	431.00	29,652,800	
五洋建設	243,300	583.00	141,843,900	
世紀東急工業	29,500	822.00	24,249,000	
福田組	7,100	4,600.00	32,660,000	貸付有価証券 3,300株
住友林業	155,500	1,442.00	224,231,000	貸付有価証券 4,500株
日本基礎技術	20,600	381.00	7,848,600	
巴コーポレーション	27,200	347.00	9,438,400	
大和ハウス工業	607,300	2,718.50	1,650,945,050	
ライト工業	35,100	1,231.00	43,208,100	貸付有価証券 3,400株
積水ハウス	671,500	1,918.00	1,287,937,000	貸付有価証券 318,700株
日特建設	16,000	758.00	12,128,000	
北陸電気工事	10,600	968.00	10,260,800	
ユアテック	35,100	637.00	22,358,700	
四電工	3,300	2,550.00	8,415,000	
中電工	24,700	2,248.00	55,525,600	
関電工	87,300	873.00	76,212,900	
きんでん	145,800	1,614.00	235,321,200	
東京エネシス	20,400	881.00	17,972,400	
トーエネック	6,200	3,220.00	19,964,000	
住友電設	17,300	2,280.00	39,444,000	
日本電設工業	33,700	2,194.00	73,937,800	
協和エクシオ	93,100	2,415.00	224,836,500	
新日本空調	16,200	2,199.00	35,623,800	
九電工	43,100	3,070.00	132,317,000	貸付有価証券 300株
三機工業	44,200	1,213.00	53,614,600	
日揮ホールディングス	188,900	872.00	164,720,800	貸付有価証券 300株
中外炉工業	6,600	1,493.00	9,853,800	
ヤマト	19,600	653.00	12,798,800	貸付有価証券

				9,300株
太平電業	14,800	2,445.00	36,186,000	
高砂熱学工業	53,300	1,711.00	91,196,300	
三晃金属工業	2,600	2,032.00	5,283,200	
朝日工業社	4,100	3,235.00	13,263,500	
明星工業	39,700	751.00	29,814,700	貸付有価証券 400株
大気社	29,800	3,240.00	96,552,000	
ダイダン	14,700	3,020.00	44,394,000	
日比谷総合設備	19,800	2,062.00	40,827,600	
フィル・カンパニー	2,600	2,663.00	6,923,800	貸付有価証券 1,200株
OSJBホールディングス	96,800	242.00	23,425,600	
レイズネクスト	32,900	1,264.00	41,585,600	貸付有価証券 600株
日本製粉	57,500	1,718.00	98,785,000	
日清製粉グループ本社	221,900	1,925.00	427,157,500	貸付有価証券 300株
日東富士製粉	1,400	5,910.00	8,274,000	
昭和産業	18,000	3,225.00	58,050,000	
鳥越製粉	17,400	907.00	15,781,800	貸付有価証券 8,200株
中部飼料	24,000	1,513.00	36,312,000	貸付有価証券 300株
フィード・ワン	131,900	157.00	20,708,300	貸付有価証券 200株
東洋精糖	3,300	1,113.00	3,672,900	
日本甜菜製糖	10,200	1,781.00	18,166,200	
三井製糖	17,200	2,176.00	37,427,200	貸付有価証券 700株
塩水港精糖	21,300	200.00	4,260,000	貸付有価証券 9,700株
日新製糖	9,300	2,100.00	19,530,000	
森永製菓	46,100	4,635.00	213,673,500	
中村屋	5,100	3,965.00	20,221,500	
江崎グリコ	58,200	4,800.00	279,360,000	貸付有価証券 14,800株(4,100株)
名糖産業	9,400	1,394.00	13,103,600	
井村屋グループ	8,300	1,860.00	15,438,000	

不二家	11,000	2,092.00	23,012,000	貸付有価証券 5,200株
山崎製パン	147,200	2,359.00	347,244,800	貸付有価証券 69,100株
第一屋製パン	3,400	931.00	3,165,400	
モロゾフ	3,300	5,080.00	16,764,000	
亀田製菓	11,200	5,010.00	56,112,000	
寿スピリッツ	18,900	4,865.00	91,948,500	貸付有価証券 100株
カルビー	89,500	2,961.00	265,009,500	
森永乳業	36,300	4,180.00	151,734,000	
六甲バター	13,000	1,375.00	17,875,000	
ヤクルト本社	135,100	6,620.00	894,362,000	貸付有価証券 1,000株
明治ホールディングス	129,900	7,760.00	1,008,024,000	
雪印メグミルク	47,300	2,555.00	120,851,500	
プリマハム	30,700	2,523.00	77,456,100	
日本ハム	75,100	3,980.00	298,898,000	
林兼産業	6,500	578.00	3,757,000	
丸大食品	20,900	2,100.00	43,890,000	
S Foods	15,700	2,356.00	36,989,200	貸付有価証券 7,400株
柿安本店	6,800	2,312.00	15,721,600	貸付有価証券 400株
伊藤ハム米久ホールディングス	126,500	655.00	82,857,500	
サッポロホールディングス	67,000	2,052.00	137,484,000	貸付有価証券 31,700株
アサヒグループホールディングス	411,400	3,661.00	1,506,135,400	貸付有価証券 195,100株（33,600株）
キリンホールディングス	833,100	2,264.50	1,886,554,950	貸付有価証券 395,400株（60,700株）
宝ホールディングス	145,600	819.00	119,246,400	
オエノンホールディングス	51,800	400.00	20,720,000	貸付有価証券 24,600株
養命酒製造	6,000	1,986.00	11,916,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	137,900	2,288.00	315,515,200	貸付有価証券 65,400株

サントリー食品インター ナショナル	131,400	4,260.00	559,764,000	貸付有価証券 62,300株
ダイドグループホール ディングス	10,100	3,750.00	37,875,000	貸付有価証券 3,100株
伊藤園	59,600	5,850.00	348,660,000	貸付有価証券 13,700株（13,300株）
キーコーヒー	19,300	2,383.00	45,991,900	
ユニカフェ	5,100	860.00	4,386,000	
ジャパンフーズ	2,800	1,141.00	3,194,800	
日清オイリオグループ	25,300	3,695.00	93,483,500	
不二製油グループ本社	47,900	2,692.00	128,946,800	貸付有価証券 700株
かどや製油	2,100	3,730.00	7,833,000	
J - オイルミルズ	10,200	4,555.00	46,461,000	
キッコーマン	141,400	4,575.00	646,905,000	貸付有価証券 100株
味の素	433,800	2,026.50	879,095,700	
キューピー	109,400	2,301.00	251,729,400	貸付有価証券 51,900株
ハウス食品グループ本社	73,500	3,665.00	269,377,500	
カゴメ	74,500	2,912.00	216,944,000	貸付有価証券 17,100株
焼津水産化学工業	9,500	986.00	9,367,000	
アリアケジャパン	17,900	6,970.00	124,763,000	貸付有価証券 200株
ピエトロ	2,600	1,548.00	4,024,800	
エバラ食品工業	4,800	2,156.00	10,348,800	
やまみ	1,300	1,662.00	2,160,600	
ニチレイ	93,600	3,070.00	287,352,000	
東洋水産	101,100	5,700.00	576,270,000	
イートアンド	6,800	1,730.00	11,764,000	貸付有価証券 3,100株
大冷	2,600	1,800.00	4,680,000	
ヨシムラ・フード・ホー ルディングス	10,800	928.00	10,022,400	貸付有価証券 2,600株（100株）
日清食品ホールディング ス	83,500	9,380.00	783,230,000	
永谷園ホールディングス	9,600	2,334.00	22,406,400	
一正蒲鉾	7,600	929.00	7,060,400	

フジッコ	21,300	1,996.00	42,514,800	
ロック・フィールド	21,200	1,514.00	32,096,800	貸付有価証券 9,900株
日本たばこ産業	1,134,300	2,053.50	2,329,285,050	貸付有価証券 534,900株（10,800 株）
ケンコーマヨネーズ	11,000	2,074.00	22,814,000	貸付有価証券 900株
わらべや日洋ホールディ ングス	12,900	1,734.00	22,368,600	貸付有価証券 100株
なとり	11,000	1,722.00	18,942,000	貸付有価証券 4,900株
イフジ産業	3,400	785.00	2,669,000	
ピックルスコーポレー ション	4,300	2,255.00	9,696,500	貸付有価証券 100株（100株）
北の達人コーポレーショ ン	68,600	542.00	37,181,200	貸付有価証券 29,400株（8,400株）
ユーグレナ	83,800	697.00	58,408,600	貸付有価証券 39,300株（600株）
ミヨシ油脂	7,500	1,072.00	8,040,000	貸付有価証券 3,500株
理研ビタミン	18,600	2,221.00	41,310,600	
片倉工業	27,800	1,063.00	29,551,400	貸付有価証券 12,900株
グンゼ	14,100	3,780.00	53,298,000	
東洋紡	75,800	1,140.00	86,412,000	貸付有価証券 400株
ユニチカ	56,200	275.00	15,455,000	貸付有価証券 26,300株（8,600株）
富士紡ホールディングス	9,300	2,874.00	26,728,200	
倉敷紡績	19,000	2,523.00	47,937,000	貸付有価証券 8,800株
シキボウ	10,000	1,011.00	10,110,000	貸付有価証券 4,700株
日本毛織	63,100	960.00	60,576,000	貸付有価証券 29,900株
ダイトウボウ	31,000	177.00	5,487,000	貸付有価証券 14,400株（13,700株）
トーア紡コーポレーショ ン	7,600	464.00	3,526,400	
ダイドーリミテッド	25,200	202.00	5,090,400	貸付有価証券 11,800株

帝国繊維	21,500	2,230.00	47,945,000	貸付有価証券 10,200株
帝人	156,400	1,900.00	297,160,000	貸付有価証券 1,900株
東レ	1,387,900	480.00	666,192,000	貸付有価証券 2,700株
サカイオーボックス	5,100	1,922.00	9,802,200	
住江織物	4,200	1,715.00	7,203,000	貸付有価証券 100株（100株）
日本フェルト	10,900	449.00	4,894,100	貸付有価証券 4,900株
イチカワ	2,700	1,394.00	3,763,800	
日東製網	2,200	1,451.00	3,192,200	
アツギ	15,800	656.00	10,364,800	
ダイニック	7,200	755.00	5,436,000	
セーレン	47,100	1,351.00	63,632,100	
ソトー	7,600	942.00	7,159,200	
東海染工	2,600	1,112.00	2,891,200	
小松マテーレ	31,500	797.00	25,105,500	貸付有価証券 100株
ワコールホールディングス	50,000	2,486.00	124,300,000	
ホギメディカル	21,800	3,440.00	74,992,000	
レナウン	49,200	74.00	3,640,800	貸付有価証券 2,900株
クラウドシアホールディングス	4,700	413.00	1,941,100	
T S Iホールディングス	64,300	422.00	27,134,600	貸付有価証券 30,400株
マツオカコーポレーション	5,500	1,711.00	9,410,500	貸付有価証券 300株
ワールド	27,200	1,566.00	42,595,200	貸付有価証券 1,000株
三陽商会	10,000	1,426.00	14,260,000	貸付有価証券 300株
ナイガイ	7,000	427.00	2,989,000	
オンワードホールディングス	115,200	486.00	55,987,200	貸付有価証券 54,600株
ルックホールディングス	6,500	773.00	5,024,500	
ゴールドウイン	34,700	6,250.00	216,875,000	貸付有価証券

				300株
デサント	37,400	1,317.00	49,255,800	貸付有価証券 4,000株
キング	9,000	526.00	4,734,000	
ヤマトインターナショナル	11,700	276.00	3,229,200	
特種東海製紙	12,200	4,130.00	50,386,000	
王子ホールディングス	801,300	593.00	475,170,900	
日本製紙	84,800	1,583.00	134,238,400	貸付有価証券 1,200株
三菱製紙	21,800	364.00	7,935,200	
北越コーポレーション	127,200	416.00	52,915,200	貸付有価証券 5,700株(5,700株)
中越パルプ工業	8,100	1,429.00	11,574,900	
巴川製紙所	5,700	694.00	3,955,800	
大王製紙	84,100	1,498.00	125,981,800	貸付有価証券 31,400株(8,000株)
阿波製紙	4,900	436.00	2,136,400	貸付有価証券 400株
レンゴー	181,200	865.00	156,738,000	
トーモク	11,800	1,548.00	18,266,400	
ザ・パック	14,500	3,690.00	53,505,000	貸付有価証券 6,800株
クラレ	301,900	1,129.00	340,845,100	貸付有価証券 143,300株(400株)
旭化成	1,270,600	822.30	1,044,814,380	
共和レザー	10,400	747.00	7,768,800	
昭和電工	136,500	2,311.00	315,451,500	貸付有価証券 63,800株(22,700株)
住友化学	1,408,300	329.00	463,330,700	
住友精化	8,500	2,772.00	23,562,000	
日産化学	106,500	4,005.00	426,532,500	貸付有価証券 100株
ラサ工業	6,800	1,375.00	9,350,000	
クレハ	16,400	4,470.00	73,308,000	
多木化学	5,600	3,795.00	21,252,000	貸付有価証券 400株
テイカ	14,100	1,580.00	22,278,000	
石原産業	34,400	571.00	19,642,400	
片倉コープアグリ	4,900	1,067.00	5,228,300	

日本曹達	28,400	2,774.00	78,781,600	
東ソー	296,300	1,244.00	368,597,200	
トクヤマ	55,200	2,127.00	117,410,400	
セントラル硝子	39,200	1,916.00	75,107,200	
東亜合成	120,300	978.00	117,653,400	貸付有価証券 57,000株
大阪ソーダ	19,500	2,713.00	52,903,500	
関東電化工業	45,500	777.00	35,353,500	
デンカ	70,000	2,346.00	164,220,000	
信越化学工業	329,100	10,735.00	3,532,888,500	貸付有価証券 300株
日本カーバイド工業	6,500	1,045.00	6,792,500	
堺化学工業	12,400	1,929.00	23,919,600	
第一稀元素化学工業	20,800	773.00	16,078,400	貸付有価証券 3,900株
エア・ウォーター	178,300	1,544.00	275,295,200	
大陽日酸	184,200	1,662.00	306,140,400	
日本化学工業	6,000	2,306.00	13,836,000	貸付有価証券 600株
東邦アセチレン	2,900	1,240.00	3,596,000	
日本パーカライズン	96,700	1,195.00	115,556,500	
高圧ガス工業	30,400	740.00	22,496,000	
チタン工業	2,400	1,651.00	3,962,400	貸付有価証券 700株
四国化成工業	29,600	1,070.00	31,672,000	
戸田工業	4,400	1,247.00	5,486,800	貸付有価証券 1,400株
ステラ ケミファ	10,400	2,471.00	25,698,400	
保土谷化学工業	7,200	3,055.00	21,996,000	
日本触媒	29,800	5,180.00	154,364,000	貸付有価証券 5,500株（1,300株）
大日精化工業	17,000	2,451.00	41,667,000	
カネカ	49,600	2,663.00	132,084,800	
三菱瓦斯化学	178,300	1,189.00	211,998,700	
三井化学	174,000	2,105.00	366,270,000	
J S R	178,600	1,845.00	329,517,000	
東京応化工業	32,900	4,175.00	137,357,500	貸付有価証券 15,600株

大阪有機化学工業	17,700	1,518.00	26,868,600	貸付有価証券 8,400株
三菱ケミカルホールディングス	1,281,400	668.00	855,975,200	貸付有価証券 1,100株
KHネオケム	33,800	1,553.00	52,491,400	貸付有価証券 16,000株(300株)
ダイセル	262,200	822.00	215,528,400	
住友ベークライト	30,100	2,277.00	68,537,700	
積水化学工業	412,200	1,479.00	609,643,800	
日本ゼオン	172,900	851.00	147,137,900	
アイカ工業	57,500	3,230.00	185,725,000	
宇部興産	96,800	1,691.00	163,688,800	貸付有価証券 1,100株
積水樹脂	34,500	2,066.00	71,277,000	
タキロンシーアイ	41,500	607.00	25,190,500	
旭有機材	10,800	1,424.00	15,379,200	
日立化成	88,600	4,595.00	407,117,000	貸付有価証券 1,200株
ニチバン	10,100	1,507.00	15,220,700	貸付有価証券 100株
リケンテクノス	48,200	401.00	19,328,200	
大倉工業	9,100	1,660.00	15,106,000	貸付有価証券 4,200株
積水化成成品工業	25,700	588.00	15,111,600	
群栄化学工業	4,400	2,558.00	11,255,200	
タイガースポリマー	10,100	437.00	4,413,700	
ミライアル	6,800	943.00	6,412,400	
ダイキアクシス	6,800	760.00	5,168,000	
ダイキョーニシカワ	40,400	512.00	20,684,800	
竹本容器	6,900	648.00	4,471,200	
森六ホールディングス	10,300	1,544.00	15,903,200	
日本化薬	118,600	1,009.00	119,667,400	貸付有価証券 300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 9,400株
日本精化	15,400	1,554.00	23,931,600	
扶桑化学工業	19,400	3,050.00	59,170,000	貸付有価証券 800株
トリケミカル研究所	4,300	7,290.00	31,347,000	貸付有価証券

				300株
A D E K A	88,200	1,393.00	122,862,600	
日油	72,200	3,455.00	249,451,000	
新日本理化	31,700	164.00	5,198,800	貸付有価証券 300株
ハリマ化成グループ	15,800	1,201.00	18,975,800	
花王	468,600	8,900.00	4,170,540,000	貸付有価証券 220,900株(13,000 株)
第一工業製薬	7,100	3,790.00	26,909,000	貸付有価証券 800株(100株)
石原ケミカル	5,200	1,804.00	9,380,800	
日華化学	6,500	800.00	5,200,000	
ニイタカ	3,000	2,997.00	8,991,000	貸付有価証券 1,200株
三洋化成工業	11,400	4,110.00	46,854,000	
有機合成薬品工業	14,700	259.00	3,807,300	貸付有価証券 1,200株
大日本塗料	21,700	827.00	17,945,900	貸付有価証券 10,000株
日本ペイントホールディングス	158,200	5,800.00	917,560,000	貸付有価証券 15,200株(600株)
関西ペイント	215,400	2,128.00	458,371,200	
神東塗料	15,100	151.00	2,280,100	貸付有価証券 100株(100株)
中国塗料	54,600	919.00	50,177,400	
日本特殊塗料	14,300	795.00	11,368,500	
藤倉化成	25,800	530.00	13,674,000	
太陽ホールディングス	14,100	4,075.00	57,457,500	
D I C	81,000	2,479.00	200,799,000	貸付有価証券 38,400株
サカタインクス	41,800	945.00	39,501,000	貸付有価証券 19,800株
東洋インキ S C ホールディングス	40,500	2,221.00	89,950,500	貸付有価証券 200株
T & K T O K A	14,800	761.00	11,262,800	貸付有価証券 6,900株
富士フイルムホールディングス	375,300	5,320.00	1,996,596,000	貸付有価証券 800株
資生堂	388,900	6,440.00	2,504,516,000	貸付有価証券 184,500株(100株)

ライオン	254,500	2,337.00	594,766,500	貸付有価証券 120,700株
高砂香料工業	12,200	2,067.00	25,217,400	
マンダム	44,000	2,119.00	93,236,000	
ミルボン	26,200	5,490.00	143,838,000	貸付有価証券 12,200株
ファンケル	79,200	2,447.00	193,802,400	貸付有価証券 1,600株
コーセー	36,800	13,700.00	504,160,000	貸付有価証券 900株(900株)
コタ	11,320	1,231.00	13,934,920	
シーボン	2,500	2,130.00	5,325,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	83,500	2,045.00	170,757,500	貸付有価証券 39,100株(16,600株)
ノエビアホールディングス	18,700	5,620.00	105,094,000	貸付有価証券 100株
アジュバンコスメジャパン	4,400	907.00	3,990,800	貸付有価証券 2,000株
エステー	12,600	1,639.00	20,651,400	
アグロ カネショウ	6,100	1,529.00	9,326,900	貸付有価証券 200株
コニシ	32,200	1,496.00	48,171,200	
長谷川香料	26,000	2,099.00	54,574,000	
星光PMC	11,200	662.00	7,414,400	
小林製薬	54,800	10,240.00	561,152,000	貸付有価証券 25,900株(3,000株)
荒川化学工業	17,600	1,239.00	21,806,400	
メック	13,400	1,462.00	19,590,800	貸付有価証券 6,200株
日本高純度化学	5,400	2,455.00	13,257,000	
タカラバイオ	51,200	2,258.00	115,609,600	
JCU	23,700	2,153.00	51,026,100	
新田ゼラチン	12,300	592.00	7,281,600	
OATアグリオ	3,400	1,012.00	3,440,800	
デクセリアルズ	50,500	706.00	35,653,000	
アース製薬	14,800	5,980.00	88,504,000	
北興化学工業	20,000	579.00	11,580,000	
大成ラミック	6,400	2,547.00	16,300,800	
クマイ化学工業	80,900	855.00	69,169,500	貸付有価証券

				38,000株(3,500株)
日本農薬	34,900	434.00	15,146,600	
アキレス	13,500	1,603.00	21,640,500	
有沢製作所	30,900	819.00	25,307,100	貸付有価証券 1,800株
日東電工	135,100	4,865.00	657,261,500	貸付有価証券 100株
レック	20,900	1,105.00	23,094,500	貸付有価証券 300株
三光合成	22,400	260.00	5,824,000	
きもと	33,300	139.00	4,628,700	
藤森工業	17,600	2,991.00	52,641,600	
前澤化成工業	12,400	1,032.00	12,796,800	
未来工業	10,500	2,002.00	21,021,000	
ウェーブロックホールディングス	6,800	518.00	3,522,400	貸付有価証券 800株
JSP	11,500	1,425.00	16,387,500	貸付有価証券 5,300株
エフピコ	21,500	7,220.00	155,230,000	
天馬	13,000	1,694.00	22,022,000	貸付有価証券 100株
信越ポリマー	35,100	847.00	29,729,700	
東リ	48,700	273.00	13,295,100	
ニフコ	71,900	1,972.00	141,786,800	
バルカー	15,900	1,733.00	27,554,700	
ユニ・チャーム	377,300	4,047.00	1,526,933,100	貸付有価証券 174,500株(900株)
ショーエイコーポレーション	2,200	675.00	1,485,000	
協和キリン	196,900	2,492.00	490,674,800	貸付有価証券 93,400株(700株)
武田薬品工業	1,628,400	3,345.00	5,446,998,000	
アステラス製薬	1,697,000	1,722.00	2,922,234,000	
大日本住友製薬	145,100	1,442.00	209,234,200	貸付有価証券 100株
塩野義製薬	250,200	5,426.00	1,357,585,200	貸付有価証券 200株
わかもと製薬	23,300	256.00	5,964,800	貸付有価証券 100株
あすか製薬	22,300	1,162.00	25,912,600	

日本新薬	51,200	8,530.00	436,736,000	
ビオフェルミン製薬	3,300	2,408.00	7,946,400	
中外製薬	204,100	12,405.00	2,531,860,500	貸付有価証券 96,800株(4,300株)
科研製薬	33,500	5,140.00	172,190,000	
エーザイ	234,300	7,833.00	1,835,271,900	貸付有価証券 200株
ロート製薬	100,500	3,100.00	311,550,000	
小野薬品工業	449,500	2,534.50	1,139,257,750	
久光製薬	51,800	5,370.00	278,166,000	貸付有価証券 4,100株
持田製薬	27,200	4,580.00	124,576,000	
参天製薬	364,600	1,912.00	697,115,200	
扶桑薬品工業	6,900	2,237.00	15,435,300	
日本ケミファ	2,600	2,494.00	6,484,400	
ツムラ	60,600	2,804.00	169,922,400	貸付有価証券 500株
日医工	55,400	1,520.00	84,208,000	貸付有価証券 26,000株(26,000株)
キッセイ薬品工業	34,600	2,933.00	101,481,800	
生化学工業	38,000	1,154.00	43,852,000	
栄研化学	34,400	2,011.00	69,178,400	貸付有価証券 300株
日水製薬	8,200	1,232.00	10,102,400	
鳥居薬品	12,300	2,710.00	33,333,000	貸付有価証券 5,700株
JCRファーマ	13,800	9,310.00	128,478,000	
東和薬品	25,000	2,385.00	59,625,000	貸付有価証券 500株
富士製薬工業	13,300	1,294.00	17,210,200	
沢井製薬	40,200	5,950.00	239,190,000	
ゼリア新薬工業	35,500	2,197.00	77,993,500	
第一三共	560,100	7,664.00	4,292,606,400	
キョーリン製薬ホールディングス	43,200	2,199.00	94,996,800	貸付有価証券 400株
大幸薬品	23,900	1,655.00	39,554,500	貸付有価証券 10,800株(4,500株)
ダイト	11,700	3,040.00	35,568,000	貸付有価証券 5,500株

大塚ホールディングス	372,900	4,295.00	1,601,605,500	貸付有価証券 176,900株(100株)
大正製薬ホールディングス	41,400	7,050.00	291,870,000	
ペプチドリーム	99,500	3,640.00	362,180,000	貸付有価証券 45,200株
日本コークス工業	165,400	63.00	10,420,200	貸付有価証券 200株
ニチレキ	23,100	1,334.00	30,815,400	貸付有価証券 400株
ユシロ化学工業	11,000	1,296.00	14,256,000	
ビーピー・カストロール	7,000	1,167.00	8,169,000	
富士石油	52,300	188.00	9,832,400	
MORESCO	7,100	881.00	6,255,100	
出光興産	220,200	2,477.00	545,435,400	
JXTGホールディングス	2,944,400	367.80	1,082,950,320	貸付有価証券 1,500株
コスモエネルギーホールディングス	56,700	1,508.00	85,503,600	
横浜ゴム	113,300	1,457.00	165,078,100	貸付有価証券 53,800株
TOYO TIRE	112,400	1,263.00	141,961,200	貸付有価証券 53,300株(2,200株)
ブリヂストン	563,800	3,409.00	1,921,994,200	貸付有価証券 267,600株(30,300株)
住友ゴム工業	175,800	1,069.00	187,930,200	貸付有価証券 11,200株(6,700株)
藤倉コンポジット	17,100	362.00	6,190,200	
オカモト	11,900	4,080.00	48,552,000	
フコク	8,600	611.00	5,254,600	貸付有価証券 3,900株
ニッタ	22,100	2,208.00	48,796,800	
住友理工	37,900	625.00	23,687,500	
三ツ星ベルト	25,800	1,302.00	33,591,600	
バンドー化学	34,400	685.00	23,564,000	
日東紡績	29,100	4,960.00	144,336,000	貸付有価証券 5,600株
AGC	193,500	2,774.00	536,769,000	貸付有価証券 91,800株
日本板硝子	93,600	346.00	32,385,600	貸付有価証券

				1,200株
石塚硝子	3,600	1,992.00	7,171,200	
日本山村硝子	8,100	876.00	7,095,600	
日本電気硝子	78,600	1,498.00	117,742,800	貸付有価証券 37,300株
オハラ	7,700	870.00	6,699,000	貸付有価証券 3,000株(2,000株)
住友大阪セメント	37,000	3,370.00	124,690,000	
太平洋セメント	123,600	1,935.00	239,166,000	
日本ヒューム	19,600	652.00	12,779,200	貸付有価証券 100株
日本コンクリート工業	42,100	265.00	11,156,500	貸付有価証券 100株
三谷セキサン	9,100	4,565.00	41,541,500	
アジアパイルホールディングス	27,800	422.00	11,731,600	貸付有価証券 100株(100株)
東海カーボン	205,000	903.00	185,115,000	貸付有価証券 93,400株(5,200株)
日本カーボン	10,100	3,230.00	32,623,000	貸付有価証券 4,500株
東洋炭素	11,500	1,460.00	16,790,000	貸付有価証券 5,400株
ノリタケカンパニーリミテド	10,800	3,525.00	38,070,000	
TOTO	139,800	3,720.00	520,056,000	貸付有価証券 900株
日本碍子	238,900	1,452.00	346,882,800	
日本特殊陶業	152,300	1,608.00	244,898,400	
ダントーホールディングス	14,600	71.00	1,036,600	貸付有価証券 400株(300株)
MARUWA	7,500	6,430.00	48,225,000	
品川リフラクトリーズ	5,200	2,296.00	11,939,200	
黒崎播磨	3,900	4,135.00	16,126,500	
ヨータイ	15,500	662.00	10,261,000	
イソライト工業	10,000	461.00	4,610,000	
東京窯業	24,900	294.00	7,320,600	貸付有価証券 200株
ニッカトー	8,800	572.00	5,033,600	貸付有価証券 2,100株
フジインコーポレー	17,400	2,671.00	46,475,400	貸付有価証券

テッド				400株
クニミネ工業	7,900	935.00	7,386,500	
エーアンドエーマテリアル	3,300	1,158.00	3,821,400	
ニチアス	53,600	2,000.00	107,200,000	貸付有価証券 300株
ニチハ	27,200	2,134.00	58,044,800	
日本製鉄	866,200	1,006.00	871,397,200	貸付有価証券 355,600株（110,100 株）
神戸製鋼所	354,300	354.00	125,422,200	貸付有価証券 80,200株
中山製鋼所	26,800	426.00	11,416,800	
合同製鐵	10,400	2,100.00	21,840,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	522,700	767.00	400,910,900	貸付有価証券 241,000株（165,800 株）
東京製鐵	94,200	699.00	65,845,800	
共英製鋼	21,800	1,291.00	28,143,800	貸付有価証券 9,800株
大和工業	41,100	1,864.00	76,610,400	
東京鐵鋼	8,000	1,157.00	9,256,000	貸付有価証券 3,700株
大阪製鐵	10,300	1,217.00	12,535,100	
淀川製鋼所	26,100	1,851.00	48,311,100	
丸一鋼管	62,800	2,771.00	174,018,800	
モリ工業	5,800	2,574.00	14,929,200	
大同特殊鋼	31,700	3,655.00	115,863,500	貸付有価証券 400株
日本高周波鋼業	7,100	363.00	2,577,300	
日本冶金工業	16,000	1,620.00	25,920,000	貸付有価証券 3,700株
山陽特殊製鋼	13,200	1,009.00	13,318,800	貸付有価証券 2,500株
愛知製鋼	10,900	3,215.00	35,043,500	
日立金属	208,500	1,148.00	239,358,000	
日本金属	4,500	599.00	2,695,500	
大平洋金属	13,100	1,550.00	20,305,000	貸付有価証券 2,600株（200株）
新日本電工	124,700	155.00	19,328,500	貸付有価証券

				58,500株
栗本鐵工所	9,600	1,945.00	18,672,000	
虹技	2,900	985.00	2,856,500	
日本鑄鉄管	2,000	1,317.00	2,634,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
三菱製鋼	14,300	836.00	11,954,800	
日亜鋼業	28,300	292.00	8,263,600	
日本精線	3,200	2,990.00	9,568,000	貸付有価証券 1,500株
エンビプロ・ホールディングス	8,200	552.00	4,526,400	貸付有価証券 200株
シンニッタン	30,100	229.00	6,892,900	
新家工業	4,400	1,076.00	4,734,400	
大紀アルミニウム工業所	31,800	590.00	18,762,000	貸付有価証券 500株
日本軽金属ホールディングス	489,700	168.00	82,269,600	貸付有価証券 5,700株
三井金属鉱業	52,200	1,803.00	94,116,600	貸付有価証券 400株
東邦亜鉛	9,900	1,227.00	12,147,300	貸付有価証券 100株
三菱マテリアル	127,800	2,207.00	282,054,600	
住友金属鉱山	247,400	2,311.50	571,865,100	
DOWAホールディングス	49,000	2,786.00	136,514,000	貸付有価証券 200株
古河機械金属	34,400	1,105.00	38,012,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,100	962.00	19,336,200	貸付有価証券 4,200株(2,400株)
東邦チタニウム	34,600	663.00	22,939,800	
UACJ	29,400	1,624.00	47,745,600	
CKサンエツ	4,000	2,725.00	10,900,000	
古河電気工業	60,100	1,979.00	118,937,900	貸付有価証券 1,300株
住友電気工業	723,700	1,166.50	844,196,050	
フジクラ	233,700	317.00	74,082,900	貸付有価証券 7,500株
昭和電線ホールディングス	22,500	1,035.00	23,287,500	
東京特殊電線	2,900	2,330.00	6,757,000	貸付有価証券 1,300株

タツタ電線	38,400	470.00	18,048,000	
カナレ電気	3,200	1,589.00	5,084,800	
平河ヒューテック	7,200	860.00	6,192,000	貸付有価証券 3,300株
リョービ	23,800	1,321.00	31,439,800	貸付有価証券 11,300株
アーレスティ	25,400	360.00	9,144,000	
アサヒホールディングス	33,900	2,347.00	79,563,300	貸付有価証券 300株
稲葉製作所	10,900	1,335.00	14,551,500	貸付有価証券 200株
宮地エンジニアリンググループ	5,900	1,670.00	9,853,000	貸付有価証券 400株
トーカロ	53,800	998.00	53,692,400	
アルファC o	6,800	959.00	6,521,200	貸付有価証券 100株
SUMCO	231,700	1,383.00	320,441,100	貸付有価証券 109,900株（91,000株）
川田テクノロジーズ	4,000	5,570.00	22,280,000	貸付有価証券 100株
RS Technologies	5,500	2,051.00	11,280,500	
信和	8,300	759.00	6,299,700	
東洋製罐グループホールディングス	123,300	1,313.00	161,892,900	
ホッカホホールディングス	10,600	1,705.00	18,073,000	貸付有価証券 700株
コロナ	10,700	960.00	10,272,000	
横河ブリッジホールディングス	36,000	1,989.00	71,604,000	
駒井ハルテック	3,600	1,524.00	5,486,400	
高田機工	1,800	2,256.00	4,060,800	
三和ホールディングス	182,500	857.00	156,402,500	
文化シャッター	57,000	833.00	47,481,000	貸付有価証券 2,300株
三協立山	24,900	1,074.00	26,742,600	貸付有価証券 11,800株
アルインコ	14,100	956.00	13,479,600	貸付有価証券 100株
東洋シャッター	4,700	665.00	3,125,500	

LI X I Lグループ	285,600	1,332.00	380,419,200	
日本ファイルコン	14,800	495.00	7,326,000	貸付有価証券 100株(100株)
ノーリツ	40,100	1,303.00	52,250,300	貸付有価証券 19,000株
長府製作所	19,700	2,614.00	51,495,800	貸付有価証券 9,300株
リンナイ	37,600	7,740.00	291,024,000	
ダイニチ工業	10,400	623.00	6,479,200	
日東精工	26,700	543.00	14,498,100	貸付有価証券 12,600株
三洋工業	2,600	1,770.00	4,602,000	
岡部	39,200	747.00	29,282,400	貸付有価証券 18,600株
ジーテクト	24,000	1,167.00	28,008,000	
東プレ	36,100	1,223.00	44,150,300	
高周波熱錬	37,300	738.00	27,527,400	貸付有価証券 17,100株
東京製鋼	13,800	645.00	8,901,000	
サンコール	10,900	423.00	4,610,700	貸付有価証券 100株
モリテック スチール	15,100	272.00	4,107,200	
パイオラックス	28,600	1,544.00	44,158,400	貸付有価証券 2,600株
エイチワン	19,000	524.00	9,956,000	貸付有価証券 100株
日本発條	207,600	747.00	155,077,200	
中央発條	2,300	2,555.00	5,876,500	
アドバネクス	2,800	1,378.00	3,858,400	
立川ブラインド工業	8,500	1,069.00	9,086,500	
三益半導体工業	15,100	1,724.00	26,032,400	貸付有価証券 7,100株
日本ドライケミカル	4,800	1,431.00	6,868,800	
日本製鋼所	58,700	1,267.00	74,372,900	
三浦工業	83,700	3,940.00	329,778,000	
タクマ	65,600	1,226.00	80,425,600	
ツガミ	40,100	727.00	29,152,700	
オークマ	22,600	3,465.00	78,309,000	
東芝機械	21,900	2,090.00	45,771,000	貸付有価証券

				10,200株(1,900株)
アマダホールディングス	246,100	872.00	214,599,200	
アイダエンジニアリング	50,600	678.00	34,306,800	
滝澤鉄工所	6,000	1,097.00	6,582,000	
F U J I	83,200	1,652.00	137,446,400	貸付有価証券 100株
牧野フライス製作所	22,700	2,794.00	63,423,800	貸付有価証券 3,400株
オーエスジー	89,500	1,466.00	131,207,000	貸付有価証券 42,400株
ダイジェット工業	2,200	1,243.00	2,734,600	
旭ダイヤモンド工業	50,800	477.00	24,231,600	
D M G 森精機	122,500	906.00	110,985,000	貸付有価証券 57,400株
ソディック	45,500	633.00	28,801,500	貸付有価証券 1,400株
ディスコ	26,200	21,540.00	564,348,000	
日東工器	10,600	1,786.00	18,931,600	
日進工具	5,700	2,417.00	13,776,900	貸付有価証券 1,400株
パンチ工業	17,500	437.00	7,647,500	
富士ダイス	8,500	609.00	5,176,500	
豊和工業	10,700	637.00	6,815,900	貸付有価証券 300株
O K K	7,900	460.00	3,634,000	
東洋機械金属	13,800	442.00	6,099,600	
津田駒工業	3,700	800.00	2,960,000	貸付有価証券 200株
エンシュウ	4,600	932.00	4,287,200	貸付有価証券 100株
島精機製作所	30,500	1,485.00	45,292,500	
オプトラ	21,600	2,469.00	53,330,400	貸付有価証券 600株
N C ホールディングス	5,800	584.00	3,387,200	
イワキポンプ	9,200	881.00	8,105,200	
フリー	18,900	811.00	15,327,900	貸付有価証券 1,000株
ヤマシンフィルタ	42,000	746.00	31,332,000	貸付有価証券 11,800株(5,300株)
日阪製作所	23,900	781.00	18,665,900	

やまびこ	37,500	837.00	31,387,500	貸付有価証券 17,500株
平田機工	9,200	4,795.00	44,114,000	貸付有価証券 400株(400株)
ペガサスミシン製造	19,600	365.00	7,154,000	貸付有価証券 200株
マルマエ	7,900	710.00	5,609,000	貸付有価証券 3,700株(2,100株)
タツモ	9,000	1,017.00	9,153,000	貸付有価証券 3,000株(2,600株)
ナプテスコ	114,100	2,432.00	277,491,200	貸付有価証券 54,100株(2,000株)
三井海洋開発	20,600	1,331.00	27,418,600	貸付有価証券 9,700株
レオン自動機	19,000	1,213.00	23,047,000	貸付有価証券 400株
S M C	61,400	46,000.00	2,824,400,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディング	16,900	746.00	12,607,400	貸付有価証券 6,400株
ホソカワミクロン	6,800	4,810.00	32,708,000	貸付有価証券 200株
ユニオンツール	7,200	2,659.00	19,144,800	貸付有価証券 3,400株
オイレス工業	25,000	1,406.00	35,150,000	貸付有価証券 11,600株(100株)
日精エー・エス・ビー機械	6,500	3,220.00	20,930,000	貸付有価証券 100株
サトーホールディングス	27,600	2,183.00	60,250,800	
技研製作所	17,000	3,540.00	60,180,000	貸付有価証券 8,000株
日本エアテック	6,100	998.00	6,087,800	貸付有価証券 2,800株(2,100株)
カワタ	5,700	705.00	4,018,500	
日精樹脂工業	16,200	988.00	16,005,600	
オカダアイヨン	6,100	842.00	5,136,200	貸付有価証券 800株
ワイエイシイホールディングス	8,300	417.00	3,461,100	貸付有価証券 2,200株
小松製作所	886,500	1,877.50	1,664,403,750	貸付有価証券 2,600株
住友重機械工業	112,000	2,016.00	225,792,000	貸付有価証券 500株

日立建機	78,400	2,230.00	174,832,000	貸付有価証券 200株
日工	26,700	636.00	16,981,200	貸付有価証券 500株
巴工業	8,300	2,070.00	17,181,000	
井関農機	19,600	1,171.00	22,951,600	貸付有価証券 9,200株
TOWA	19,800	717.00	14,196,600	
丸山製作所	4,300	1,158.00	4,979,400	貸付有価証券 2,000株
北川鉄工所	8,800	1,557.00	13,701,600	
ローツェ	8,600	2,917.00	25,086,200	
タカキタ	6,800	536.00	3,644,800	
クボタ	1,038,400	1,398.50	1,452,202,400	貸付有価証券 492,900株(53,400 株)
荏原実業	4,900	2,258.00	11,064,200	貸付有価証券 1,800株
三菱化工機	6,700	1,643.00	11,008,100	貸付有価証券 100株
月島機械	36,000	1,410.00	50,760,000	
帝国電機製作所	16,100	1,318.00	21,219,800	貸付有価証券 100株
東京機械製作所	8,000	250.00	2,000,000	
新東工業	46,400	795.00	36,888,000	
澁谷工業	17,100	2,590.00	44,289,000	貸付有価証券 8,100株
アイチ コーポレーショ ン	33,800	680.00	22,984,000	
小森コーポレーション	49,600	767.00	38,043,200	
鶴見製作所	15,200	2,085.00	31,692,000	
住友精密工業	2,900	2,210.00	6,409,000	
日本ギア工業	5,900	242.00	1,427,800	貸付有価証券 1,100株
酒井重工業	3,700	2,292.00	8,480,400	
荏原製作所	81,000	2,060.00	166,860,000	貸付有価証券 38,400株
石井鐵工所	2,500	2,213.00	5,532,500	
西島製作所	19,700	779.00	15,346,300	
北越工業	20,200	1,090.00	22,018,000	

ダイキン工業	249,400	13,070.00	3,259,658,000	貸付有価証券 400株
オルガノ	7,000	5,470.00	38,290,000	
トーヨーカネツ	8,500	1,998.00	16,983,000	
栗田工業	105,900	2,594.00	274,704,600	
椿本チエイン	27,900	2,608.00	72,763,200	貸付有価証券 400株
大同工業	9,300	688.00	6,398,400	
木村化工機	16,300	461.00	7,514,300	貸付有価証券 7,500株
アネスト岩田	30,400	1,005.00	30,552,000	
ダイフク	100,000	6,870.00	687,000,000	
サムコ	5,400	1,574.00	8,499,600	貸付有価証券 2,400株（1,100株）
加藤製作所	10,700	1,239.00	13,257,300	
油研工業	3,300	1,440.00	4,752,000	
タダノ	94,400	796.00	75,142,400	貸付有価証券 13,800株
フジテック	71,100	1,431.00	101,744,100	貸付有価証券 17,100株（15,300株）
C K D	54,400	1,444.00	78,553,600	貸付有価証券 500株
キトー	14,800	995.00	14,726,000	
平和	54,600	2,003.00	109,363,800	貸付有価証券 24,500株
理想科学工業	17,300	1,701.00	29,427,300	
SANKYO	43,600	3,170.00	138,212,000	貸付有価証券 600株
日本金銭機械	21,600	573.00	12,376,800	貸付有価証券 900株（900株）
マースグループホールディングス	12,400	1,804.00	22,369,600	
フクシマガリレイ	12,100	3,370.00	40,777,000	
オーイズミ	8,200	360.00	2,952,000	
ダイコク電機	9,000	1,244.00	11,196,000	
竹内製作所	32,800	1,366.00	44,804,800	貸付有価証券 15,500株
アマノ	51,200	2,409.00	123,340,800	貸付有価証券 200株
JUKI	27,200	555.00	15,096,000	貸付有価証券

				12,900株
サンデンホールディングス	25,600	381.00	9,753,600	貸付有価証券 10,500株(1,900株)
蛇の目ミシン工業	17,800	309.00	5,500,200	
マックス	29,900	1,652.00	49,394,800	
グローリー	50,300	2,605.00	131,031,500	
新晃工業	18,200	1,420.00	25,844,000	貸付有価証券 500株
大和冷機工業	28,300	958.00	27,111,400	貸付有価証券 13,400株
セガサミーホールディングス	194,100	1,333.00	258,735,300	
日本ピストンリング	7,100	1,198.00	8,505,800	
リケン	9,100	2,896.00	26,353,600	
T P R	26,300	1,209.00	31,796,700	
ツバキ・ナカシマ	39,900	693.00	27,650,700	貸付有価証券 18,900株
ホシザキ	57,200	8,530.00	487,916,000	貸付有価証券 500株
大豊工業	16,000	572.00	9,152,000	
日本精工	368,500	711.00	262,003,500	貸付有価証券 1,300株
N T N	453,000	196.00	88,788,000	貸付有価証券 4,400株
ジェイテクト	187,700	755.00	141,713,500	貸付有価証券 700株
不二越	18,200	3,005.00	54,691,000	貸付有価証券 8,600株
日本トムソン	58,100	370.00	21,497,000	
T H K	113,900	2,227.00	253,655,300	貸付有価証券 54,000株(4,400株)
ユースン精機	15,200	680.00	10,336,000	
前澤給装工業	7,100	1,981.00	14,065,100	
イーグル工業	24,200	710.00	17,182,000	
前澤工業	13,000	319.00	4,147,000	
日本ピラー工業	19,800	1,256.00	24,868,800	
キッツ	79,300	648.00	51,386,400	
マキタ	255,200	3,400.00	867,680,000	
日立造船	155,100	357.00	55,370,700	
三菱重工業	328,000	2,819.50	924,796,000	

I H I	141,000	1,316.00	185,556,000	貸付有価証券 800株
スター精密	30,100	1,097.00	33,019,700	貸付有価証券 7,900株(5,700株)
日清紡ホールディングス	130,400	730.00	95,192,000	貸付有価証券 61,900株
イビデン	119,800	2,323.00	278,295,400	貸付有価証券 500株
コニカミノルタ	427,600	455.00	194,558,000	貸付有価証券 2,700株
ブラザー工業	239,000	1,758.00	420,162,000	貸付有価証券 1,000株
ミネベアミツミ	363,300	1,613.00	586,002,900	
日立製作所	940,400	3,109.00	2,923,703,600	
三菱電機	1,957,200	1,354.50	2,651,027,400	
富士電機	117,900	2,429.00	286,379,100	
東洋電機製造	7,100	1,162.00	8,250,200	
安川電機	210,700	3,010.00	634,207,000	貸付有価証券 99,900株(26,800株)
シンフォニアテクノロジー	25,300	959.00	24,262,700	
明電舎	36,000	1,616.00	58,176,000	
オリジン	5,300	1,455.00	7,711,500	
山洋電気	9,500	4,505.00	42,797,500	
デンヨー	16,700	1,956.00	32,665,200	
東芝テック	24,500	3,485.00	85,382,500	
芝浦メカトロニクス	3,500	2,385.00	8,347,500	
マブチモーター	54,200	3,360.00	182,112,000	貸付有価証券 25,600株
日本電産	471,000	5,733.00	2,700,243,000	貸付有価証券 200株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,700	235.00	2,749,500	貸付有価証券 3,500株(500株)
トレックス・セミコンダクター	11,200	994.00	11,132,800	
東光高岳	10,900	981.00	10,692,900	
ダブル・スコープ	30,900	355.00	10,969,500	貸付有価証券 13,900株(1,900株)
ダイヘン	21,400	2,995.00	64,093,000	
ヤーマン	31,900	666.00	21,245,400	貸付有価証券

				14,900株(300株)
JVCケンウッド	159,500	199.00	31,740,500	
ミマキエンジニアリング	17,500	428.00	7,490,000	
第一精工	8,000	1,899.00	15,192,000	貸付有価証券 3,200株
日新電機	45,900	873.00	40,070,700	貸付有価証券 1,000株
大崎電気工業	38,900	546.00	21,239,400	
オムロン	175,500	5,720.00	1,003,860,000	
日東工業	28,700	1,804.00	51,774,800	
I D E C	28,300	1,340.00	37,922,000	
正興電機製作所	4,600	904.00	4,158,400	
不二電機工業	2,400	1,123.00	2,695,200	
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	65,300	1,481.00	96,709,300	
サクサホールディングス	4,600	1,491.00	6,858,600	
メルコホールディングス	6,800	2,152.00	14,633,600	
テクノメディカ	4,400	1,884.00	8,289,600	
ダイヤモンドエレクト リックホールディング	3,200	486.00	1,555,200	貸付有価証券 200株
日本電気	237,400	3,915.00	929,421,000	
富士通	188,700	9,916.00	1,871,149,200	
沖電気工業	79,500	1,024.00	81,408,000	
岩崎通信機	8,600	834.00	7,172,400	
電気興業	9,400	2,498.00	23,481,200	
サンケン電気	21,400	2,122.00	45,410,800	
ナカヨ	3,800	1,518.00	5,768,400	
アイホン	11,100	1,502.00	16,672,200	貸付有価証券 100株
ルネサスエレクトロニク ス	935,700	394.00	368,665,800	貸付有価証券 8,700株
セイコーエプソン	242,800	1,229.00	298,401,200	貸付有価証券 400株
ワコム	131,600	322.00	42,375,200	貸付有価証券 100株
アルバック	36,000	2,613.00	94,068,000	貸付有価証券 17,100株
アクセル	8,200	655.00	5,371,000	貸付有価証券 1,400株

E I Z O	15,200	3,235.00	49,172,000	
日本信号	49,800	1,110.00	55,278,000	
京三製作所	45,800	473.00	21,663,400	貸付有価証券 20,000株
能美防災	25,900	2,092.00	54,182,800	
ホーチキ	14,200	1,436.00	20,391,200	
星和電機	9,700	529.00	5,131,300	貸付有価証券 200株
エレコム	21,600	3,685.00	79,596,000	
パナソニック	2,236,200	837.90	1,873,711,980	貸付有価証券 700株
シャープ	226,500	1,170.00	265,005,000	貸付有価証券 32,700株(5,700株)
アンリツ	126,000	2,038.00	256,788,000	貸付有価証券 60,700株(2,300株)
富士通ゼネラル	53,100	1,949.00	103,491,900	貸付有価証券 9,800株
ソニー	1,238,400	6,434.00	7,967,865,600	
T D K	94,500	8,420.00	795,690,000	貸付有価証券 100株
帝国通信工業	8,600	1,161.00	9,984,600	
タムラ製作所	65,400	387.00	25,309,800	
アルプスアルパイン	173,200	1,055.00	182,726,000	貸付有価証券 500株
池上通信機	6,200	854.00	5,294,800	
日本電波工業	17,700	349.00	6,177,300	貸付有価証券 4,800株
鈴木	9,600	694.00	6,662,400	
日本トリム	2,600	2,908.00	7,560,800	貸付有価証券 400株
ローランド ディー ジー	10,800	1,200.00	12,960,000	
フォスター電機	20,500	1,122.00	23,001,000	
S M K	5,000	2,364.00	11,820,000	
ヨコオ	12,700	2,040.00	25,908,000	
ティアック	14,100	153.00	2,157,300	貸付有価証券 100株
ホシデン	53,500	761.00	40,713,500	
ヒロセ電機	30,300	11,190.00	339,057,000	
日本航空電子工業	44,900	1,341.00	60,210,900	

TOA	21,000	843.00	17,703,000	
マクセルホールディングス	42,100	1,081.00	45,510,100	貸付有価証券 400株
古野電気	25,200	843.00	21,243,600	貸付有価証券 11,900株
ユニデンホールディングス	5,400	1,862.00	10,054,800	貸付有価証券 100株
スミダコーポレーション	15,000	650.00	9,750,000	
アイコム	10,800	2,555.00	27,594,000	貸付有価証券 4,000株
リオン	8,200	2,299.00	18,851,800	貸付有価証券 300株
本多通信工業	16,700	386.00	6,446,200	
船井電機	19,800	519.00	10,276,200	貸付有価証券 5,100株
横河電機	179,600	1,322.00	237,431,200	
新電元工業	6,900	2,402.00	16,573,800	
アズビル	123,500	2,870.00	354,445,000	
東亜ディーケーケー	9,700	945.00	9,166,500	
日本光電工業	80,900	4,335.00	350,701,500	
チノー	6,800	1,270.00	8,636,000	貸付有価証券 2,100株
共和電業	20,500	394.00	8,077,000	貸付有価証券 9,600株
日本電子材料	7,700	800.00	6,160,000	貸付有価証券 2,900株
堀場製作所	38,800	5,480.00	212,624,000	貸付有価証券 18,300株
アドバンテスト	145,500	4,295.00	624,922,500	貸付有価証券 200株
小野測器	8,200	510.00	4,182,000	
エスベック	17,300	1,667.00	28,839,100	
キーエンス	177,300	35,400.00	6,276,420,000	貸付有価証券 84,100株(8,600株)
日置電機	10,200	3,050.00	31,110,000	貸付有価証券 4,800株
シスメックス	139,900	7,994.00	1,118,360,600	貸付有価証券 700株
日本マイクロニクス	34,100	770.00	26,257,000	貸付有価証券 200株

メガチップス	18,200	1,554.00	28,282,800	貸付有価証券 4,400株
O B A R A G R O U P	10,100	2,360.00	23,836,000	
澤藤電機	2,400	1,308.00	3,139,200	
原田工業	9,300	837.00	7,784,100	貸付有価証券 500株
コーセル	26,000	1,006.00	26,156,000	貸付有価証券 1,700株
イリソ電子工業	16,400	3,090.00	50,676,000	貸付有価証券 200株
オブテックスグループ	32,100	1,016.00	32,613,600	貸付有価証券 15,200株
千代田インテグレ	9,000	1,677.00	15,093,000	貸付有価証券 4,100株
アイ・オー・データ機器	6,300	802.00	5,052,600	
レーザーテック	85,900	5,160.00	443,244,000	貸付有価証券 40,800株
スタンレー電気	137,600	2,175.00	299,280,000	
岩崎電気	7,600	1,309.00	9,948,400	
ウシオ電機	108,000	1,060.00	114,480,000	
岡谷電機産業	15,300	312.00	4,773,600	
ヘリオス テクノ ホールディング	18,000	344.00	6,192,000	貸付有価証券 8,300株（8,100株）
エノモト	5,800	813.00	4,715,400	
日本セラミック	19,900	1,879.00	37,392,100	貸付有価証券 9,400株
遠藤照明	9,900	577.00	5,712,300	
古河電池	14,000	560.00	7,840,000	貸付有価証券 4,000株
双信電機	9,500	353.00	3,353,500	貸付有価証券 1,900株
山一電機	14,200	1,353.00	19,212,600	
図研	12,700	2,306.00	29,286,200	
日本電子	38,600	2,518.00	97,194,800	
カシオ計算機	173,100	1,512.00	261,727,200	貸付有価証券 1,200株
ファナック	186,000	14,955.00	2,781,630,000	
日本シイエムケイ	46,000	451.00	20,746,000	貸付有価証券 1,500株（700株）
エンプラス	10,000	2,251.00	22,510,000	

大真空	7,100	1,459.00	10,358,900	貸付有価証券 2,700株(100株)
ローム	86,900	6,200.00	538,780,000	
浜松ホトニクス	140,400	4,590.00	644,436,000	貸付有価証券 1,400株
三井ハイテック	21,600	1,132.00	24,451,200	貸付有価証券 3,200株(200株)
新光電気工業	65,700	1,011.00	66,422,700	貸付有価証券 19,700株
京セラ	275,400	6,395.00	1,761,183,000	貸付有価証券 300株
太陽誘電	87,000	2,841.00	247,167,000	貸付有価証券 8,900株(200株)
村田製作所	574,900	5,453.00	3,134,929,700	
双葉電子工業	30,900	1,116.00	34,484,400	
北陸電気工業	7,900	940.00	7,426,000	
ニチコン	66,400	676.00	44,886,400	貸付有価証券 2,400株
日本ケミコン	14,900	1,224.00	18,237,600	
K O A	29,500	900.00	26,550,000	
市光工業	29,300	481.00	14,093,300	貸付有価証券 13,800株
小糸製作所	117,200	3,710.00	434,812,000	
ミツバ	36,000	460.00	16,560,000	貸付有価証券 100株
S C R E E Nホールディングス	34,000	3,985.00	135,490,000	貸付有価証券 400株
キャノン電子	20,500	1,598.00	32,759,000	貸付有価証券 9,700株
キャノン	1,053,600	2,441.00	2,571,837,600	貸付有価証券 500,100株(60,400株)
リコー	497,900	780.00	388,362,000	貸付有価証券 1,600株
象印マホービン	57,400	1,533.00	87,994,200	貸付有価証券 5,500株(900株)
M U T O Hホールディングス	2,500	1,579.00	3,947,500	
東京エレクトロン	124,200	20,295.00	2,520,639,000	貸付有価証券 200株
トヨタ紡織	57,000	1,315.00	74,955,000	

芦森工業	4,000	887.00	3,548,000	
ユニプレス	37,900	1,003.00	38,013,700	
豊田自動織機	158,400	5,370.00	850,608,000	
モリタホールディングス	34,200	1,705.00	58,311,000	
三櫻工業	24,800	724.00	17,955,200	貸付有価証券 11,200株
デンソー	430,900	3,590.00	1,546,931,000	
東海理化電機製作所	51,500	1,369.00	70,503,500	貸付有価証券 1,100株
三井E & Sホールディングス	70,700	539.00	38,107,300	貸付有価証券 7,800株
川崎重工業	152,300	1,613.00	245,659,900	
名村造船所	63,000	219.00	13,797,000	貸付有価証券 5,900株
サノヤスホールディングス	23,800	140.00	3,332,000	貸付有価証券 2,400株
日本車輛製造	7,100	2,799.00	19,872,900	貸付有価証券 500株
三菱ロジスネクスト	25,900	890.00	23,051,000	
近畿車輛	2,900	1,116.00	3,236,400	
日産自動車	2,308,300	384.90	888,464,670	貸付有価証券 966,400株（7,100株）
いすゞ自動車	567,100	745.10	422,546,210	
トヨタ自動車	2,183,900	6,797.00	14,843,968,300	
日野自動車	244,400	588.00	143,707,200	貸付有価証券 300株
三菱自動車工業	724,500	328.00	237,636,000	貸付有価証券 8,500株
エフテック	13,600	448.00	6,092,800	貸付有価証券 6,100株
レシップホールディングス	7,700	448.00	3,449,600	貸付有価証券 600株
GMB	3,500	553.00	1,935,500	
ファルテック	3,400	651.00	2,213,400	貸付有価証券 1,500株
武蔵精密工業	43,600	798.00	34,792,800	
日産車体	38,200	995.00	38,009,000	
新明和工業	52,700	1,145.00	60,341,500	貸付有価証券 1,800株
極東開発工業	36,400	1,275.00	46,410,000	

日信工業	39,800	2,211.00	87,997,800	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
トピー工業	16,100	1,363.00	21,944,300	
ティラド	7,100	1,315.00	9,336,500	
タチエス	32,100	1,026.00	32,934,600	貸付有価証券 14,300株
N O K	105,200	1,212.00	127,502,400	
フタバ産業	54,400	474.00	25,785,600	
K Y B	21,900	2,182.00	47,785,800	貸付有価証券 500株
大同メタル工業	37,500	557.00	20,887,500	貸付有価証券 300株
プレス工業	97,000	255.00	24,735,000	
ミクニ	24,800	258.00	6,398,400	
太平洋工業	41,000	990.00	40,590,000	
ケーヒン	45,000	2,542.00	114,390,000	
河西工業	26,400	548.00	14,467,200	貸付有価証券 12,400株
アイシン精機	161,200	2,842.00	458,130,400	
マツダ	575,900	606.00	348,995,400	
今仙電機製作所	18,200	715.00	13,013,000	
本田技研工業	1,541,000	2,541.00	3,915,681,000	
スズキ	387,900	2,800.00	1,086,120,000	
S U B A R U	607,600	2,180.00	1,324,568,000	貸付有価証券 100株
安永	9,400	1,003.00	9,428,200	貸付有価証券 2,000株（500株）
ヤマハ発動機	255,200	1,350.00	344,520,000	貸付有価証券 120,800株
ショーワ	46,200	2,259.00	104,365,800	
T B K	23,200	476.00	11,043,200	
エクセディ	26,600	1,672.00	44,475,200	
豊田合成	63,200	1,934.00	122,228,800	
愛三工業	30,600	525.00	16,065,000	貸付有価証券 800株
盟和産業	3,000	877.00	2,631,000	
日本プラスト	15,300	457.00	6,992,100	
ヨロズ	18,300	1,108.00	20,276,400	
エフ・シー・シー	32,000	1,585.00	50,720,000	

シマノ	73,200	16,040.00	1,174,128,000	貸付有価証券 12,700株(10,300株)
テイ・エス テック	45,500	2,701.00	122,895,500	
ジャムコ	9,800	715.00	7,007,000	貸付有価証券 2,300株
テルモ	553,800	3,704.00	2,051,275,200	貸付有価証券 500株
クリエートメディック	6,500	1,112.00	7,228,000	貸付有価証券 3,000株
日機装	58,700	803.00	47,136,100	貸付有価証券 27,800株
日本エム・ディ・エム	11,300	1,657.00	18,724,100	
島津製作所	233,900	2,950.00	690,005,000	貸付有価証券 1,600株
JMS	16,500	918.00	15,147,000	
クボテック	5,000	294.00	1,470,000	貸付有価証券 500株
長野計器	14,200	822.00	11,672,400	
ブイ・テクノロジー	9,200	3,230.00	29,716,000	貸付有価証券 1,900株
東京計器	12,500	729.00	9,112,500	
愛知時計電機	2,600	4,100.00	10,660,000	
インターアクション	10,500	2,082.00	21,861,000	貸付有価証券 100株
オーバル	17,500	220.00	3,850,000	貸付有価証券 100株
東京精密	35,500	2,946.00	104,583,000	
マニー	78,000	2,710.00	211,380,000	貸付有価証券 37,000株(2,700株)
ニコン	316,700	1,009.00	319,550,300	貸付有価証券 900株
トプコン	98,600	836.00	82,429,600	貸付有価証券 1,300株
オリンパス	1,083,000	1,506.00	1,630,998,000	貸付有価証券 600株
理研計器	17,300	2,262.00	39,132,600	
タムロン	15,800	1,879.00	29,688,200	貸付有価証券 7,500株
HOYA	390,800	9,652.00	3,772,001,600	
シード	8,300	838.00	6,955,400	
ノーリツ鋼機	13,200	902.00	11,906,400	貸付有価証券

				200株
エー・アンド・デイ	17,800	646.00	11,498,800	
朝日インテック	166,200	2,694.00	447,742,800	貸付有価証券 78,800株
シチズン時計	229,200	386.00	88,471,200	貸付有価証券 5,800株(300株)
リズム時計工業	6,100	655.00	3,995,500	
大研医器	13,500	680.00	9,180,000	
メニコン	27,700	4,905.00	135,868,500	貸付有価証券 200株
シンシア	2,100	361.00	758,100	
松風	8,800	1,852.00	16,297,600	
セイコーホールディングス	27,700	1,800.00	49,860,000	貸付有価証券 800株
ニプロ	135,400	1,317.00	178,321,800	
中本パックス	5,000	1,271.00	6,355,000	
スノーピーク	10,200	720.00	7,344,000	貸付有価証券 600株
パラマウントベッドホールディングス	20,600	4,580.00	94,348,000	貸付有価証券 100株
トランザクション	12,500	857.00	10,712,500	
粧美堂	5,700	358.00	2,040,600	
ニホンフラッシュ	18,300	1,021.00	18,684,300	貸付有価証券 3,400株
前田工織	21,600	2,080.00	44,928,000	貸付有価証券 4,900株(3,200株)
永大産業	25,600	282.00	7,219,200	貸付有価証券 100株(100株)
アートネイチャー	20,900	656.00	13,710,400	
バンダイナムコホールディングス	202,400	5,385.00	1,089,924,000	貸付有価証券 300株
アイフィスジャパン	5,000	719.00	3,595,000	貸付有価証券 500株(500株)
共立印刷	32,600	156.00	5,085,600	貸付有価証券 200株
SHOEI	18,800	2,252.00	42,337,600	貸付有価証券 2,200株(1,400株)
フランスベッドホールディングス	27,700	922.00	25,539,400	貸付有価証券 13,000株
パイロットコーポレー	31,900	3,755.00	119,784,500	貸付有価証券

ション				15,100株
萩原工業	10,900	1,404.00	15,303,600	
トッパン・フォームズ	41,900	984.00	41,229,600	
フジシールインターナショナル	43,900	2,006.00	88,063,400	貸付有価証券 13,900株
タカラトミー	87,800	782.00	68,659,600	貸付有価証券 700株
廣済堂	13,600	713.00	9,696,800	
エステールホールディングス	5,200	609.00	3,166,800	貸付有価証券 2,300株
アーク	74,700	75.00	5,602,500	貸付有価証券 700株
タカノ	7,600	784.00	5,958,400	
プロネクサス	16,800	1,087.00	18,261,600	
ホクシン	12,100	116.00	1,403,600	
ウッドワン	6,600	1,020.00	6,732,000	
大建工業	13,200	1,713.00	22,611,600	
凸版印刷	276,300	1,716.00	474,130,800	
大日本印刷	256,100	2,470.00	632,567,000	貸付有価証券 500株
共同印刷	6,000	2,779.00	16,674,000	
N I S S H A	40,200	730.00	29,346,000	貸付有価証券 900株
光村印刷	1,700	1,325.00	2,252,500	
TAKARA & COMPANY	9,400	1,741.00	16,365,400	
アシックス	161,500	1,022.00	165,053,000	貸付有価証券 76,600株
ツツミ	6,100	1,726.00	10,528,600	貸付有価証券 2,800株
小松ウオール工業	6,000	1,987.00	11,922,000	貸付有価証券 100株
ヤマハ	116,400	4,315.00	502,266,000	貸付有価証券 2,500株
河合楽器製作所	6,000	2,385.00	14,310,000	
クリナップ	18,200	557.00	10,137,400	
ピジョン	118,300	4,220.00	499,226,000	貸付有価証券 56,100株(4,800株)
オリバー	4,100	3,250.00	13,325,000	貸付有価証券 500株

兼松サステック	1,300	1,420.00	1,846,000	
キングジム	16,300	842.00	13,724,600	
リンテック	46,500	2,252.00	104,718,000	
イトーキ	41,600	337.00	14,019,200	貸付有価証券 19,700株
任天堂	120,000	40,930.00	4,911,600,000	
三菱鉛筆	32,200	1,547.00	49,813,400	貸付有価証券 15,200株
タカラスタANDARD	40,400	1,712.00	69,164,800	
コクヨ	93,900	1,580.00	148,362,000	貸付有価証券 20,100株
ナカバヤシ	19,200	560.00	10,752,000	
グローブライド	8,800	1,895.00	16,676,000	貸付有価証券 300株
オカムラ	68,300	882.00	60,240,600	
美津濃	17,800	1,933.00	34,407,400	
東京電力ホールディングス	1,562,400	399.00	623,397,600	貸付有価証券 725,400株
中部電力	598,800	1,560.00	934,128,000	
関西電力	741,600	1,222.00	906,235,200	
中国電力	282,300	1,537.00	433,895,100	
北陸電力	178,900	802.00	143,477,800	貸付有価証券 10,800株
東北電力	488,900	1,070.00	523,123,000	
四国電力	176,200	888.00	156,465,600	貸付有価証券 200株
九州電力	403,400	889.00	358,622,600	貸付有価証券 800株
北海道電力	183,200	488.00	89,401,600	
沖縄電力	36,200	1,983.00	71,784,600	
電源開発	155,700	2,329.00	362,625,300	
エフオン	10,500	455.00	4,777,500	
イーレックス	27,900	1,230.00	34,317,000	貸付有価証券 100株
レノバ	32,700	917.00	29,985,900	貸付有価証券 5,800株
東京瓦斯	376,400	2,646.50	996,142,600	
大阪瓦斯	379,800	2,097.00	796,440,600	
東邦瓦斯	96,300	5,210.00	501,723,000	貸付有価証券

				100株
北海道瓦斯	10,500	1,503.00	15,781,500	貸付有価証券 100株
広島ガス	40,300	370.00	14,911,000	
西部瓦斯	22,000	2,690.00	59,180,000	
静岡ガス	55,600	943.00	52,430,800	貸付有価証券 25,900株
メタウォーター	9,500	4,030.00	38,285,000	
SBSホールディングス	16,900	1,802.00	30,453,800	貸付有価証券 8,000株
東武鉄道	206,400	3,840.00	792,576,000	
相鉄ホールディングス	62,600	2,889.00	180,851,400	
東急	493,600	1,734.00	855,902,400	
京浜急行電鉄	251,400	1,929.00	484,950,600	貸付有価証券 1,500株(1,200株)
小田急電鉄	291,100	2,472.00	719,599,200	貸付有価証券 700株
京王電鉄	101,600	6,580.00	668,528,000	貸付有価証券 3,400株
京成電鉄	136,200	3,205.00	436,521,000	
富士急行	26,700	2,884.00	77,002,800	貸付有価証券 12,500株
新京成電鉄	5,000	2,248.00	11,240,000	
東日本旅客鉄道	344,500	8,522.00	2,935,829,000	
西日本旅客鉄道	174,400	7,697.00	1,342,356,800	
東海旅客鉄道	162,700	17,875.00	2,908,262,500	
西武ホールディングス	262,600	1,249.00	327,987,400	
鴻池運輸	31,100	1,190.00	37,009,000	
西日本鉄道	54,300	2,749.00	149,270,700	貸付有価証券 2,900株(1,600株)
ハマキョウレックス	15,000	2,695.00	40,425,000	
サカイ引越センター	10,300	5,890.00	60,667,000	
近鉄グループホールディングス	185,400	5,270.00	977,058,000	貸付有価証券 300株
阪急阪神ホールディングス	247,200	3,815.00	943,068,000	
南海電気鉄道	87,900	2,514.00	220,980,600	貸付有価証券 40,900株
京阪ホールディングス	82,500	4,970.00	410,025,000	
神戸電鉄	4,400	3,870.00	17,028,000	貸付有価証券

				1,900株
名古屋鉄道	152,400	3,140.00	478,536,000	貸付有価証券 200株
山陽電気鉄道	13,200	2,092.00	27,614,400	貸付有価証券 6,200株
日本通運	65,500	5,300.00	347,150,000	
ヤマトホールディングス	324,900	1,765.00	573,448,500	
山九	51,500	4,370.00	225,055,000	
丸運	10,600	238.00	2,522,800	貸付有価証券 200株
丸全昭和運輸	15,000	2,313.00	34,695,000	
センコーグループホールディングス	102,200	859.00	87,789,800	貸付有価証券 600株
トナミホールディングス	4,400	4,580.00	20,152,000	
ニッコンホールディングス	66,300	2,172.00	144,003,600	
日本石油輸送	2,000	2,652.00	5,304,000	
福山通運	23,700	3,840.00	91,008,000	
セイノーホールディングス	138,800	1,224.00	169,891,200	
エスライン	5,600	882.00	4,939,200	
神奈川中央交通	4,600	4,105.00	18,883,000	貸付有価証券 100株
日立物流	34,000	2,405.00	81,770,000	貸付有価証券 2,300株
丸和運輸機関	19,500	2,526.00	49,257,000	貸付有価証券 2,700株
C & F ロジホールディングス	18,700	1,348.00	25,207,600	
九州旅客鉄道	162,500	3,110.00	505,375,000	
S Gホールディングス	194,600	2,525.00	491,365,000	
日本郵船	155,000	1,336.00	207,080,000	貸付有価証券 800株
商船三井	117,300	1,789.00	209,849,700	
川崎汽船	57,100	844.00	48,192,400	貸付有価証券 21,600株
N S ユナイテッド海運	10,200	1,444.00	14,728,800	貸付有価証券 100株
明治海運	19,700	348.00	6,855,600	
飯野海運	87,700	325.00	28,502,500	

共栄タンカー	3,300	807.00	2,663,100	
乾汽船	10,700	1,267.00	13,556,900	貸付有価証券 1,400株
日本航空	333,700	2,069.00	690,425,300	
A N Aホールディングス	338,800	2,700.00	914,760,000	貸付有価証券 81,600株（17,500株）
パスコ	3,600	1,442.00	5,191,200	貸付有価証券 200株
トランコム	5,200	7,150.00	37,180,000	
日新	16,000	1,692.00	27,072,000	
三菱倉庫	58,800	2,200.00	129,360,000	貸付有価証券 10,300株（5,400株）
三井倉庫ホールディングス	21,200	1,478.00	31,333,600	貸付有価証券 100株
住友倉庫	68,200	1,217.00	82,999,400	
澁澤倉庫	10,200	2,089.00	21,307,800	
東陽倉庫	33,500	352.00	11,792,000	貸付有価証券 200株
日本トランスシティ	40,800	494.00	20,155,200	
ケイヒン	3,600	1,136.00	4,089,600	
中央倉庫	11,300	1,176.00	13,288,800	
川西倉庫	3,400	906.00	3,080,400	
安田倉庫	15,200	861.00	13,087,200	貸付有価証券 7,100株
ファイズホールディングス	3,900	870.00	3,393,000	貸付有価証券 1,100株
東洋埠頭	5,600	1,323.00	7,408,800	
宇徳	15,800	539.00	8,516,200	
上組	103,400	1,878.00	194,185,200	
サンリツ	4,400	527.00	2,318,800	
キムラユニティー	5,000	972.00	4,860,000	
キューソー流通システム	4,600	1,674.00	7,700,400	
近鉄エクスプレス	39,400	1,590.00	62,646,000	
東海運	10,500	250.00	2,625,000	貸付有価証券 4,900株
エーアイティー	13,100	786.00	10,296,600	
内外トランスライン	6,500	1,108.00	7,202,000	
日本コンセプト	5,900	1,341.00	7,911,900	
N E C ネットエスアイ	18,100	4,350.00	78,735,000	

クロスキャット	5,000	757.00	3,785,000	
システナ	68,500	1,470.00	100,695,000	貸付有価証券 500株
デジタルアーツ	9,400	4,570.00	42,958,000	
日鉄ソリューションズ	28,800	2,686.00	77,356,800	
キューブシステム	10,200	608.00	6,201,600	
エイジア	3,500	1,179.00	4,126,500	
コア	8,100	1,203.00	9,744,300	
ソリトンシステムズ	8,400	1,123.00	9,433,200	貸付有価証券 1,200株（200株）
ソフトクリエイトホールディングス	8,400	1,717.00	14,422,800	
T I S	192,000	1,821.00	349,632,000	貸付有価証券 1,200株
ネオス	7,700	512.00	3,942,400	貸付有価証券 3,500株
電算システム	7,300	2,134.00	15,578,200	
グリー	117,800	404.00	47,591,200	貸付有価証券 55,900株
コーエーテクモホールディングス	39,300	2,683.00	105,441,900	
三菱総合研究所	8,200	3,310.00	27,142,000	
ボルテージ	4,500	300.00	1,350,000	貸付有価証券 1,300株（1,200株）
電算	2,100	2,021.00	4,244,100	貸付有価証券 900株
A G S	10,800	797.00	8,607,600	
ファインデックス	16,200	675.00	10,935,000	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
ブレインパッド	4,900	4,190.00	20,531,000	貸付有価証券 2,000株
K L a b	37,100	673.00	24,968,300	貸付有価証券 14,100株（2,400株）
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	23,200	779.00	18,072,800	貸付有価証券 10,900株
イーブクイニシアティブジャパン	2,800	1,133.00	3,172,400	貸付有価証券 400株
ネクソン	535,500	1,837.00	983,713,500	貸付有価証券 251,400株
アイスタイル	53,800	219.00	11,782,200	貸付有価証券 19,100株（900株）

エムアップ	5,500	2,137.00	11,753,500	貸付有価証券 1,700株（1,400株）
エイチーム	13,200	590.00	7,788,000	
エニグモ	13,600	806.00	10,961,600	貸付有価証券 6,300株（5,800株）
テクノスジャパン	14,900	334.00	4,976,600	
e n i s h	8,600	387.00	3,328,200	貸付有価証券 3,600株（800株）
コロブラ	63,000	829.00	52,227,000	貸付有価証券 18,800株（2,200株）
オルトプラス	14,300	595.00	8,508,500	貸付有価証券 6,600株（100株）
ブロードリーフ	95,200	474.00	45,124,800	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	263.00	2,235,500	貸付有価証券 100株
デジタルハーツホール ディングス	10,200	729.00	7,435,800	
システム情報	9,700	616.00	5,975,200	貸付有価証券 1,100株
メディアドゥホールディ ングス	6,000	3,040.00	18,240,000	貸付有価証券 2,800株
じげん	47,500	268.00	12,730,000	貸付有価証券 300株
ブイキューブ	11,800	1,083.00	12,779,400	貸付有価証券 5,500株（1,700株）
エンカレッジ・テクノロ ジ	3,200	635.00	2,032,000	
サイバーリンクス	2,900	907.00	2,630,300	
ディー・エル・イー	15,400	111.00	1,709,400	貸付有価証券 6,000株（3,200株）
フィックスターズ	20,400	1,001.00	20,420,400	貸付有価証券 2,400株
C A R T A H O L D I N G S	9,300	839.00	7,802,700	
オブティム	10,000	2,048.00	20,480,000	貸付有価証券 4,600株（1,200株）
セレス	6,300	694.00	4,372,200	貸付有価証券 800株
S H I F T	5,100	6,900.00	35,190,000	貸付有価証券 2,100株
ティーガイア	17,000	2,066.00	35,122,000	

セック	2,800	2,676.00	7,492,800	
日本アジアグループ	20,200	251.00	5,070,200	貸付有価証券 800株
豆蔵ホールディングス	2,400	1,860.00	4,464,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
テクマトリックス	13,500	2,150.00	29,025,000	
プロシップ	5,600	1,069.00	5,986,400	
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	46,300	1,529.00	70,792,700	貸付有価証券 21,200株
GMOペイメントゲート ウェイ	31,600	7,700.00	243,320,000	貸付有価証券 14,800株(3,800株)
ザッパラス	8,300	300.00	2,490,000	
システムリサーチ	5,100	1,430.00	7,293,000	
インターネットイニシア ティブ	28,400	3,410.00	96,844,000	
さくらインターネット	20,600	466.00	9,599,600	貸付有価証券 400株
ヴィンクス	5,400	687.00	3,709,800	貸付有価証券 400株(100株)
GMOクラウド	3,600	1,625.00	5,850,000	貸付有価証券 600株
SRAホールディングス	10,200	2,131.00	21,736,200	
システムインテグレータ	6,100	602.00	3,672,200	
朝日ネット	13,600	691.00	9,397,600	
eBASE	22,900	727.00	16,648,300	貸付有価証券 200株
アバント	13,700	804.00	11,014,800	貸付有価証券 3,500株
アドソル日進	6,800	2,149.00	14,613,200	
フリービット	10,000	621.00	6,210,000	貸付有価証券 4,700株(3,600株)
コムチュア	21,600	2,104.00	45,446,400	貸付有価証券 300株
サイバーコム	3,400	1,669.00	5,674,600	貸付有価証券 1,500株
アステリア	11,700	311.00	3,638,700	貸付有価証券 100株
アイル	6,800	1,268.00	8,622,400	貸付有価証券 3,100株(2,200株)
マークラインズ	9,600	1,606.00	15,417,600	
メディカル・データ・ピ	14,600	653.00	9,533,800	貸付有価証券

ジョン				3,700株
g u m i	24,600	605.00	14,883,000	
ショーケース	4,500	422.00	1,899,000	
モバイルファクトリー	4,300	1,036.00	4,454,800	貸付有価証券 1,500株(200株)
テラスカイ	6,900	2,427.00	16,746,300	貸付有価証券 100株
デジタル・インフォメー ション・テクノロジー	7,500	1,178.00	8,835,000	貸付有価証券 500株
P C Iホールディングス	7,800	915.00	7,137,000	
パイプドHD	2,500	1,121.00	2,802,500	貸付有価証券 1,100株(700株)
アイビーシー	3,500	776.00	2,716,000	
ネオジャパン	3,600	880.00	3,168,000	
P R T I M E S	1,600	1,686.00	2,697,600	
ランドコンピュータ	2,900	933.00	2,705,700	
ダブルスタンダード	2,500	3,790.00	9,475,000	貸付有価証券 800株
オープンドア	9,500	746.00	7,087,000	貸付有価証券 4,400株
マイネット	6,200	650.00	4,030,000	貸付有価証券 200株
アカツキ	6,800	3,575.00	24,310,000	貸付有価証券 1,200株
ベネフィットジャパン	1,400	1,263.00	1,768,200	貸付有価証券 600株
U b i c o mホールディ ングス	4,300	1,394.00	5,994,200	貸付有価証券 1,900株(1,300株)
L I N E	44,000	5,220.00	229,680,000	貸付有価証券 10,300株(7,500株)
カナミックネットワーク	11,700	501.00	5,861,700	
ノムラシステムコーポ レーション	4,200	342.00	1,436,400	貸付有価証券 300株
チェンジ	3,800	2,816.00	10,700,800	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
シンクロ・フード	8,200	195.00	1,599,000	貸付有価証券 500株(500株)
オークネット	11,800	1,316.00	15,528,800	
セグエグループ	3,100	747.00	2,315,700	貸付有価証券 600株
エイトレッド	2,400	1,182.00	2,836,800	貸付有価証券

				300株(200株)
AOI TYO Holdings	19,400	442.00	8,574,800	貸付有価証券 100株
マクロミル	39,200	603.00	23,637,600	
ビーグリー	3,700	1,312.00	4,854,400	
オロ	5,000	2,646.00	13,230,000	貸付有価証券 200株(200株)
ユーザーローカル	1,400	2,374.00	3,323,600	
テモナ	2,600	570.00	1,482,000	
ニーズウェル	2,300	507.00	1,166,100	
サインポスト	3,000	1,290.00	3,870,000	貸付有価証券 1,100株(800株)
ソルクシーズ	8,100	546.00	4,422,600	
フェイス	6,700	570.00	3,819,000	
プロトコーポレーション	17,200	876.00	15,067,200	
ハイマックス	2,300	1,820.00	4,186,000	貸付有価証券 1,000株
野村総合研究所	272,200	2,410.00	656,002,000	
サイバネットシステム	13,600	564.00	7,670,400	貸付有価証券 1,400株(400株)
CEホールディングス	11,000	410.00	4,510,000	
日本システム技術	3,100	1,012.00	3,137,200	
インテージホールディングス	24,000	828.00	19,872,000	貸付有価証券 11,300株
東邦システムサイエンス	5,100	903.00	4,605,300	
ソースネクスト	91,100	289.00	26,327,900	貸付有価証券 42,700株(17,000株)
インフォコム	21,000	2,404.00	50,484,000	
HEROZ	2,000	2,746.00	5,492,000	貸付有価証券 900株
ラクスル	10,200	2,269.00	23,143,800	貸付有価証券 1,900株
FIG	20,800	219.00	4,555,200	貸付有価証券 1,100株
システムサポート	1,600	2,253.00	3,604,800	貸付有価証券 300株
イーソル	6,800	997.00	6,779,600	貸付有価証券 400株
アルテリア・ネットワークス	21,300	1,819.00	38,744,700	

東海ソフト	1,300	1,078.00	1,401,400	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	4,400	773.00	3,401,200	
フォーカスシステムズ	11,900	687.00	8,175,300	貸付有価証券 400株
クレスコ	11,700	1,447.00	16,929,900	
フジ・メディア・ホールディングス	185,000	1,109.00	205,165,000	
オービック	66,600	14,660.00	976,356,000	
ジャストシステム	31,200	4,840.00	151,008,000	
TDCソフト	16,800	796.00	13,372,800	
Zホールディングス	2,637,400	345.00	909,903,000	
トレンドマイクロ	85,400	5,400.00	461,160,000	貸付有価証券 40,500株(3,500株)
IDホールディングス	7,300	1,387.00	10,125,100	
日本オラクル	38,900	9,300.00	361,770,000	貸付有価証券 300株
アルファシステムズ	6,000	2,900.00	17,400,000	
フューチャー	23,200	1,457.00	33,802,400	貸付有価証券 11,000株
CAC Holdings	12,500	971.00	12,137,500	貸付有価証券 5,900株
SBテクノロジー	6,900	2,092.00	14,434,800	貸付有価証券 1,400株
トーセ	5,200	720.00	3,744,000	
オービックビジネスコンサルティング	19,600	4,545.00	89,082,000	貸付有価証券 8,600株
伊藤忠テクノソリューションズ	87,500	3,150.00	275,625,000	貸付有価証券 900株
アイティフォー	23,200	565.00	13,108,000	
東計電算	2,800	3,830.00	10,724,000	
エクスネット	3,000	920.00	2,760,000	
大塚商会	103,900	4,575.00	475,342,500	貸付有価証券 48,900株(5,100株)
サイボウズ	22,400	1,747.00	39,132,800	貸付有価証券 9,400株
ソフトブレーン	11,300	381.00	4,305,300	貸付有価証券 600株
電通国際情報サービス	11,900	3,915.00	46,588,500	貸付有価証券 5,600株

A C C E S S	17,900	868.00	15,537,200	貸付有価証券 8,200株(2,800株)
デジタルガレージ	34,600	3,425.00	118,505,000	貸付有価証券 200株
E Mシステムズ	27,000	908.00	24,516,000	貸付有価証券 3,200株(2,500株)
ウェザーニューズ	6,500	3,540.00	23,010,000	
C I J	13,100	785.00	10,283,500	貸付有価証券 6,200株
ビジネスエンジニアリン グ	2,200	2,464.00	5,420,800	
日本エンタープライズ	19,500	208.00	4,056,000	貸付有価証券 500株
WOWOW	9,200	2,491.00	22,917,200	貸付有価証券 400株
スカラ	12,800	413.00	5,286,400	
インテリジェント ウェ イブ	8,400	492.00	4,132,800	
I M A G I C A G R O U P	16,300	359.00	5,851,700	貸付有価証券 600株
ネットワンシステムズ	73,200	2,216.00	162,211,200	貸付有価証券 2,200株
システムソフト	45,500	65.00	2,957,500	貸付有価証券 200株
アルゴグラフィックス	16,300	3,670.00	59,821,000	
マーベラス	29,300	547.00	16,027,100	
エイベックス	33,000	850.00	28,050,000	
日本ユニシス	60,000	2,910.00	174,600,000	
兼松エレクトロニクス	10,400	3,380.00	35,152,000	
東京放送ホールディング ス	116,800	1,625.00	189,800,000	貸付有価証券 54,800株(2,700株)
日本テレビホールディン グス	160,300	1,300.00	208,390,000	
朝日放送グループホール ディングス	19,100	701.00	13,389,100	貸付有価証券 100株
テレビ朝日ホールディン グス	52,800	1,722.00	90,921,600	貸付有価証券 23,700株
スカパーJ S A Tホール ディングス	126,300	393.00	49,635,900	貸付有価証券 200株
テレビ東京ホールディン グス	15,700	2,561.00	40,207,700	

日本BS放送	6,500	1,021.00	6,636,500	
ビジョン	17,900	665.00	11,903,500	貸付有価証券 1,800株
スマートバリュー	5,000	827.00	4,135,000	貸付有価証券 300株(300株)
USEN-NEXT HOLDINGS	7,300	1,375.00	10,037,500	貸付有価証券 3,400株(1,600株)
ワイヤレスゲート	9,100	378.00	3,439,800	貸付有価証券 4,100株(800株)
コネクシオ	10,900	1,382.00	15,063,800	
日本通信	149,700	159.00	23,802,300	貸付有価証券 43,800株(31,700株)
クロップス	3,500	479.00	1,676,500	
日本電信電話	2,567,300	2,715.00	6,970,219,500	
KDDI	1,431,300	3,211.00	4,595,904,300	貸付有価証券 1,900株
ソフトバンク	1,745,400	1,354.50	2,364,144,300	貸付有価証券 58,100株(21,100株)
光通信	19,800	19,190.00	379,962,000	
NTTドコモ	1,418,700	3,473.00	4,927,145,100	貸付有価証券 100株
エムティーアイ	18,600	554.00	10,304,400	
GMOインターネット	75,700	1,811.00	137,092,700	
ファイバーゲート	4,600	1,055.00	4,853,000	貸付有価証券 2,100株(800株)
アйдママーケティング コミュニケーション	5,800	365.00	2,117,000	
KADOKAWA	51,700	1,372.00	70,932,400	
学研ホールディングス	25,800	1,913.00	49,355,400	貸付有価証券 1,200株
ゼンリン	38,300	1,117.00	42,781,100	貸付有価証券 1,700株
昭文社	8,800	382.00	3,361,600	貸付有価証券 200株
インプレスホールディングス	15,900	131.00	2,082,900	貸付有価証券 200株
アイネット	9,900	1,379.00	13,652,100	貸付有価証券 100株
松竹	12,700	12,320.00	156,464,000	貸付有価証券 5,900株(400株)
東宝	113,300	3,285.00	372,190,500	貸付有価証券

				34,300株
東映	7,200	13,590.00	97,848,000	貸付有価証券 2,300株
エヌ・ティ・ティ・デー タ	511,300	1,043.00	533,285,900	貸付有価証券 900株
ピー・シー・エー	2,500	2,993.00	7,482,500	貸付有価証券 1,100株(700株)
ビジネスブレイン太田昭 和	3,300	2,648.00	8,738,400	
D T S	42,900	1,935.00	83,011,500	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	81,900	4,845.00	396,805,500	
シーイーシー	20,600	1,382.00	28,469,200	貸付有価証券 9,700株(1,100株)
カブコン	90,500	3,465.00	313,582,500	
アイ・エス・ピー	3,700	1,371.00	5,072,700	
ジャステック	12,200	1,056.00	12,883,200	貸付有価証券 5,700株
S C S K	44,300	4,885.00	216,405,500	
日本システムウエア	6,300	1,760.00	11,088,000	
アイネス	18,900	1,389.00	26,252,100	
T K C	16,200	5,090.00	82,458,000	
富士ソフト	24,600	3,545.00	87,207,000	貸付有価証券 11,600株(200株)
N S D	61,700	1,507.00	92,981,900	貸付有価証券 16,000株
コナミホールディングス	69,800	3,305.00	230,689,000	
福井コンピュータホール ディングス	7,500	2,217.00	16,627,500	
J B C Cホールディング ス	13,000	1,682.00	21,866,000	
ミロク情報サービス	16,900	2,394.00	40,458,600	貸付有価証券 1,000株
ソフトバンクグループ	1,523,900	3,693.00	5,627,762,700	貸付有価証券 2,400株
ハウスイ	1,500	694.00	1,041,000	
高千穂交易	7,400	984.00	7,281,600	貸付有価証券 3,400株(500株)
伊藤忠食品	4,800	4,315.00	20,712,000	
エレマテック	18,000	811.00	14,598,000	

JALUX	5,400	1,555.00	8,397,000	貸付有価証券 2,500株
あらた	15,300	4,745.00	72,598,500	
トーメンデバイス	2,900	3,480.00	10,092,000	
東京エレクトロン デ バイ ス	7,000	2,191.00	15,337,000	
フィールズ	14,800	298.00	4,410,400	貸付有価証券 2,100株
双日	1,064,700	263.00	280,016,100	
アルフレッサ ホール ディングス	214,200	2,241.00	480,022,200	
横浜冷凍	54,000	984.00	53,136,000	
神栄	2,600	588.00	1,528,800	
ラサ商事	10,200	824.00	8,404,800	
ラクーンホールディング ス	8,500	490.00	4,165,000	貸付有価証券 2,000株(1,800株)
アルコニックス	20,500	1,094.00	22,427,000	
神戸物産	66,500	4,390.00	291,935,000	貸付有価証券 31,200株
あい ホールディングス	27,500	1,344.00	36,960,000	貸付有価証券 13,000株
ディーブイエックス	6,900	906.00	6,251,400	貸付有価証券 3,100株
ダイワボウホールディ ングス	16,400	5,250.00	86,100,000	
マクニカ・富士エレホ ールディングス	46,000	1,363.00	62,698,000	貸付有価証券 20,600株
ラクト・ジャパン	7,200	3,360.00	24,192,000	貸付有価証券 3,000株
バイタルケーエスケー ・ ホールディングス	36,300	1,125.00	40,837,500	
八洲電機	14,900	825.00	12,292,500	
メディアスホールディ ングス	10,900	849.00	9,254,100	
レスターホールディ ングス	20,100	1,538.00	30,913,800	
ジューテックホールディ ングス	4,400	937.00	4,122,800	貸付有価証券 1,200株
大光	8,200	610.00	5,002,000	
OCHIホールディ ングス	5,600	1,519.00	8,506,400	貸付有価証券 2,600株

TO K A Iホールディングス	101,900	957.00	97,518,300	貸付有価証券 1,500株
黒谷	4,400	347.00	1,526,800	
C o m i n i x	3,300	688.00	2,270,400	貸付有価証券 1,500株
三洋貿易	19,400	867.00	16,819,800	
ビューティガレージ	3,100	1,221.00	3,785,100	
ウイン・パートナーズ	13,900	934.00	12,982,600	貸付有価証券 6,300株
ミタチ産業	5,800	544.00	3,155,200	
シップヘルスケアホールディングス	30,900	4,610.00	142,449,000	
明治電機工業	6,000	1,393.00	8,358,000	
デリカフーズホールディングス	6,800	670.00	4,556,000	
スターティアホールディングス	4,400	471.00	2,072,400	貸付有価証券 2,000株
コメダホールディングス	42,000	1,682.00	70,644,000	貸付有価証券 19,900株
ピーバンドットコム	1,400	759.00	1,062,600	貸付有価証券 100株
アセンテック	1,500	2,990.00	4,485,000	貸付有価証券 600株
富士興産	5,800	386.00	2,238,800	
協栄産業	2,100	1,046.00	2,196,600	
小野建	17,300	1,154.00	19,964,200	貸付有価証券 1,900株(1,200株)
南陽	4,200	1,315.00	5,523,000	
佐鳥電機	13,100	895.00	11,724,500	貸付有価証券 6,200株
エコトレーディング	4,400	494.00	2,173,600	貸付有価証券 700株
伯東	11,700	1,024.00	11,980,800	
コンドーテック	14,900	947.00	14,110,300	
中山福	11,100	487.00	5,405,700	貸付有価証券 100株
ナガイレーベン	27,900	2,666.00	74,381,400	貸付有価証券 100株
三菱食品	21,200	3,015.00	63,918,000	
松田産業	14,100	1,272.00	17,935,200	

第一興商	28,700	2,991.00	85,841,700	
メディopalホールディングス	208,000	2,183.00	454,064,000	貸付有価証券 1,100株
S P K	8,300	1,311.00	10,881,300	
萩原電気ホールディングス	7,100	2,218.00	15,747,800	
アズワン	12,600	9,660.00	121,716,000	貸付有価証券 100株
スズデン	6,700	1,227.00	8,220,900	貸付有価証券 3,000株
尾家産業	5,600	1,531.00	8,573,600	
シモジマ	11,800	1,188.00	14,018,400	
ドウシシャ	18,200	1,279.00	23,277,800	
小津産業	4,200	1,669.00	7,009,800	
高速	11,500	1,227.00	14,110,500	
たけびし	6,700	1,333.00	8,931,100	貸付有価証券 3,100株
リックス	4,300	1,569.00	6,746,700	
丸文	17,000	492.00	8,364,000	
ハピネット	16,100	1,109.00	17,854,900	貸付有価証券 100株
橋本総業ホールディングス	3,900	1,700.00	6,630,000	
日本ライフライン	57,100	1,381.00	78,855,100	
タカショー	9,400	432.00	4,060,800	
マルカ	6,800	1,904.00	12,947,200	貸付有価証券 3,200株
I D O M	52,000	386.00	20,072,000	貸付有価証券 11,600株（3,500株）
進和	11,400	1,769.00	20,166,600	
エスケイジャパン	4,100	284.00	1,164,400	
ダイトロン	8,100	1,499.00	12,141,900	貸付有価証券 3,800株
シークス	24,500	871.00	21,339,500	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
田中商事	5,900	664.00	3,917,600	
オーハシテクニカ	10,900	1,372.00	14,954,800	
白銅	6,900	1,205.00	8,314,500	
伊藤忠商事	1,348,300	2,313.00	3,118,617,900	貸付有価証券

				200株
丸紅	2,006,600	562.40	1,128,511,840	
高島	3,100	1,411.00	4,374,100	
長瀬産業	108,400	1,347.00	146,014,800	
蝶理	12,300	1,641.00	20,184,300	
豊田通商	215,100	2,587.00	556,463,700	
三共生興	29,200	523.00	15,271,600	
兼松	71,900	1,129.00	81,175,100	
ツカモトコーポレーション	3,500	1,066.00	3,731,000	
三井物産	1,694,300	1,570.00	2,660,051,000	
日本紙パルプ商事	11,000	3,840.00	42,240,000	
日立ハイテク	67,000	7,960.00	533,320,000	
カメイ	25,100	1,061.00	26,631,100	
東都水産	2,400	2,548.00	6,115,200	
OUGホールディングス	3,000	2,680.00	8,040,000	
スターゼン	7,100	4,550.00	32,305,000	
山善	75,300	969.00	72,965,700	
椿本興業	3,600	3,565.00	12,834,000	
住友商事	1,216,300	1,285.50	1,563,553,650	
内田洋行	8,200	3,630.00	29,766,000	貸付有価証券 3,800株
三菱商事	1,352,700	2,378.50	3,217,396,950	
第一実業	9,400	3,510.00	32,994,000	
キヤノンマーケティング ジャパン	55,100	2,199.00	121,164,900	貸付有価証券 26,100株
西華産業	10,900	1,146.00	12,491,400	
佐藤商事	15,900	866.00	13,769,400	
菱洋エレクトロ	19,500	2,051.00	39,994,500	貸付有価証券 9,100株(700株)
東京産業	17,400	528.00	9,187,200	貸付有価証券 400株
ユアサ商事	18,300	2,904.00	53,143,200	
神鋼商事	4,800	2,017.00	9,681,600	
小林産業	11,500	269.00	3,093,500	
阪和興業	36,000	1,737.00	62,532,000	貸付有価証券 700株
正栄食品工業	12,500	4,050.00	50,625,000	貸付有価証券

				2,400株(400株)
カナデン	15,600	1,270.00	19,812,000	貸付有価証券 7,300株
菱電商事	13,900	1,372.00	19,070,800	
フルサト工業	10,600	1,451.00	15,380,600	
岩谷産業	42,800	3,625.00	155,150,000	
すてきナイスグループ	8,200	971.00	7,962,200	貸付有価証券 100株
昭光通商	6,200	587.00	3,639,400	
二チモウ	3,000	1,627.00	4,881,000	
極東貿易	5,500	1,400.00	7,700,000	貸付有価証券 2,400株
イワキ	25,300	445.00	11,258,500	貸付有価証券 11,900株
三愛石油	47,500	1,185.00	56,287,500	
稲畑産業	42,400	1,211.00	51,346,400	貸付有価証券 2,900株
G S Iクレオス	4,700	1,028.00	4,831,600	
明和産業	17,800	507.00	9,024,600	貸付有価証券 4,200株
クワザワ	6,800	498.00	3,386,400	貸付有価証券 1,300株
ワキタ	41,100	1,011.00	41,552,100	貸付有価証券 19,200株
東邦ホールディングス	61,800	2,438.00	150,668,400	貸付有価証券 200株
サンゲツ	52,500	1,654.00	86,835,000	
ミツウロコグループホールディングス	28,400	1,178.00	33,455,200	
シナネンホールディングス	7,900	2,725.00	21,527,500	
伊藤忠エネクス	42,600	854.00	36,380,400	
サンリオ	54,100	1,476.00	79,851,600	貸付有価証券 25,400株(400株)
サンワテクノス	13,600	883.00	12,008,800	
リョーサン	21,300	2,467.00	52,547,100	
新光商事	30,200	916.00	27,663,200	
トーヨー	8,700	1,720.00	14,964,000	貸付有価証券 3,800株
三信電気	10,300	1,403.00	14,450,900	

東陽テクニカ	22,200	972.00	21,578,400	
モスフードサービス	25,300	2,607.00	65,957,100	貸付有価証券 11,700株
加賀電子	19,200	1,750.00	33,600,000	
ソーダニッカ	19,900	607.00	12,079,300	
立花エレテック	14,200	1,500.00	21,300,000	貸付有価証券 6,500株
フォーバル	8,400	1,083.00	9,097,200	
PALTAC	30,900	5,480.00	169,332,000	
三谷産業	25,300	321.00	8,121,300	
太平洋興発	7,600	664.00	5,046,400	
西本Wismettac ホールディングス	3,500	2,115.00	7,402,500	
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,700	1,712.00	2,910,400	
国際紙パルプ商事	45,600	266.00	12,129,600	
ヤマタネ	9,700	1,104.00	10,708,800	
丸紅建材リース	1,900	1,504.00	2,857,600	
日鉄物産	13,700	3,685.00	50,484,500	貸付有価証券 200株
泉州電業	5,900	2,520.00	14,868,000	
トラスコ中山	40,100	2,391.00	95,879,100	貸付有価証券 19,000株
オートバックスセブン	71,500	1,271.00	90,876,500	貸付有価証券 200株
モリト	14,000	739.00	10,346,000	
加藤産業	30,100	3,530.00	106,253,000	
北恵	3,700	730.00	2,701,000	
イノテック	11,400	879.00	10,020,600	
イエローハット	36,400	1,499.00	54,563,600	貸付有価証券 500株
J Kホールディングス	17,400	730.00	12,702,000	貸付有価証券 8,100株
日伝	17,400	2,149.00	37,392,600	
北沢産業	14,500	286.00	4,147,000	貸付有価証券 200株
杉本商事	10,400	1,867.00	19,416,800	
因幡電機産業	54,900	2,423.00	133,022,700	
東テク	6,400	1,901.00	12,166,400	

ミスミグループ本社	241,600	2,410.00	582,256,000	
アルテック	15,300	187.00	2,861,100	
タキヒヨー	5,800	1,670.00	9,686,000	貸付有価証券 200株
蔵王産業	3,700	1,380.00	5,106,000	
スズケン	81,600	4,350.00	354,960,000	貸付有価証券 1,000株
ジェコス	13,300	836.00	11,118,800	
グローセル	19,300	392.00	7,565,600	貸付有価証券 8,900株
ローソン	48,800	6,310.00	307,928,000	貸付有価証券 22,500株（1,500株）
サンエー	16,000	4,660.00	74,560,000	貸付有価証券 5,500株
カワチ薬品	14,900	2,517.00	37,503,300	貸付有価証券 7,000株
エービーシー・マート	30,100	5,460.00	164,346,000	貸付有価証券 14,200株（1,000株）
ハードオフコーポレーション	7,600	670.00	5,092,000	
アスクル	20,100	3,360.00	67,536,000	貸付有価証券 400株
ゲオホールディングス	34,700	1,365.00	47,365,500	貸付有価証券 1,800株
アダストリア	26,700	1,291.00	34,469,700	貸付有価証券 12,500株（1,700株）
ジーフット	11,600	424.00	4,918,400	貸付有価証券 2,000株
シー・ヴィ・エス・バイ エリア	2,800	405.00	1,134,000	
くら寿司	10,100	4,040.00	40,804,000	貸付有価証券 4,700株
キャンドゥ	9,200	1,698.00	15,621,600	貸付有価証券 200株（200株）
パルグループホールディングス	19,700	1,342.00	26,437,400	貸付有価証券 9,300株（1,600株）
エディオン	88,500	905.00	80,092,500	貸付有価証券 35,800株
サーラコーポレーション	39,100	572.00	22,365,200	
ワッツ	8,500	594.00	5,049,000	
ハローズ	7,200	2,733.00	19,677,600	貸付有価証券

				700株
フジオフードシステム	16,200	1,368.00	22,161,600	貸付有価証券 100株
あみやき亭	4,200	3,050.00	12,810,000	貸付有価証券 1,900株
ひらまつ	35,400	153.00	5,416,200	貸付有価証券 200株(200株)
大黒天物産	4,600	3,195.00	14,697,000	貸付有価証券 2,100株
ハニーズホールディングス	17,000	1,112.00	18,904,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
ファーマライズホールディングス	4,600	675.00	3,105,000	
アルペン	14,800	1,603.00	23,724,400	
ハブ	5,500	665.00	3,657,500	貸付有価証券 1,700株
クオールホールディングス	28,400	1,327.00	37,686,800	貸付有価証券 12,800株
ジンズホールディングス	10,200	6,090.00	62,118,000	貸付有価証券 1,200株(600株)
ビックカメラ	114,300	901.00	102,984,300	貸付有価証券 47,200株(12,400株)
DCMホールディングス	106,800	1,004.00	107,227,200	貸付有価証券 48,000株(12,600株)
Monotaro	137,100	2,838.00	389,089,800	貸付有価証券 57,700株(16,800株)
東京一番フーズ	4,900	481.00	2,356,900	貸付有価証券 2,300株
DDホールディングス	7,600	769.00	5,844,400	貸付有価証券 400株
きちりホールディングス	5,100	515.00	2,626,500	
アークランドサービスホールディングス	14,100	1,439.00	20,289,900	
J・フロントリテイリング	230,200	907.00	208,791,400	貸付有価証券 109,200株(90,100株)
ドトール・日レスホールディングス	30,800	1,657.00	51,035,600	貸付有価証券 14,500株(100株)
マツモトキヨシホールディングス	79,700	4,115.00	327,965,500	貸付有価証券 400株
ブロンコビリー	10,100	2,207.00	22,290,700	貸付有価証券 300株

Z O Z O	132,600	1,474.00	195,452,400	貸付有価証券 1,300株
トレジャー・ファクトリー	5,600	610.00	3,416,000	貸付有価証券 2,200株
物語コーポレーション	5,100	6,110.00	31,161,000	貸付有価証券 100株
ココカラファイン	20,100	5,760.00	115,776,000	貸付有価証券 800株
三越伊勢丹ホールディングス	336,900	641.00	215,952,900	貸付有価証券 10,900株
H a m e e	6,900	1,014.00	6,996,600	貸付有価証券 1,400株
ウエルシアホールディングス	57,300	7,810.00	447,513,000	貸付有価証券 12,000株(100株)
クリエイトSDホールディングス	32,500	2,716.00	88,270,000	貸付有価証券 900株
丸善CHIホールディングス	22,500	377.00	8,482,500	
ミサワ	3,900	396.00	1,544,400	貸付有価証券 1,800株
ティーライフ	2,600	871.00	2,264,600	
エー・ピーカンパニー	3,600	414.00	1,490,400	貸付有価証券 500株
チムニー	5,900	1,671.00	9,858,900	貸付有価証券 2,700株
シュッピン	13,100	609.00	7,977,900	貸付有価証券 2,200株
ネクステージ	27,500	697.00	19,167,500	貸付有価証券 12,900株
ジョイフル本田	56,500	1,325.00	74,862,500	貸付有価証券 26,700株
鳥貴族	6,400	1,614.00	10,329,600	貸付有価証券 2,200株
麒麟堂ホールディングス	7,600	1,739.00	13,216,400	貸付有価証券 3,600株
ホットランド	12,800	945.00	12,096,000	貸付有価証券 1,900株
すかいらーくホールディングス	216,000	1,614.00	348,624,000	貸付有価証券 101,400株
S F Pホールディングス	8,200	1,429.00	11,717,800	貸付有価証券 300株
綿半ホールディングス	7,200	1,636.00	11,779,200	

ヨシックス	3,100	1,902.00	5,896,200	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	56,000	998.00	55,888,000	貸付有価証券 26,500株
ゴルフダイジェスト・オ ンライン	8,900	463.00	4,120,700	
B E E N O S	7,200	808.00	5,817,600	貸付有価証券 1,000株
あさひ	14,400	1,153.00	16,603,200	貸付有価証券 5,600株(300株)
日本調剤	11,700	1,680.00	19,656,000	貸付有価証券 200株
コスモス薬品	8,500	26,000.00	221,000,000	貸付有価証券 4,100株
トーエル	9,300	822.00	7,644,600	
オンリー	3,300	613.00	2,022,900	
セブン & アイ・ホール ディングス	754,100	3,647.00	2,750,202,700	貸付有価証券 357,900株(47,300 株)
クリエイト・レストラン ツ・ホールディング	103,600	648.00	67,132,800	貸付有価証券 4,600株
ツルハホールディングス	41,900	14,520.00	608,388,000	貸付有価証券 4,600株(4,500株)
サンマルクホールディ ングス	15,200	1,776.00	26,995,200	
フェリシモ	4,300	952.00	4,093,600	
トリドールホールディ ングス	47,700	1,141.00	54,425,700	貸付有価証券 22,200株
T O K Y O B A S E	17,400	249.00	4,332,600	
ウイルプラスホールディ ングス	2,400	488.00	1,171,200	
J Mホールディングス	9,700	2,218.00	21,514,600	貸付有価証券 500株
サツドラホールディ ングス	2,900	1,916.00	5,556,400	貸付有価証券 200株
アレンザホールディ ングス	9,600	733.00	7,036,800	貸付有価証券 200株
串カツ田中ホールディ ングス	3,000	1,172.00	3,516,000	貸付有価証券 1,400株
パロックジャパンリミ テッド	13,400	617.00	8,267,800	貸付有価証券 1,700株(1,300株)
クスリのアオキホール	17,200	8,810.00	151,532,000	貸付有価証券

ディングス				7,800株(1,400株)
力の源ホールディングス	8,700	598.00	5,202,600	貸付有価証券 500株
スシログローバルホールディングス	84,600	1,537.00	130,030,200	貸付有価証券 2,400株
LIXILピバ	19,000	1,825.00	34,675,000	
メディカルシステムネットワーク	18,600	400.00	7,440,000	貸付有価証券 7,300株
はるやまホールディングス	9,000	740.00	6,660,000	貸付有価証券 4,200株
ノジマ	34,300	1,913.00	65,615,900	
カップ・クリエイト	27,000	1,339.00	36,153,000	貸付有価証券 12,300株(100株)
ライトオン	14,400	535.00	7,704,000	貸付有価証券 7,200株
ジーンズメイト	5,900	220.00	1,298,000	貸付有価証券 2,700株(2,000株)
良品計画	255,900	1,204.00	308,103,600	貸付有価証券 71,600株
三城ホールディングス	20,400	255.00	5,202,000	貸付有価証券 500株
アドヴァン	29,400	1,121.00	32,957,400	
アルビス	7,300	2,113.00	15,424,900	
コナカ	22,700	295.00	6,696,500	
ハウスオブローゼ	2,400	1,599.00	3,837,600	貸付有価証券 1,100株(200株)
G-7ホールディングス	11,300	2,263.00	25,571,900	
イオン北海道	25,400	729.00	18,516,600	
コジマ	33,100	348.00	11,518,800	貸付有価証券 200株
ヒマラヤ	6,700	697.00	4,669,900	
コーナン商事	27,400	2,244.00	61,485,600	貸付有価証券 13,000株
エコス	7,100	1,714.00	12,169,400	
ワタミ	22,800	942.00	21,477,600	貸付有価証券 10,700株
マルシェ	5,100	541.00	2,759,100	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	423,700	2,058.00	871,974,600	貸付有価証券 199,700株
西松屋チェーン	42,300	752.00	31,809,600	貸付有価証券

				18,800株
ゼンショーホールディングス	92,400	2,045.00	188,958,000	貸付有価証券 43,300株
幸楽苑ホールディングス	12,200	1,361.00	16,604,200	貸付有価証券 5,700株
ハークスレイ	4,000	1,147.00	4,588,000	貸付有価証券 100株
サイゼリヤ	31,800	2,000.00	63,600,000	貸付有価証券 15,000株
V Tホールディングス	79,800	309.00	24,658,200	貸付有価証券 900株
魚力	5,300	1,510.00	8,003,000	
ポブラ	5,000	452.00	2,260,000	貸付有価証券 2,200株
フジ・コーポレーション	5,100	1,876.00	9,567,600	
ユナイテッドアローズ	20,200	1,598.00	32,279,600	貸付有価証券 1,100株
ハイデイ日高	27,800	1,549.00	43,062,200	貸付有価証券 13,200株
京都きもの友禅	12,200	247.00	3,013,400	
コロワイド	64,000	1,632.00	104,448,000	貸付有価証券 30,000株(400株)
ピーシーデポコーポレーション	25,600	425.00	10,880,000	
壱番屋	13,600	4,515.00	61,404,000	貸付有価証券 6,400株
トップカルチャー	6,900	320.00	2,208,000	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
P L A N T	4,900	441.00	2,160,900	
スギホールディングス	38,500	5,950.00	229,075,000	貸付有価証券 18,200株
薬王堂ホールディングス	8,400	2,442.00	20,512,800	貸付有価証券 1,800株
ヴィア・ホールディングス	23,600	501.00	11,823,600	貸付有価証券 1,700株
スクロール	29,600	302.00	8,939,200	貸付有価証券 500株
ヨンドシーホールディングス	19,600	2,051.00	40,199,600	貸付有価証券 9,100株
ファミリーマート	154,000	1,938.00	298,452,000	貸付有価証券 73,100株(2,500株)
木曽路	25,200	2,441.00	61,513,200	貸付有価証券

				11,800株
S R Sホールディングス	22,700	944.00	21,428,800	貸付有価証券 10,600株
千趣会	34,800	351.00	12,214,800	貸付有価証券 6,900株
タカキュー	14,900	140.00	2,086,000	貸付有価証券 500株(300株)
ケーヨー	39,600	505.00	19,998,000	貸付有価証券 800株
上新電機	22,700	2,141.00	48,600,700	
日本瓦斯	30,500	3,685.00	112,392,500	
ロイヤルホールディングス	33,600	1,788.00	60,076,800	貸付有価証券 600株(300株)
東天紅	1,400	806.00	1,128,400	
いなげや	23,900	1,605.00	38,359,500	
島忠	36,200	2,735.00	99,007,000	貸付有価証券 17,100株(7,900株)
チヨダ	20,200	1,203.00	24,300,600	貸付有価証券 9,500株
ライフコーポレーション	14,600	2,960.00	43,216,000	貸付有価証券 6,900株
リンガーハット	23,800	2,095.00	49,861,000	貸付有価証券 3,100株(100株)
MrMaxHD	26,500	339.00	8,983,500	貸付有価証券 100株
テンアライド	17,800	375.00	6,675,000	貸付有価証券 8,200株
AOKIホールディングス	38,600	733.00	28,293,800	貸付有価証券 1,300株
オークワ	30,200	1,812.00	54,722,400	貸付有価証券 8,300株
コメリ	29,800	1,976.00	58,884,800	
青山商事	39,800	967.00	38,486,600	貸付有価証券 700株
しまむら	22,400	7,170.00	160,608,000	貸付有価証券 10,100株(900株)
はせがわ	10,200	411.00	4,192,200	
高島屋	140,400	1,003.00	140,821,200	貸付有価証券 66,600株(26,600株)
松屋	38,900	642.00	24,973,800	貸付有価証券 18,400株

エイチ・ツー・オー リ テイリング	91,300	785.00	71,670,500	貸付有価証券 700株
近鉄百貨店	7,400	2,517.00	18,625,800	貸付有価証券 3,500株
丸井グループ	176,700	1,892.00	334,316,400	貸付有価証券 200株
アクシアル リテイリン グ	16,000	4,100.00	65,600,000	
井筒屋	10,500	159.00	1,669,500	貸付有価証券 500株
イオン	741,800	2,450.00	1,817,410,000	貸付有価証券 352,100株（45,800 株）
イズミ	39,200	3,060.00	119,952,000	貸付有価証券 18,600株
平和堂	39,100	1,973.00	77,144,300	貸付有価証券 17,800株
フジ	23,300	1,865.00	43,454,500	貸付有価証券 11,000株
ヤオコー	21,900	6,810.00	149,139,000	貸付有価証券 2,900株
ゼビオホールディングス	23,300	889.00	20,713,700	
ケーズホールディングス	186,000	1,065.00	198,090,000	貸付有価証券 1,000株
O l y m p i cグループ	9,900	614.00	6,078,600	
日産東京販売ホールディ ングス	28,300	213.00	6,027,900	貸付有価証券 13,200株
シルバーライフ	1,900	1,907.00	3,623,300	貸付有価証券 800株（800株）
Genky Drug S tores	8,500	2,073.00	17,620,500	貸付有価証券 300株
ナルミヤ・インターナ ショナル	3,200	548.00	1,753,600	
総合メディカルホール ディングス	16,800	2,547.00	42,789,600	貸付有価証券 1,300株（800株）
ブックオフグループホー ルディングス	11,200	834.00	9,340,800	貸付有価証券 5,200株（400株）
アインホールディングス	23,700	6,250.00	148,125,000	貸付有価証券 11,100株
元気寿司	4,900	2,229.00	10,922,100	貸付有価証券 2,500株
ヤマダ電機	587,300	451.00	264,872,300	貸付有価証券

				1,300株
アークランドサカモト	30,200	1,030.00	31,106,000	貸付有価証券 14,300株
ニトリホールディングス	83,500	15,110.00	1,261,685,000	貸付有価証券 39,000株
グルメ杵屋	13,700	958.00	13,124,600	貸付有価証券 6,400株
愛眼	15,400	215.00	3,311,000	貸付有価証券 800株
ケーユーホールディングス	10,100	828.00	8,362,800	
吉野家ホールディングス	63,300	2,020.00	127,866,000	貸付有価証券 10,500株(9,000株)
松屋フーズホールディングス	9,300	3,900.00	36,270,000	貸付有価証券 4,300株
サガミホールディングス	25,800	1,214.00	31,321,200	貸付有価証券 12,000株
関西スーパーマーケット	16,000	994.00	15,904,000	貸付有価証券 2,700株
王将フードサービス	14,200	5,710.00	81,082,000	
ブレナス	21,600	1,860.00	40,176,000	貸付有価証券 9,200株
ミニストップ	14,300	1,482.00	21,192,600	貸付有価証券 1,000株
アークス	39,400	2,023.00	79,706,200	貸付有価証券 18,700株
バローホールディングス	42,600	1,961.00	83,538,600	貸付有価証券 1,500株
藤久	1,500	699.00	1,048,500	貸付有価証券 100株
ベルク	9,500	5,630.00	53,485,000	貸付有価証券 4,500株
大庄	10,300	1,095.00	11,278,500	
ファーストリテイリング	25,800	43,340.00	1,118,172,000	貸付有価証券 12,200株(1,600株)
サンドラッグ	72,500	3,505.00	254,112,500	
サックスパーホールディングス	16,300	617.00	10,057,100	貸付有価証券 200株
ヤマザワ	4,500	1,594.00	7,173,000	
やまや	4,000	2,079.00	8,316,000	貸付有価証券 1,800株
ペルーナ	41,400	496.00	20,534,400	

島根銀行	3,800	430.00	1,634,000	
じもとホールディングス	130,400	97.00	12,648,800	貸付有価証券 200株
めぶきフィナンシャルグループ	1,003,100	230.00	230,713,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	26,100	1,213.00	31,659,300	
九州フィナンシャルグループ	316,800	442.00	140,025,600	貸付有価証券 800株
ゆうちょ銀行	546,900	1,018.00	556,744,200	貸付有価証券 183,200株
富山第一銀行	46,000	307.00	14,122,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,135,400	340.00	386,036,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	131,600	659.00	86,724,400	
関西みらいフィナンシャルグループ	113,300	410.00	46,453,000	貸付有価証券 200株
三十三フィナンシャルグループ	17,900	1,576.00	28,210,400	
第四北越フィナンシャルグループ	33,500	2,455.00	82,242,500	
新生銀行	141,700	1,461.00	207,023,700	貸付有価証券 500株
あおぞら銀行	115,000	2,187.00	251,505,000	貸付有価証券 400株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	13,205,200	426.10	5,626,735,720	
りそなホールディングス	2,118,400	344.00	728,729,600	貸付有価証券 5,700株
三井住友トラスト・ホールディングス	364,900	3,284.00	1,198,331,600	
三井住友フィナンシャルグループ	1,335,100	2,750.50	3,672,192,550	
千葉銀行	644,200	497.00	320,167,400	貸付有価証券 500株
群馬銀行	379,300	346.00	131,237,800	
武蔵野銀行	28,800	1,486.00	42,796,800	
千葉興業銀行	52,900	263.00	13,912,700	
筑波銀行	80,300	177.00	14,213,100	
七十七銀行	65,200	1,447.00	94,344,400	

青森銀行	15,000	2,640.00	39,600,000	
秋田銀行	12,400	1,648.00	20,435,200	
山形銀行	21,700	1,393.00	30,228,100	
岩手銀行	12,600	2,755.00	34,713,000	
東邦銀行	172,600	274.00	47,292,400	貸付有価証券 100株
東北銀行	9,200	898.00	8,261,600	
みちのく銀行	12,400	1,234.00	15,301,600	
ふくおかフィナンシャル グループ	162,600	1,546.00	251,379,600	
静岡銀行	478,000	696.00	332,688,000	貸付有価証券 300株
十六銀行	24,200	1,969.00	47,649,800	
スルガ銀行	197,500	370.00	73,075,000	貸付有価証券 23,700株
八十二銀行	465,900	401.00	186,825,900	貸付有価証券 100株
山梨中央銀行	22,400	783.00	17,539,200	
大垣共立銀行	38,100	2,285.00	87,058,500	
福井銀行	16,500	1,581.00	26,086,500	
北國銀行	19,900	3,495.00	69,550,500	
清水銀行	8,000	1,940.00	15,520,000	
富山銀行	3,700	1,828.00	6,763,600	
滋賀銀行	38,700	2,672.00	103,406,400	貸付有価証券 6,500株（6,300株）
南都銀行	32,100	2,339.00	75,081,900	
百五銀行	173,700	317.00	55,062,900	
京都銀行	69,100	3,685.00	254,633,500	
紀陽銀行	68,300	1,662.00	113,514,600	
ほくほくフィナンシャル グループ	128,500	1,005.00	129,142,500	
広島銀行	285,000	487.00	138,795,000	
山陰合同銀行	114,500	574.00	65,723,000	
中国銀行	166,100	1,011.00	167,927,100	
鳥取銀行	6,600	1,187.00	7,834,200	
伊予銀行	275,400	565.00	155,601,000	貸付有価証券 500株
百十四銀行	20,500	2,020.00	41,410,000	貸付有価証券 200株

四国銀行	29,300	911.00	26,692,300	貸付有価証券 13,200株
阿波銀行	31,500	2,394.00	75,411,000	貸付有価証券 800株
大分銀行	11,100	2,020.00	22,422,000	
宮崎銀行	12,900	2,494.00	32,172,600	
佐賀銀行	11,700	1,196.00	13,993,200	
沖縄銀行	17,700	3,310.00	58,587,000	
琉球銀行	44,500	1,098.00	48,861,000	
セブン銀行	644,900	285.00	183,796,500	
みずほフィナンシャルグループ	26,231,100	130.00	3,410,043,000	
高知銀行	7,000	664.00	4,648,000	
山口フィナンシャルグループ	241,000	646.00	155,686,000	
長野銀行	6,300	1,106.00	6,967,800	
名古屋銀行	15,600	2,784.00	43,430,400	
北洋銀行	291,000	213.00	61,983,000	
愛知銀行	7,000	3,270.00	22,890,000	
中京銀行	7,900	2,237.00	17,672,300	
大光銀行	6,600	1,468.00	9,688,800	
愛媛銀行	27,000	1,209.00	32,643,000	
トマト銀行	7,500	1,067.00	8,002,500	
京葉銀行	82,300	578.00	47,569,400	
栃木銀行	93,200	163.00	15,191,600	
北日本銀行	6,000	2,045.00	12,270,000	貸付有価証券 500株
東和銀行	33,900	667.00	22,611,300	
福島銀行	18,200	161.00	2,930,200	貸付有価証券 5,900株（1,900株）
大東銀行	10,000	587.00	5,870,000	
トモニホールディングス	149,200	390.00	58,188,000	
フィデアホールディングス	187,400	106.00	19,864,400	貸付有価証券 600株
池田泉州ホールディングス	222,000	168.00	37,296,000	
F P G	59,500	558.00	33,201,000	貸付有価証券 27,900株
マーキュリアンベスト	8,600	550.00	4,730,000	

メント				
S B Iホールディングス	215,600	1,581.00	340,863,600	貸付有価証券 10,300株
日本アジア投資	16,300	180.00	2,934,000	貸付有価証券 4,900株（600株）
ジャフコ	29,700	2,979.00	88,476,300	貸付有価証券 100株
大和証券グループ本社	1,549,000	434.40	672,885,600	
野村ホールディングス	3,396,600	478.90	1,626,631,740	貸付有価証券 800株
岡三証券グループ	164,500	350.00	57,575,000	貸付有価証券 100株
丸三証券	57,300	464.00	26,587,200	貸付有価証券 5,000株
東洋証券	69,000	135.00	9,315,000	貸付有価証券 1,900株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	221,700	258.00	57,198,600	
光世証券	4,600	520.00	2,392,000	貸付有価証券 800株
水戸証券	55,800	189.00	10,546,200	貸付有価証券 200株
いちよし証券	36,100	455.00	16,425,500	
松井証券	110,300	802.00	88,460,600	貸付有価証券 4,300株
だいこう証券ビジネス	9,400	574.00	5,395,600	貸付有価証券 200株
マネックスグループ	145,700	176.00	25,643,200	貸付有価証券 56,500株（37,600株）
極東証券	25,900	638.00	16,524,200	
岩井コスモホールディングス	18,200	950.00	17,290,000	
藍澤證券	34,700	789.00	27,378,300	
マネーパートナーズグループ	20,500	194.00	3,977,000	貸付有価証券 4,200株
スパークス・グループ	66,900	171.00	11,439,900	
小林洋行	5,500	232.00	1,276,000	貸付有価証券 2,500株
かんぼ生命保険	68,400	1,366.00	93,434,400	貸付有価証券 6,100株
S O M P Oホールディング	363,000	3,544.00	1,286,472,000	貸付有価証券

グス				100株
アニコム ホールディングス	16,000	3,620.00	57,920,000	貸付有価証券 5,000株
MS & A Dインシュアランスグループホール	504,700	3,100.00	1,564,570,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	158,600	1,827.00	289,762,200	
第一生命ホールディングス	1,092,400	1,305.00	1,425,582,000	
東京海上ホールディングス	690,300	5,093.00	3,515,697,900	
T & Dホールディングス	577,000	890.00	513,530,000	
アドバンスクリエイト	4,500	1,673.00	7,528,500	貸付有価証券 600株
全国保証	54,400	3,525.00	191,760,000	
ジェイリース	5,300	238.00	1,261,400	貸付有価証券 2,400株
イントラスト	6,800	521.00	3,542,800	貸付有価証券 600株
日本モーゲージサービス	3,900	1,672.00	6,520,800	貸付有価証券 1,800株
C a s a	6,700	932.00	6,244,400	
アルヒ	30,700	1,055.00	32,388,500	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
プレミアグループ	10,500	1,514.00	15,897,000	貸付有価証券 2,500株
クレディセゾン	135,200	1,288.00	174,137,600	貸付有価証券 200株
芙蓉総合リース	20,200	5,650.00	114,130,000	
みずほリース	29,800	2,183.00	65,053,400	
東京センチュリー	38,900	3,645.00	141,790,500	
日本証券金融	85,100	513.00	43,656,300	
アイフル	294,500	248.00	73,036,000	貸付有価証券 76,300株
リコーリース	15,200	2,934.00	44,596,800	貸付有価証券 7,100株
イオンフィナンシャルサービス	118,100	1,196.00	141,247,600	貸付有価証券 27,000株
アコム	388,000	460.00	178,480,000	
ジャックス	21,300	1,843.00	39,255,900	
オリエントコーポレー	522,100	123.00	64,218,300	

ション				
日立キャピタル	45,500	2,150.00	97,825,000	
アプラスフィナンシャル	92,600	59.00	5,463,400	貸付有価証券 15,800株
オリックス	1,207,400	1,373.50	1,658,363,900	
三菱UFJリース	489,900	562.00	275,323,800	
九州リースサービス	9,500	453.00	4,303,500	貸付有価証券 4,400株
日本取引所グループ	554,100	1,916.00	1,061,655,600	貸付有価証券 4,800株
イー・ギャランティ	20,700	1,486.00	30,760,200	貸付有価証券 8,900株
アサックス	10,000	599.00	5,990,000	貸付有価証券 4,700株
NECキャピタルソリューション	7,900	1,839.00	14,528,100	貸付有価証券 1,300株
いちご	245,700	256.00	62,899,200	貸付有価証券 115,900株
日本駐車場開発	211,700	132.00	27,944,400	貸付有価証券 100,500株
スター・マイカ・ホールディングス	10,000	1,392.00	13,920,000	貸付有価証券 2,100株
ヒューリック	412,200	1,131.00	466,198,200	貸付有価証券 139,600株（9,400株）
三栄建築設計	7,700	1,233.00	9,494,100	
野村不動産ホールディングス	117,200	1,783.00	208,967,600	貸付有価証券 1,300株
三重交通グループホールディングス	39,100	519.00	20,292,900	貸付有価証券 18,300株
サムティ	27,400	1,222.00	33,482,800	貸付有価証券 4,600株
ディア・ライフ	24,800	393.00	9,746,400	
コーセーアールイー	5,700	463.00	2,639,100	貸付有価証券 2,200株
エー・ディー・ワークス	357,900	20.00	7,158,000	
日本商業開発	12,200	1,364.00	16,640,800	貸付有価証券 5,800株
プレサンスコーポレーション	31,700	983.00	31,161,100	貸付有価証券 6,300株（400株）
ユニゾホールディングス	29,100	5,970.00	173,727,000	貸付有価証券 1,300株

THEグローバル社	9,100	312.00	2,839,200	貸付有価証券 4,200株
ハウスコム	2,500	1,205.00	3,012,500	
日本管理センター	12,700	1,125.00	14,287,500	貸付有価証券 6,000株
サンセイランディック	5,700	654.00	3,727,800	
エストラスト	2,600	515.00	1,339,000	貸付有価証券 1,200株
フージャースホールディングス	38,500	618.00	23,793,000	貸付有価証券 100株
オープンハウス	56,000	2,171.00	121,576,000	貸付有価証券 100株
東急不動産ホールディングス	524,900	523.00	274,522,700	貸付有価証券 1,900株
飯田グループホールディングス	161,000	1,545.00	248,745,000	
イーグランド	3,100	611.00	1,894,100	
ムゲンエステート	13,300	427.00	5,679,100	
ビーロッド	9,000	614.00	5,526,000	貸付有価証券 4,000株
ファーストブラザーズ	4,400	693.00	3,049,200	
ハウズドゥ	9,500	713.00	6,773,500	
シーアールイー	4,800	1,096.00	5,260,800	
プロパティエージェント	3,100	782.00	2,424,200	
ケイアイスター不動産	6,100	1,134.00	6,917,400	
アグレ都市デザイン	3,100	433.00	1,342,300	貸付有価証券 1,400株
グッドコムアセット	4,500	1,243.00	5,593,500	貸付有価証券 400株
ジェイ・エス・ビー	2,100	4,160.00	8,736,000	
テンポイノベーション	4,300	656.00	2,820,800	貸付有価証券 2,000株（100株）
グローバル・リンク・マネジメント	3,200	543.00	1,737,600	貸付有価証券 1,500株
パーク24	103,600	1,620.00	167,832,000	貸付有価証券 47,400株（2,600株）
パラカ	5,000	1,711.00	8,555,000	
三井不動産	952,100	1,862.50	1,773,286,250	
三菱地所	1,352,600	1,628.50	2,202,709,100	
平和不動産	35,400	2,768.00	97,987,200	貸付有価証券

				900株
東京建物	203,400	1,115.00	226,791,000	貸付有価証券 96,400株(7,200株)
ダイビル	49,700	904.00	44,928,800	
京阪神ビルディング	31,300	1,342.00	42,004,600	
住友不動産	433,900	2,789.00	1,210,147,100	
テーオーシー	37,900	624.00	23,649,600	
東京楽天地	3,200	4,080.00	13,056,000	
レオパレス21	253,000	269.00	68,057,000	貸付有価証券 117,200株(67,700 株)
スターツコーポレーション	26,300	2,067.00	54,362,100	
フジ住宅	22,400	533.00	11,939,200	貸付有価証券 700株
空港施設	19,300	407.00	7,855,100	
明和地所	10,600	501.00	5,310,600	
ゴールドクレスト	15,200	1,730.00	26,296,000	貸付有価証券 6,900株
エスリード	7,500	1,458.00	10,935,000	貸付有価証券 3,500株
日神グループホールディングス	28,500	409.00	11,656,500	
日本エスコン	34,900	608.00	21,219,200	貸付有価証券 9,300株(8,200株)
タカラレーベン	88,200	358.00	31,575,600	
AVANTIA	10,900	620.00	6,758,000	
イオンモール	96,800	1,404.00	135,907,200	貸付有価証券 23,200株
毎日コムネット	4,900	768.00	3,763,200	
ファースト住建	8,200	969.00	7,945,800	
カチタス	47,800	1,638.00	78,296,400	貸付有価証券 22,400株
トーセイ	26,600	969.00	25,775,400	貸付有価証券 12,600株
穴吹興産	4,200	1,372.00	5,762,400	
サンフロンティア不動産	26,700	856.00	22,855,200	貸付有価証券 500株
エフ・ジェー・ネクスト	16,800	823.00	13,826,400	貸付有価証券 7,800株

インテリックス	5,400	496.00	2,678,400	
ランドビジネス	8,100	257.00	2,081,700	
日本社宅サービス	4,500	880.00	3,960,000	
グランディハウス	15,000	369.00	5,535,000	貸付有価証券 200株(200株)
日本空港ビルデング	61,600	4,580.00	282,128,000	貸付有価証券 12,500株
日本工営	12,600	3,030.00	38,178,000	貸付有価証券 5,900株
L I F U L L	65,300	299.00	19,524,700	
ジェイエイシーリクルー トメント	12,500	1,030.00	12,875,000	貸付有価証券 2,300株(2,100株)
日本M&Aセンター	141,300	2,800.00	395,640,000	
メンバーズ	5,500	1,275.00	7,012,500	
中広	1,900	425.00	807,500	
UTグループ	22,100	1,143.00	25,260,300	貸付有価証券 8,800株(4,800株)
アイティメディア	5,600	724.00	4,054,400	貸付有価証券 2,600株(1,100株)
タケエイ	17,900	769.00	13,765,100	貸付有価証券 400株
E・Jホールディングス	3,300	1,268.00	4,184,400	
ビーネックスグループ	23,400	498.00	11,653,200	貸付有価証券 11,000株
コシダカホールディング ス	45,000	364.00	16,380,000	貸付有価証券 20,200株
アルトナー	4,500	631.00	2,839,500	
パソナグループ	20,300	848.00	17,214,400	
C D S	4,600	1,152.00	5,299,200	
リンクアンドモチベー ション	41,200	312.00	12,854,400	貸付有価証券 15,500株(1,300株)
G C A	22,500	567.00	12,757,500	貸付有価証券 10,600株
エス・エム・エス	58,200	2,050.00	119,310,000	貸付有価証券 3,900株
サニーサイドアップグ ループ	4,800	569.00	2,731,200	
パーソルホールディング ス	187,000	1,100.00	205,700,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
リニカル	9,000	820.00	7,380,000	貸付有価証券

				1,900株
クックパッド	65,300	300.00	19,590,000	貸付有価証券 100株(100株)
エスクリ	5,800	384.00	2,227,200	貸付有価証券 400株
アイ・ケイ・ケイ	9,100	623.00	5,669,300	貸付有価証券 4,100株
学情	6,600	1,273.00	8,401,800	貸付有価証券 2,200株
スタジオアリス	9,400	1,571.00	14,767,400	貸付有価証券 4,400株
シミックホールディングス	10,300	1,463.00	15,068,900	
エプロ	3,000	780.00	2,340,000	
N J S	4,100	1,704.00	6,986,400	貸付有価証券 1,800株
総合警備保障	74,400	5,570.00	414,408,000	
カカクコム	138,200	2,000.00	276,400,000	
セントケア・ホールディング	12,100	383.00	4,634,300	貸付有価証券 6,600株
サイネックス	3,100	581.00	1,801,100	
ルネサンス	10,400	1,009.00	10,493,600	貸付有価証券 4,800株
ディップ	26,400	1,682.00	44,404,800	貸付有価証券 12,500株(5,900株)
オプトホールディング	10,100	1,374.00	13,877,400	貸付有価証券 2,300株
新日本科学	20,200	525.00	10,605,000	貸付有価証券 6,300株
ツクイ	44,000	399.00	17,556,000	
キャリアデザインセンター	4,700	798.00	3,750,600	
ベネフィット・ワン	51,000	1,420.00	72,420,000	
エムスリー	412,400	3,035.00	1,251,634,000	貸付有価証券 500株
ツカダ・グローバルホールディング	11,900	345.00	4,105,500	
プラス	2,100	436.00	915,600	
アウトソーシング	107,100	464.00	49,694,400	貸付有価証券 50,700株
ウェルネット	18,900	479.00	9,053,100	

ワールドホールディングス	6,200	1,240.00	7,688,000	貸付有価証券 2,900株(600株)
ディー・エヌ・エー	91,600	1,206.00	110,469,600	貸付有価証券 400株
博報堂D Yホールディングス	260,100	1,154.00	300,155,400	
ぐるなび	32,500	566.00	18,395,000	貸付有価証券 100株
タカミヤ	19,800	410.00	8,118,000	
ジャパンベストレスキューシステム	12,600	626.00	7,887,600	貸付有価証券 6,100株
ファンコミュニケーションズ	51,400	415.00	21,331,000	貸付有価証券 23,900株
ライク	6,200	1,464.00	9,076,800	貸付有価証券 2,800株(200株)
ビジネス・ブレークスルー	7,800	326.00	2,542,800	貸付有価証券 200株
エスプール	36,000	541.00	19,476,000	貸付有価証券 2,900株
WDBホールディングス	8,500	2,154.00	18,309,000	
ティア	10,900	528.00	5,755,200	
CDG	2,000	1,400.00	2,800,000	
バリューコマース	10,500	1,693.00	17,776,500	貸付有価証券 1,300株
インフォマート	204,900	680.00	139,332,000	貸付有価証券 93,300株(11,900株)
J Pホールディングス	58,700	255.00	14,968,500	貸付有価証券 900株
E P Sホールディングス	28,100	1,142.00	32,090,200	
レグス	4,600	820.00	3,772,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
プレステージ・インターナショナル	70,000	804.00	56,280,000	貸付有価証券 1,400株
アミューズ	10,200	2,233.00	22,776,600	貸付有価証券 600株
ドリームインキュベータ	5,700	944.00	5,380,800	貸付有価証券 200株
クイック	11,600	979.00	11,356,400	
T A C	11,200	163.00	1,825,600	貸付有価証券 900株
ケネディクス	174,300	418.00	72,857,400	貸付有価証券

				82,600株
電通グループ	192,800	2,119.00	408,543,200	貸付有価証券 91,400株
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,100	553.00	3,926,300	
ぴあ	5,300	2,396.00	12,698,800	貸付有価証券 2,400株(1,400株)
イオンファンタジー	7,200	1,452.00	10,454,400	貸付有価証券 2,300株(2,000株)
シーティーエス	21,100	524.00	11,056,400	貸付有価証券 200株
ネクシィーズグループ	6,500	972.00	6,318,000	貸付有価証券 3,000株(1,900株)
みらかホールディングス	52,300	2,375.00	124,212,500	貸付有価証券 1,100株
アルプス技研	16,500	1,479.00	24,403,500	貸付有価証券 7,800株
ダイオーズ	3,700	1,042.00	3,855,400	貸付有価証券 2,100株
日本空調サービス	19,600	688.00	13,484,800	貸付有価証券 100株
オリエンタルランド	198,900	14,090.00	2,802,501,000	貸付有価証券 27,900株
ダスキン	48,000	2,971.00	142,608,000	
明光ネットワークジャパン	22,000	758.00	16,676,000	貸付有価証券 10,400株
ファルコホールディングス	10,300	1,819.00	18,735,700	貸付有価証券 100株(100株)
秀英予備校	4,100	399.00	1,635,900	貸付有価証券 1,800株
田谷	3,400	559.00	1,900,600	貸付有価証券 1,500株
ラウンドワン	52,200	562.00	29,336,400	
リゾートトラスト	85,700	1,086.00	93,070,200	貸付有価証券 28,200株
ピー・エム・エル	24,100	2,982.00	71,866,200	
ワタベウェディング	3,000	337.00	1,011,000	
りらいあコミュニケーションズ	33,800	1,059.00	35,794,200	
リソー教育	85,400	296.00	25,278,400	貸付有価証券 5,200株
早稲田アカデミー	6,100	922.00	5,624,200	貸付有価証券

				100株
ユー・エス・エス	209,400	1,500.00	314,100,000	
東京個別指導学院	6,600	460.00	3,036,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
サイバーエージェント	107,600	4,155.00	447,078,000	貸付有価証券 50,500株
楽天	871,700	824.00	718,280,800	貸付有価証券 409,000株(14,700 株)
クリーク・アンド・リ バー社	9,600	765.00	7,344,000	貸付有価証券 300株
テー・オー・ダブリュー	29,800	282.00	8,403,600	貸付有価証券 14,000株(200株)
山田コンサルティンググ ループ	9,100	944.00	8,590,400	
セントラルスポーツ	7,000	2,268.00	15,876,000	貸付有価証券 3,100株
フルキャストホールディ ングス	18,700	1,221.00	22,832,700	貸付有価証券 8,800株(2,600株)
エン・ジャパン	33,200	2,100.00	69,720,000	貸付有価証券 1,800株
リソルホールディングス	2,000	3,465.00	6,930,000	貸付有価証券 900株
テクノプロ・ホールディ ングス	37,300	5,090.00	189,857,000	貸付有価証券 14,200株(5,000株)
アトラ	4,300	209.00	898,700	
インターワークス	3,600	396.00	1,425,600	
アイ・アールジャパン ホールディングス	7,600	6,080.00	46,208,000	
Keepers 技研	6,900	1,254.00	8,652,600	貸付有価証券 500株(500株)
ファーストロジック	4,300	588.00	2,528,400	貸付有価証券 500株(300株)
三機サービス	3,600	998.00	3,592,800	
Gunosy	11,600	867.00	10,057,200	貸付有価証券 4,400株
デザインワン・ジャパン	3,700	173.00	640,100	貸付有価証券 100株
イー・ガーディアン	9,500	1,478.00	14,041,000	貸付有価証券 300株
リブセンス	12,000	262.00	3,144,000	貸付有価証券 100株

ジャパンマテリアル	57,500	1,405.00	80,787,500	
ベクトル	23,300	647.00	15,075,100	貸付有価証券 9,000株(100株)
ウチヤマホールディングス	9,200	321.00	2,953,200	貸付有価証券 4,300株
チャーム・ケア・コーポレーション	15,900	766.00	12,179,400	貸付有価証券 7,000株
ライクキッズ	3,200	499.00	1,596,800	
キャリアリンク	6,100	367.00	2,238,700	
I B J	12,800	479.00	6,131,200	
アサンテ	7,500	1,531.00	11,482,500	
N・フィールド	12,800	366.00	4,684,800	
バリューHR	7,400	1,321.00	9,775,400	貸付有価証券 2,000株(1,800株)
M&Aキャピタルパートナーズ	13,300	2,523.00	33,555,900	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,100	1,219.00	8,654,900	貸付有価証券 2,600株
E R Iホールディングス	5,200	612.00	3,182,400	
アビスト	2,900	1,850.00	5,365,000	
シグマクシス	12,800	1,211.00	15,500,800	
ウィルグループ	12,200	558.00	6,807,600	貸付有価証券 5,300株
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	25,800	149.00	3,844,200	貸付有価証券 100株
リクルートホールディングス	1,339,700	2,943.50	3,943,406,950	
エラン	11,000	1,374.00	15,114,000	貸付有価証券 2,600株
土木管理総合試験所	8,100	339.00	2,745,900	貸付有価証券 100株
ネットマーケティング	5,400	544.00	2,937,600	貸付有価証券 700株(700株)
日本郵政	1,532,900	851.10	1,304,651,190	貸付有価証券 1,600株
ベルシステム24ホール ディングス	31,300	1,152.00	36,057,600	貸付有価証券 14,800株
鎌倉新書	14,000	1,051.00	14,714,000	貸付有価証券 6,400株(100株)
S M N	3,000	572.00	1,716,000	
一蔵	2,000	377.00	754,000	

L I T A L I C O	6,400	2,113.00	13,523,200	貸付有価証券 2,800株
グローバルキッズCOM P A N Y	2,800	489.00	1,369,200	
エアトリ	8,300	669.00	5,552,700	貸付有価証券 3,900株
アトラエ	4,800	2,408.00	11,558,400	貸付有価証券 2,200株
ストライク	7,100	3,355.00	23,820,500	貸付有価証券 900株
ソラスト	51,500	1,011.00	52,066,500	
セラク	5,900	687.00	4,053,300	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
インソース	9,100	2,253.00	20,502,300	貸付有価証券 600株(300株)
ベイカレント・コンサル ティング	11,300	4,735.00	53,505,500	貸付有価証券 5,300株(100株)
Orchestra H o l d i n g s	3,900	778.00	3,034,200	
アイモバイル	5,300	535.00	2,835,500	貸付有価証券 2,700株
キャリアインデックス	7,600	267.00	2,029,200	貸付有価証券 3,300株
MS - J a p a n	6,100	644.00	3,928,400	貸付有価証券 2,800株
船場	3,100	901.00	2,793,100	
グレイステクノロジー	8,500	2,583.00	21,955,500	貸付有価証券 3,600株
ジャパンエレベーター サービスホールディン	19,700	2,450.00	48,265,000	貸付有価証券 7,700株
フルテック	2,600	1,194.00	3,104,400	
グリーンズ	4,700	383.00	1,800,100	
ツナググループ・ホール ディングス	2,200	343.00	754,600	貸付有価証券 100株
G a m e W i t h	4,200	449.00	1,885,800	貸付有価証券 1,300株
ソウルドアウト	2,900	2,160.00	6,264,000	貸付有価証券 900株
M S & C o n s u l t i n g	2,600	486.00	1,263,600	
ミダック	1,800	913.00	1,643,400	貸付有価証券

				500株
日総工産	12,400	438.00	5,431,200	貸付有価証券 300株(100株)
キュービーネットホールディングス	7,700	1,576.00	12,135,200	貸付有価証券 3,600株
RPAホールディングス	10,600	754.00	7,992,400	貸付有価証券 4,900株
スプリックス	6,300	623.00	3,924,900	貸付有価証券 2,400株(2,200株)
マネジメントソリューションズ	6,100	862.00	5,258,200	貸付有価証券 2,700株(300株)
and factory	1,800	1,052.00	1,893,600	
カーブスホールディングス	46,300	545.00	25,233,500	貸付有価証券 18,400株(4,800株)
アドバンテッジリスクマネジメント	9,400	582.00	5,470,800	貸付有価証券 1,300株
リログループ	102,200	2,228.00	227,701,600	貸付有価証券 700株
東祥	11,600	1,006.00	11,669,600	貸付有価証券 5,100株
エイチ・アイ・エス	29,100	1,419.00	41,292,900	貸付有価証券 13,600株
ラックランド	4,300	1,555.00	6,686,500	
共立メンテナンス	31,000	2,291.00	71,021,000	貸付有価証券 1,400株
イチネンホールディングス	20,900	1,198.00	25,038,200	
建設技術研究所	12,900	1,691.00	21,813,900	貸付有価証券 6,100株
スペース	12,100	1,112.00	13,455,200	貸付有価証券 5,700株
長大	6,900	801.00	5,526,900	貸付有価証券 100株(100株)
燦ホールディングス	8,100	1,277.00	10,343,700	
スバル興業	1,100	7,770.00	8,547,000	
東京テアトル	7,300	1,130.00	8,249,000	貸付有価証券 1,900株
タナベ経営	3,600	1,299.00	4,676,400	
ナガワ	6,000	7,000.00	42,000,000	貸付有価証券 2,800株
よみうりランド	4,100	3,275.00	13,427,500	貸付有価証券

				1,900株
東京都競馬	12,200	2,796.00	34,111,200	貸付有価証券 5,600株
常磐興産	7,500	1,401.00	10,507,500	貸付有価証券 3,400株
カナモト	30,600	2,133.00	65,269,800	貸付有価証券 14,300株
東京ドーム	75,700	725.00	54,882,500	貸付有価証券 33,700株
西尾レントオール	19,000	2,309.00	43,871,000	貸付有価証券 200株
トランス・コスモス	17,800	1,916.00	34,104,800	貸付有価証券 900株
乃村工藝社	80,100	839.00	67,203,900	貸付有価証券 38,000株
藤田観光	8,200	1,568.00	12,857,600	貸付有価証券 3,800株
KNT - CTホールディングス	11,600	711.00	8,247,600	貸付有価証券 5,400株
日本管財	20,000	1,744.00	34,880,000	貸付有価証券 2,600株
トーカイ	18,100	3,060.00	55,386,000	
白洋舎	2,100	2,680.00	5,628,000	
セコム	198,500	8,914.00	1,769,429,000	貸付有価証券 200株
セントラル警備保障	9,000	3,925.00	35,325,000	貸付有価証券 4,200株
丹青社	35,300	734.00	25,910,200	貸付有価証券 16,700株
メイテック	23,100	4,180.00	96,558,000	貸付有価証券 100株
応用地質	20,100	1,221.00	24,542,100	貸付有価証券 9,500株
船井総研ホールディングス	38,600	2,200.00	84,920,000	貸付有価証券 200株
進学会ホールディングス	7,300	462.00	3,372,600	貸付有価証券 3,400株
オオバ	13,500	520.00	7,020,000	
いであ	3,400	1,401.00	4,763,400	貸付有価証券 200株
学究社	5,500	1,156.00	6,358,000	
ベネッセホールディング	62,300	2,862.00	178,302,600	

	ス				
	イオンディライト	23,000	3,375.00	77,625,000	貸付有価証券 10,900株
	ナック	10,300	811.00	8,353,300	貸付有価証券 4,800株
	ニチイ学館	26,600	1,063.00	28,275,800	
	ダイセキ	31,400	2,340.00	73,476,000	貸付有価証券 14,800株
	ステップ	6,800	1,478.00	10,050,400	
小計	銘柄数：2,146			395,375,350,680	
	組入時価比率：95.9%			100.0%	
合計				395,375,350,680	

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

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

## (2) 株式以外の有価証券(2020年3月30日現在)

(単位:円)

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 3月30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	16,671,874,596	-	16,668,700,000	3,757,706
合計	16,671,874,596	-	16,668,700,000	3,757,706

(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。

## 野村日本株IPストラテジー マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2020年 3月30日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	147,020,121
株式	19,157,741,250
未収配当金	189,236,186
流動資産合計	19,493,997,557
資産合計	19,493,997,557
負債の部	
流動負債	
未払利息	129
流動負債合計	129
負債合計	129
純資産の部	
元本等	
元本	12,770,712,367
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,723,285,061
元本等合計	19,493,997,428
純資産合計	19,493,997,428
負債純資産合計	19,493,997,557

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

## （貸借対照表に関する注記）

2020年 3月30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	1.5265円
(10,000口当たり純資産額)	(15,265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 3月30日 至 2020年 3月30日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、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>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>    市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>    信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>    流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月30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 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。</p>

## （その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 3月30日現在	
期首	2019年 3月30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	430,712,563円
同期中における追加設定元本額	15,841,856,414円
同期中における一部解約元本額	3,501,856,610円
期末元本額	12,770,712,367円
期末元本額の内訳*	
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	698,478,475円
ノムラFOFs用・日本株IPストラテジー・ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	12,072,233,892円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年3月30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	日本水産	50,800	517.00	26,263,600	
		東建コーポレーション	1,300	8,000.00	10,400,000	
		大東建託	9,500	10,560.00	100,320,000	
		森永製菓	7,200	4,635.00	33,372,000	
		江崎グリコ	8,200	4,800.00	39,360,000	
		山崎製パン	35,000	2,359.00	82,565,000	
		亀田製菓	4,500	5,010.00	22,545,000	
		寿スピリッツ	3,800	4,865.00	18,487,000	
		カルビー	13,100	2,961.00	38,789,100	
		森永乳業	15,200	4,180.00	63,536,000	
		ヤクルト本社	10,600	6,620.00	70,172,000	
		明治ホールディングス	15,100	7,760.00	117,176,000	
		雪印メグミルク	12,000	2,555.00	30,660,000	
		日本ハム	18,800	3,980.00	74,824,000	
		丸大食品	6,800	2,100.00	14,280,000	
		伊藤ハム米久ホールディングス	100	655.00	65,500	
		サッポロホールディングス	10,900	2,052.00	22,366,800	
		アサヒグループホールディングス	28,500	3,661.00	104,338,500	
		麒麟ホールディングス	129,800	2,264.50	293,932,100	
		宝ホールディングス	11,800	819.00	9,664,200	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	28,000	2,288.00	64,064,000			
サントリー食品インターナショナル	20,100	4,260.00	85,626,000			

ダイドーグループホールディングス	5,500	3,750.00	20,625,000
伊藤園	15,700	5,850.00	91,845,000
キッコーマン	30,600	4,575.00	139,995,000
味の素	24,600	2,026.50	49,851,900
キューピー	15,900	2,301.00	36,585,900
ハウス食品グループ本社	6,300	3,665.00	23,089,500
カゴメ	13,600	2,912.00	39,603,200
ニチレイ	2,400	3,070.00	7,368,000
東洋水産	12,400	5,700.00	70,680,000
日清食品ホールディングス	10,600	9,380.00	99,428,000
日本たばこ産業	6,700	2,053.50	13,758,450
北の達人コーポレーション	9,300	542.00	5,040,600
帝人	27,200	1,900.00	51,680,000
ワコールホールディングス	6,600	2,486.00	16,407,600
T S Iホールディングス	59,000	422.00	24,898,000
ワールド	2,800	1,566.00	4,384,800
オンワードホールディングス	68,900	486.00	33,485,400
ゴールドウイン	3,300	6,250.00	20,625,000
デサント	21,400	1,317.00	28,183,800
住友化学	50,300	329.00	16,548,700
日産化学	19,000	4,005.00	76,095,000
石原産業	8,600	571.00	4,910,600
東ソー	35,700	1,244.00	44,410,800
トクヤマ	23,300	2,127.00	49,559,100
三井化学	14,600	2,105.00	30,733,000
積水化学工業	94,900	1,479.00	140,357,100
日本ゼオン	5,900	851.00	5,020,900
花王	47,200	8,900.00	420,080,000
D I C	7,900	2,479.00	19,584,100
富士フイルムホールディングス	41,400	5,320.00	220,248,000
資生堂	43,900	6,440.00	282,716,000
ライオン	40,500	2,337.00	94,648,500
マンダム	8,600	2,119.00	18,223,400
ミルボン	6,700	5,490.00	36,783,000
ファンケル	26,700	2,447.00	65,334,900
コーセー	5,000	13,700.00	68,500,000
ポーラ・オルビスホールディングス	36,500	2,045.00	74,642,500
ノエビアホールディングス	6,400	5,620.00	35,968,000
小林製薬	4,200	10,240.00	43,008,000
タカラバイオ	3,200	2,258.00	7,225,600
デクセリアルズ	16,500	706.00	11,649,000
アース製薬	5,000	5,980.00	29,900,000

日東電工	22,400	4,865.00	108,976,000
ユニ・チャーム	39,200	4,047.00	158,642,400
協和キリン	47,100	2,492.00	117,373,200
アステラス製薬	230,200	1,722.00	396,404,400
大日本住友製薬	28,500	1,442.00	41,097,000
塩野義製薬	38,500	5,426.00	208,901,000
日本新薬	1,900	8,530.00	16,207,000
中外製薬	1,400	12,405.00	17,367,000
科研製薬	7,500	5,140.00	38,550,000
エーザイ	36,600	7,833.00	286,687,800
ロート製薬	19,600	3,100.00	60,760,000
久光製薬	6,700	5,370.00	35,979,000
持田製薬	7,000	4,580.00	32,060,000
参天製薬	20,600	1,912.00	39,387,200
烏居薬品	3,000	2,710.00	8,130,000
JCRファーマ	2,000	9,310.00	18,620,000
ゼリア新薬工業	5,200	2,197.00	11,424,400
第一三共	54,800	7,664.00	419,987,200
キョーリン製薬ホールディングス	14,800	2,199.00	32,545,200
大塚ホールディングス	51,000	4,295.00	219,045,000
大正製薬ホールディングス	600	7,050.00	4,230,000
TOYO TIRE	37,700	1,263.00	47,615,100
ブリヂストン	77,100	3,409.00	262,833,900
住友ゴム工業	19,300	1,069.00	20,631,700
日東紡績	2,300	4,960.00	11,408,000
太平洋セメント	24,200	1,935.00	46,827,000
TOTO	25,100	3,720.00	93,372,000
ニチハ	8,600	2,134.00	18,352,400
古河電気工業	2,100	1,979.00	4,155,900
三和ホールディングス	18,100	857.00	15,511,700
LIXILグループ	46,500	1,332.00	61,938,000
ノーリツ	4,100	1,303.00	5,342,300
東芝機械	3,800	2,090.00	7,942,000
アマダホールディングス	39,600	872.00	34,531,200
DMG森精機	42,800	906.00	38,776,800
ディスコ	3,600	21,540.00	77,544,000
オイレス工業	1,000	1,406.00	1,406,000
サトーホールディングス	11,700	2,183.00	25,541,100
日立建機	10,000	2,230.00	22,300,000
荏原製作所	8,500	2,060.00	17,510,000
ダイキン工業	22,300	13,070.00	291,461,000
理想科学工業	13,100	1,701.00	22,283,100

SANKYO	2,000	3,170.00	6,340,000
アマノ	7,000	2,409.00	16,863,000
グローリー	21,800	2,605.00	56,789,000
セガサミーホールディングス	53,100	1,333.00	70,782,300
日本精工	43,700	711.00	31,070,700
日清紡ホールディングス	5,700	730.00	4,161,000
イビデン	10,500	2,323.00	24,391,500
コニカミノルタ	146,600	455.00	66,703,000
ブラザー工業	45,400	1,758.00	79,813,200
日立製作所	115,300	3,109.00	358,467,700
三菱電機	199,100	1,354.50	269,680,950
富士電機	18,100	2,429.00	43,964,900
安川電機	32,100	3,010.00	96,621,000
東芝テック	26,400	3,485.00	92,004,000
JVCケンウッド	137,000	199.00	27,263,000
オムロン	35,200	5,720.00	201,344,000
MCJ	7,700	594.00	4,573,800
日本電気	48,000	3,915.00	187,920,000
富士通	35,200	9,916.00	349,043,200
沖電気工業	44,500	1,024.00	45,568,000
サンケン電気	5,600	2,122.00	11,883,200
ルネサスエレクトロニクス	74,400	394.00	29,313,600
セイコーエプソン	62,400	1,229.00	76,689,600
ワコム	71,100	322.00	22,894,200
アルバック	4,100	2,613.00	10,713,300
パナソニック	378,500	837.90	317,145,150
アンリツ	32,700	2,038.00	66,642,600
富士通ゼネラル	9,700	1,949.00	18,905,300
フォスター電機	11,700	1,122.00	13,127,400
横河電機	72,600	1,322.00	95,977,200
アズビル	32,200	2,870.00	92,414,000
日本光電工業	18,500	4,335.00	80,197,500
アドバンテスト	32,900	4,295.00	141,305,500
シスメックス	15,000	7,994.00	119,910,000
オプテックスグループ	4,500	1,016.00	4,572,000
カシオ計算機	72,800	1,512.00	110,073,600
浜松ホトニクス	13,900	4,590.00	63,801,000
キャノン	136,900	2,441.00	334,172,900
リコー	111,300	780.00	86,814,000
象印マホービン	3,600	1,533.00	5,518,800
東京エレクトロン	15,800	20,295.00	320,661,000
マツダ	116,100	606.00	70,356,600

スズキ	60,500	2,800.00	169,400,000
ヤマハ発動機	64,500	1,350.00	87,075,000
ショーワ	7,300	2,259.00	16,490,700
鳥津製作所	38,700	2,950.00	114,165,000
ニコン	59,400	1,009.00	59,934,600
トプコン	54,000	836.00	45,144,000
オリンパス	198,400	1,506.00	298,790,400
タムロン	5,600	1,879.00	10,522,400
HOYA	47,700	9,652.00	460,400,400
シチズン時計	72,800	386.00	28,100,800
メニコン	3,600	4,905.00	17,658,000
バンダイナムコホールディングス	26,000	5,385.00	140,010,000
パイロットコーポレーション	6,100	3,755.00	22,905,500
タカラトミー	41,600	782.00	32,531,200
アシックス	78,400	1,022.00	80,124,800
ヤマハ	22,100	4,315.00	95,361,500
ピジョン	17,000	4,220.00	71,740,000
コクヨ	25,200	1,580.00	39,816,000
美津濃	9,100	1,933.00	17,590,300
東京瓦斯	6,600	2,646.50	17,466,900
東邦瓦斯	15,600	5,210.00	81,276,000
静岡ガス	15,600	943.00	14,710,800
九州旅客鉄道	3,800	3,110.00	11,818,000
T I S	4,500	1,821.00	8,194,500
グリー	96,000	404.00	38,784,000
ブロードリーフ	41,300	474.00	19,576,200
ティーガイア	18,800	2,066.00	38,840,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	21,000	1,529.00	32,109,000
トレンドマイクロ	14,500	5,400.00	78,300,000
日本オラクル	2,400	9,300.00	22,320,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,600	3,150.00	8,190,000
大塚商会	6,900	4,575.00	31,567,500
ネットワンシステムズ	23,400	2,216.00	51,854,400
エイベックス	11,000	850.00	9,350,000
日本ユニシス	20,900	2,910.00	60,819,000
日本電信電話	207,600	2,715.00	563,634,000
K D D I	143,500	3,211.00	460,778,500
N T T ドコモ	136,100	3,473.00	472,675,300
ゼンリン	7,500	1,117.00	8,377,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	17,600	4,845.00	85,272,000
カプコン	15,100	3,465.00	52,321,500

S C S K	3,600	4,885.00	17,586,000
T K C	1,200	5,090.00	6,108,000
コナミホールディングス	3,800	3,305.00	12,559,000
ミロク情報サービス	3,300	2,394.00	7,900,200
神戸物産	7,600	4,390.00	33,364,000
T O K A Iホールディングス	45,200	957.00	43,256,400
第一興商	1,100	2,991.00	3,290,100
キヤノンマーケティングジャパン	25,700	2,199.00	56,514,300
岩谷産業	7,600	3,625.00	27,550,000
サンリオ	30,600	1,476.00	45,165,600
モスフードサービス	9,900	2,607.00	25,809,300
オートバックスセブン	32,700	1,271.00	41,561,700
イエローハット	14,400	1,499.00	21,585,600
ミスミグループ本社	21,100	2,410.00	50,851,000
ローソン	3,300	6,310.00	20,823,000
サンエー	3,400	4,660.00	15,844,000
ゲオホールディングス	25,800	1,365.00	35,217,000
アダストリア	31,900	1,291.00	41,182,900
くら寿司	6,200	4,040.00	25,048,000
パルグループホールディングス	15,700	1,342.00	21,069,400
エディオン	43,700	905.00	39,548,500
セリア	6,000	3,185.00	19,110,000
アルペン	7,600	1,603.00	12,182,800
ジーンズホールディングス	4,400	6,090.00	26,796,000
ビックカメラ	44,000	901.00	39,644,000
D C Mホールディングス	27,200	1,004.00	27,308,800
J . フロント リテイリング	21,900	907.00	19,863,300
ドトール・日レスホールディングス	16,500	1,657.00	27,340,500
マツモトキヨシホールディングス	18,100	4,115.00	74,481,500
Z O Z O	32,400	1,474.00	47,757,600
ココカラファイン	4,300	5,760.00	24,768,000
三越伊勢丹ホールディングス	72,300	641.00	46,344,300
ウエルシアホールディングス	8,100	7,810.00	63,261,000
クリエイトS Dホールディングス	6,500	2,716.00	17,654,000
すかいらくホールディングス	57,800	1,614.00	93,289,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	27,100	998.00	27,045,800
セブン&アイ・ホールディングス	63,300	3,647.00	230,855,100
クリエイト・レストランツ・ホールディング	30,500	648.00	19,764,000
ツルハホールディングス	1,800	14,520.00	26,136,000
サンマルクホールディングス	9,500	1,776.00	16,872,000
トリドールホールディングス	9,800	1,141.00	11,181,800

スシローグローバルホールディングス	17,200	1,537.00	26,436,400
アトム	51,300	858.00	44,015,400
カップ・クリエイト	29,000	1,339.00	38,831,000
良品計画	44,400	1,204.00	53,457,600
コーナン商事	10,300	2,244.00	23,113,200
西松屋チェーン	10,700	752.00	8,046,400
ゼンショーホールディングス	33,800	2,045.00	69,121,000
サイゼリヤ	16,100	2,000.00	32,200,000
ユナイテッドアローズ	18,200	1,598.00	29,083,600
ハイデイ日高	2,300	1,549.00	3,562,700
コロワイド	12,000	1,632.00	19,584,000
壱番屋	4,500	4,515.00	20,317,500
スギホールディングス	7,200	5,950.00	42,840,000
ヨンドシーホールディングス	3,800	2,051.00	7,793,800
ファミリーマート	3,700	1,938.00	7,170,600
木曽路	14,800	2,441.00	36,126,800
日本瓦斯	10,100	3,685.00	37,218,500
ロイヤルホールディングス	19,400	1,788.00	34,687,200
ライフコーポレーション	2,900	2,960.00	8,584,000
リンガーハット	10,700	2,095.00	22,416,500
コメリ	6,900	1,976.00	13,634,400
青山商事	13,400	967.00	12,957,800
しまむら	4,200	7,170.00	30,114,000
松屋	11,800	642.00	7,575,600
アクシアル リテイリング	1,000	4,100.00	4,100,000
イズミ	6,600	3,060.00	20,196,000
平和堂	16,800	1,973.00	33,146,400
フジ	8,600	1,865.00	16,039,000
ヤオコー	4,000	6,810.00	27,240,000
ゼビオホールディングス	8,600	889.00	7,645,400
ケーズホールディングス	55,300	1,065.00	58,894,500
ヤマダ電機	166,400	451.00	75,046,400
アークランドサカモト	6,700	1,030.00	6,901,000
ニトリホールディングス	1,300	15,110.00	19,643,000
吉野家ホールディングス	40,000	2,020.00	80,800,000
王将フードサービス	7,600	5,710.00	43,396,000
プレナス	23,400	1,860.00	43,524,000
アークス	7,100	2,023.00	14,363,300
パローホールディングス	11,100	1,961.00	21,767,100
ファーストリテイリング	2,000	43,340.00	86,680,000
サンドラッグ	14,500	3,505.00	50,822,500
ベルーナ	2,400	496.00	1,190,400

スルガ銀行	3,500	370.00	1,295,000	
セブン銀行	19,100	285.00	5,443,500	
F P G	37,200	558.00	20,757,600	
岡三証券グループ	65,200	350.00	22,820,000	
松井証券	7,300	802.00	5,854,600	
かんぽ生命保険	44,500	1,366.00	60,787,000	
T & Dホールディングス	9,900	890.00	8,811,000	
全国保証	14,000	3,525.00	49,350,000	
L I F U L L	24,800	299.00	7,415,200	
ミクシィ	13,300	1,625.00	21,612,500	
パーソルホールディングス	29,400	1,100.00	32,340,000	
カカクコム	38,100	2,000.00	76,200,000	
ディップ	11,400	1,682.00	19,174,800	
インフォマート	25,000	680.00	17,000,000	
みらかホールディングス	23,100	2,375.00	54,862,500	
ダスキン	16,700	2,971.00	49,615,700	
サイバーエージェント	15,500	4,155.00	64,402,500	
エン・ジャパン	4,400	2,100.00	9,240,000	
リクルートホールディングス	136,400	2,943.50	401,493,400	
ベイカレント・コンサルティング	4,300	4,735.00	20,360,500	
トランス・コスモス	9,800	1,916.00	18,776,800	
メイテック	4,700	4,180.00	19,646,000	
ベネッセホールディングス	23,800	2,862.00	68,115,600	
小計	銘柄数：295		19,157,741,250	
	組入時価比率：98.3%		100.0%	
合計			19,157,741,250	

(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。

(2)株式以外の有価証券(2020年3月30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

該当事項はありません。

## 野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(2020年 3月30日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	59,844,373
株式	7,668,346,100

(2020年 3月30日現在)

未収入金	560,811,200
未収配当金	92,800,780
流動資産合計	8,381,802,453
資産合計	8,381,802,453
負債の部	
流動負債	
未払利息	52
流動負債合計	52
負債合計	52
純資産の部	
元本等	
元本	6,638,842,691
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,742,959,710
元本等合計	8,381,802,401
純資産合計	8,381,802,401
負債純資産合計	8,381,802,453

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 3月30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	1.2625円
(10,000口当たり純資産額)	(12,625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 3月30日

至 2020年 3月30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、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。

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

## 市場リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月30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。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## (その他の注記)

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 3月30日現在

期首	2019年 3月30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	457,997,370円
同期中における追加設定元本額	8,647,403,411円
同期中における一部解約元本額	2,466,558,090円
期末元本額	6,638,842,691円
期末元本額の内訳*	
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	288,905,313円
野村日本株最小分散ポートフォリオS(適格機関投資家専用)	293,258,423円
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	6,056,678,955円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年3月30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	マルハニチロ	4,000	2,329.00	9,316,000	
		ホクト	11,800	1,915.00	22,597,000	
		コムシスホールディングス	6,600	2,807.00	18,526,200	
		大成建設	11,500	3,355.00	38,582,500	
		西松建設	20,200	2,080.00	42,016,000	
		大東建託	8,600	10,560.00	90,816,000	
		N I P P O	19,000	2,351.00	44,669,000	
		前田道路	12,700	2,036.00	25,857,200	
		大和ハウス工業	32,300	2,718.50	87,807,550	
		積水ハウス	54,500	1,918.00	104,531,000	
		関電工	75,600	873.00	65,998,800	
		きんでん	25,900	1,614.00	41,802,600	
		協和エクシオ	26,700	2,415.00	64,480,500	
		日清製粉グループ本社	33,800	1,925.00	65,065,000	
		森永製菓	15,800	4,635.00	73,233,000	
		明治ホールディングス	1,800	7,760.00	13,968,000	
		伊藤ハム米久ホールディングス	47,200	655.00	30,916,000	
		アサヒグループホールディングス	27,700	3,661.00	101,409,700	
		コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	17,700	2,288.00	40,497,600	
		サントリー食品インターナショナル	20,400	4,260.00	86,904,000	
		伊藤園	15,500	5,850.00	90,675,000	
		不二製油グループ本社	3,000	2,692.00	8,076,000	
		味の素	29,100	2,026.50	58,971,150	
		キューピー	23,000	2,301.00	52,923,000	
		ハウス食品グループ本社	17,300	3,665.00	63,404,500	
		カゴメ	22,500	2,912.00	65,520,000	
		ニチレイ	7,100	3,070.00	21,797,000	
		東洋水産	17,000	5,700.00	96,900,000	
		日清食品ホールディングス	10,300	9,380.00	96,614,000	
		日本たばこ産業	57,800	2,053.50	118,692,300	
ワコールホールディングス	20,700	2,486.00	51,460,200			
ライオン	7,100	2,337.00	16,592,700			

小林製薬	7,500	10,240.00	76,800,000
エフピコ	9,600	7,220.00	69,312,000
協和キリン	5,300	2,492.00	13,207,600
アステラス製薬	78,100	1,722.00	134,488,200
中外製薬	9,700	12,405.00	120,328,500
科研製薬	15,600	5,140.00	80,184,000
久光製薬	2,300	5,370.00	12,351,000
持田製薬	7,800	4,580.00	35,724,000
ツムラ	17,400	2,804.00	48,789,600
キッセイ薬品工業	7,300	2,933.00	21,410,900
沢井製薬	11,100	5,950.00	66,045,000
第一三共	10,200	7,664.00	78,172,800
大塚ホールディングス	27,400	4,295.00	117,683,000
大正製薬ホールディングス	7,900	7,050.00	55,695,000
ペプチドリーム	3,900	3,640.00	14,196,000
SANKYO	14,800	3,170.00	46,916,000
ヒロセ電機	4,200	11,190.00	46,998,000
アズビル	28,900	2,870.00	82,943,000
日本光電工業	5,300	4,335.00	22,975,500
キャノン	52,500	2,441.00	128,152,500
リコー	74,300	780.00	57,954,000
HOYA	8,600	9,652.00	83,007,200
東京瓦斯	36,500	2,646.50	96,597,250
大阪瓦斯	44,800	2,097.00	93,945,600
東邦瓦斯	16,200	5,210.00	84,402,000
東武鉄道	21,000	3,840.00	80,640,000
相鉄ホールディングス	19,200	2,889.00	55,468,800
東急	25,600	1,734.00	44,390,400
京浜急行電鉄	34,500	1,929.00	66,550,500
小田急電鉄	31,300	2,472.00	77,373,600
京王電鉄	12,100	6,580.00	79,618,000
京成電鉄	9,200	3,205.00	29,486,000
東日本旅客鉄道	4,400	8,522.00	37,496,800
東海旅客鉄道	1,000	17,875.00	17,875,000
西日本鉄道	19,600	2,749.00	53,880,400
近鉄グループホールディングス	17,400	5,270.00	91,698,000
阪急阪神ホールディングス	21,700	3,815.00	82,785,500
南海電気鉄道	19,200	2,514.00	48,268,800
京阪ホールディングス	16,400	4,970.00	81,508,000
名古屋鉄道	26,400	3,140.00	82,896,000
福山通運	10,600	3,840.00	40,704,000
日立物流	8,300	2,405.00	19,961,500

九州旅客鉄道	9,500	3,110.00	29,545,000
S Gホールディングス	19,800	2,525.00	49,995,000
日本航空	11,400	2,069.00	23,586,600
コーエーテクモホールディングス	14,000	2,683.00	37,562,000
オービック	6,400	14,660.00	93,824,000
日本オラクル	9,100	9,300.00	84,630,000
伊藤忠テクノソリューションズ	13,900	3,150.00	43,785,000
日本電信電話	77,800	2,715.00	211,227,000
K D D I	49,400	3,211.00	158,623,400
ソフトバンク	84,500	1,354.50	114,455,250
光通信	3,900	19,190.00	74,841,000
N T T ドコモ	45,100	3,473.00	156,632,300
松竹	700	12,320.00	8,624,000
東宝	15,000	3,285.00	49,275,000
第一興商	19,500	2,991.00	58,324,500
伊藤忠商事	21,500	2,313.00	49,729,500
三井物産	77,900	1,570.00	122,303,000
住友商事	50,000	1,285.50	64,275,000
キャノンマーケティングジャパン	36,900	2,199.00	81,143,100
オートバックスセブン	35,600	1,271.00	45,247,600
ローソン	13,000	6,310.00	82,030,000
エービーシー・マート	14,200	5,460.00	77,532,000
エディオン	45,700	905.00	41,358,500
ウエルシアホールディングス	1,500	7,810.00	11,715,000
すかいらーくホールディングス	39,300	1,614.00	63,430,200
コスモス薬品	2,600	26,000.00	67,600,000
セブン&アイ・ホールディングス	34,500	3,647.00	125,821,500
ツルハホールディングス	5,300	14,520.00	76,956,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	35,200	2,058.00	72,441,600
ゼンショーホールディングス	34,800	2,045.00	71,166,000
スギホールディングス	10,900	5,950.00	64,855,000
しまむら	5,700	7,170.00	40,869,000
イズミ	5,800	3,060.00	17,748,000
ヤマダ電機	163,300	451.00	73,648,300
ニトリホールディングス	6,600	15,110.00	99,726,000
サンドラッグ	17,700	3,505.00	62,038,500
あおぞら銀行	9,500	2,187.00	20,776,500
日本M & Aセンター	19,600	2,800.00	54,880,000
総合警備保障	15,800	5,570.00	88,006,000
エムスリー	9,400	3,035.00	28,529,000
みらかホールディングス	6,900	2,375.00	16,387,500
オリエンタルランド	8,600	14,090.00	121,174,000

	ユー・エス・エス	54,600	1,500.00	81,900,000	
	リログループ	4,600	2,228.00	10,248,800	
	セコム	12,600	8,914.00	112,316,400	
	ベネッセホールディングス	13,300	2,862.00	38,064,600	
	小計 銘柄数：120 組入時価比率：91.5%			7,668,346,100	100.0%
合計				7,668,346,100	

(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。

(2)株式以外の有価証券(2020年3月30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

該当事項はありません。

## 野村 R A F I ( R ) 日本株投信マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(2020年 3月30日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	38,680,851
株式	3,724,834,010
派生商品評価勘定	627,505
未収配当金	58,177,898
差入委託証拠金	132,000
流動資産合計	3,822,452,264
資産合計	3,822,452,264
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	871,185
未払解約金	4,300,000
未払利息	33
流動負債合計	5,171,218
負債合計	5,171,218
純資産の部	
元本等	
元本	3,048,125,707
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	769,155,339
元本等合計	3,817,281,046
純資産合計	3,817,281,046
負債純資産合計	3,822,452,264

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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 3月30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	1.2523円
1口当たり純資産額	(12,523円)
(10,000口当たり純資産額)	

## (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 3月30日 至 2020年 3月30日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</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>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月30日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式、新株予約権証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

### (その他の注記)

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 3月30日現在	
期首	2019年 3月30日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	14,371,382,406円
同期中における追加設定元本額	1,395,490,131円
同期中における一部解約元本額	12,718,746,830円
期末元本額	3,048,125,707円
期末元本額の内訳*	
野村 R A F I ( R ) 日本株投信	1,493,394,839円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	588,657,936円
野村 R A F I ( R ) 日本株投信 F ( 適格機関投資家専用 )	966,072,932円

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2020年3月30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	日本水産	2,300	517.00	1,189,100	
		マルハニチロ	500	2,329.00	1,164,500	
		サカタのタネ	200	3,365.00	673,000	
		ホクト	300	1,915.00	574,500	
		日鉄鉱業	200	4,525.00	905,000	
		国際石油開発帝石	18,900	599.20	11,324,880	
		石油資源開発	800	1,789.00	1,431,200	
		K & O エナジーグループ	300	1,487.00	446,100	
		ショーボンドホールディングス	200	4,255.00	851,000	
		ミライト・ホールディングス	800	1,375.00	1,100,000	
		安藤・間	1,600	687.00	1,099,200	
		東急建設	1,400	581.00	813,400	
		コムシスホールディングス	700	2,807.00	1,964,900	
		高松コンストラクショングループ	300	2,347.00	704,100	
		東建コーポレーション	200	8,000.00	1,600,000	
		大成建設	1,900	3,355.00	6,374,500	
		大林組	6,300	956.00	6,022,800	
		清水建設	6,100	867.00	5,288,700	
		長谷工コーポレーション	3,200	1,203.00	3,849,600	
		鹿島建設	5,100	1,155.00	5,890,500	
		西松建設	700	2,080.00	1,456,000	
		三井住友建設	1,700	492.00	836,400	
		大豊建設	200	2,279.00	455,800	
		前田建設工業	1,800	779.00	1,402,200	
		奥村組	500	2,274.00	1,137,000	
		東鉄工業	300	2,959.00	887,700	
		戸田建設	2,800	641.00	1,794,800	
		熊谷組	400	2,481.00	992,400	
		大東建託	600	10,560.00	6,336,000	
		新日本建設	800	864.00	691,200	
N I P P O	1,100	2,351.00	2,586,100			
前田道路	300	2,036.00	610,800			
日本道路	100	6,880.00	688,000			

東洋建設	1,000	431.00	431,000
五洋建設	1,900	583.00	1,107,700
福田組	200	4,600.00	920,000
住友林業	1,600	1,442.00	2,307,200
大和ハウス工業	5,800	2,718.50	15,767,300
ライト工業	400	1,231.00	492,400
積水ハウス	5,200	1,918.00	9,973,600
ユアテック	1,400	637.00	891,800
中電工	600	2,248.00	1,348,800
関電工	1,500	873.00	1,309,500
きんでん	1,700	1,614.00	2,743,800
トーエネック	200	3,220.00	644,000
住友電設	200	2,280.00	456,000
日本電設工業	500	2,194.00	1,097,000
協和エクシオ	700	2,415.00	1,690,500
九電工	500	3,070.00	1,535,000
三機工業	500	1,213.00	606,500
日揮ホールディングス	1,400	872.00	1,220,800
太平電業	200	2,445.00	489,000
高砂熱学工業	500	1,711.00	855,500
大気社	300	3,240.00	972,000
日比谷総合設備	300	2,062.00	618,600
レイズネクスト	400	1,264.00	505,600
日本製粉	700	1,718.00	1,202,600
日清製粉グループ本社	1,400	1,925.00	2,695,000
昭和産業	300	3,225.00	967,500
三井製糖	400	2,176.00	870,400
森永製菓	200	4,635.00	927,000
江崎グリコ	400	4,800.00	1,920,000
山崎製パン	1,400	2,359.00	3,302,600
亀田製菓	100	5,010.00	501,000
カルビー	500	2,961.00	1,480,500
森永乳業	300	4,180.00	1,254,000
ヤクルト本社	600	6,620.00	3,972,000
明治ホールディングス	800	7,760.00	6,208,000
雪印メグミルク	600	2,555.00	1,533,000

プリマハム	400	2,523.00	1,009,200
日本ハム	800	3,980.00	3,184,000
丸大食品	300	2,100.00	630,000
S Foods	300	2,356.00	706,800
伊藤ハム米久ホールディングス	1,900	655.00	1,244,500
サッポロホールディングス	600	2,052.00	1,231,200
アサヒグループホールディングス	2,200	3,661.00	8,054,200
キリンホールディングス	4,900	2,264.50	11,096,050
宝ホールディングス	1,000	819.00	819,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホルデ	1,200	2,288.00	2,745,600
サントリー食品インターナショナル	1,700	4,260.00	7,242,000
ダイドーグループホールディングス	200	3,750.00	750,000
伊藤園	300	5,850.00	1,755,000
日清オイリオグループ	300	3,695.00	1,108,500
不二製油グループ本社	500	2,692.00	1,346,000
J - オイルミルズ	200	4,555.00	911,000
キッコーマン	500	4,575.00	2,287,500
味の素	3,600	2,026.50	7,295,400
キューピー	900	2,301.00	2,070,900
ハウス食品グループ本社	500	3,665.00	1,832,500
カゴメ	400	2,912.00	1,164,800
アリアケジャパン	100	6,970.00	697,000
ニチレイ	800	3,070.00	2,456,000
東洋水産	500	5,700.00	2,850,000
日清食品ホールディングス	400	9,380.00	3,752,000
フジッコ	300	1,996.00	598,800
日本たばこ産業	21,200	2,053.50	43,534,200
わらべや日洋ホールディングス	200	1,734.00	346,800
理研ビタミン	400	2,221.00	888,400
ゲンゼ	200	3,780.00	756,000
東洋紡	900	1,140.00	1,026,000
倉敷紡績	300	2,523.00	756,900
日本毛織	600	960.00	576,000
帝人	2,000	1,900.00	3,800,000
東レ	13,700	480.00	6,576,000

セーレン	500	1,351.00	675,500
ワコールホールディングス	600	2,486.00	1,491,600
ホギメディカル	200	3,440.00	688,000
T S Iホールディングス	1,000	422.00	422,000
ワールド	400	1,566.00	626,400
オンワードホールディングス	1,700	486.00	826,200
ゴールドウイン	100	6,250.00	625,000
デサント	400	1,317.00	526,800
特種東海製紙	200	4,130.00	826,000
王子ホールディングス	9,300	593.00	5,514,900
日本製紙	1,400	1,583.00	2,216,200
三菱製紙	900	364.00	327,600
北越コーポレーション	2,500	416.00	1,040,000
大王製紙	1,100	1,498.00	1,647,800
レンゴー	2,500	865.00	2,162,500
トーモク	300	1,548.00	464,400
ザ・バック	200	3,690.00	738,000
クラレ	3,900	1,129.00	4,403,100
旭化成	17,400	822.30	14,308,020
昭和電工	1,400	2,311.00	3,235,400
住友化学	30,800	329.00	10,133,200
住友精化	200	2,772.00	554,400
日産化学	600	4,005.00	2,403,000
クレハ	200	4,470.00	894,000
石原産業	800	571.00	456,800
日本曹達	400	2,774.00	1,109,600
東ソー	3,800	1,244.00	4,727,200
トクヤマ	400	2,127.00	850,800
セントラル硝子	500	1,916.00	958,000
東亜合成	1,200	978.00	1,173,600
大阪ソーダ	200	2,713.00	542,600
関東電化工業	500	777.00	388,500
デンカ	800	2,346.00	1,876,800
信越化学工業	1,700	10,735.00	18,249,500
堺化学工業	200	1,929.00	385,800
エア・ウォーター	1,600	1,544.00	2,470,400

大陽日酸	1,700	1,662.00	2,825,400
日本パーカライジング	1,100	1,195.00	1,314,500
高圧ガス工業	500	740.00	370,000
四国化成工業	500	1,070.00	535,000
日本触媒	400	5,180.00	2,072,000
大日精化工業	300	2,451.00	735,300
カネカ	800	2,663.00	2,130,400
三菱瓦斯化学	3,000	1,189.00	3,567,000
三井化学	2,100	2,105.00	4,420,500
J S R	1,900	1,845.00	3,505,500
東京応化工業	300	4,175.00	1,252,500
三菱ケミカルホールディングス	20,100	668.00	13,426,800
K H ネオケム	400	1,553.00	621,200
ダイセル	3,800	822.00	3,123,600
住友ベークライト	400	2,277.00	910,800
積水化学工業	3,300	1,479.00	4,880,700
日本ゼオン	1,700	851.00	1,446,700
アイカ工業	400	3,230.00	1,292,000
宇部興産	1,400	1,691.00	2,367,400
積水樹脂	400	2,066.00	826,400
タキロンシーアイ	900	607.00	546,300
日立化成	900	4,595.00	4,135,500
積水化成品工業	600	588.00	352,800
ダイキョーニシカワ	1,200	512.00	614,400
森六ホールディングス	300	1,544.00	463,200
日本化薬	1,400	1,009.00	1,412,600
扶桑化学工業	200	3,050.00	610,000
A D E K A	1,000	1,393.00	1,393,000
日油	500	3,455.00	1,727,500
花王	1,500	8,900.00	13,350,000
三洋化成工業	200	4,110.00	822,000
日本ペイントホールディングス	1,000	5,800.00	5,800,000
関西ペイント	900	2,128.00	1,915,200
中国塗料	500	919.00	459,500
太陽ホールディングス	200	4,075.00	815,000
エスケー化研	100	37,000.00	3,700,000

D I C	1,200	2,479.00	2,974,800
サカタインクス	700	945.00	661,500
東洋インキ S Cホールディングス	700	2,221.00	1,554,700
富士フイルムホールディングス	3,000	5,320.00	15,960,000
資生堂	600	6,440.00	3,864,000
ライオン	800	2,337.00	1,869,600
高砂香料工業	300	2,067.00	620,100
マンダム	300	2,119.00	635,700
ファンケル	300	2,447.00	734,100
コーセー	200	13,700.00	2,740,000
ポーラ・オルビスホールディングス	900	2,045.00	1,840,500
ノエビアホールディングス	200	5,620.00	1,124,000
コニシ	300	1,496.00	448,800
長谷川香料	300	2,099.00	629,700
上村工業	100	5,900.00	590,000
小林製薬	200	10,240.00	2,048,000
デクセリアルズ	600	706.00	423,600
アース製薬	100	5,980.00	598,000
クミアイ化学工業	500	855.00	427,500
日本農薬	700	434.00	303,800
日東電工	1,400	4,865.00	6,811,000
藤森工業	200	2,991.00	598,200
未来工業	200	2,002.00	400,400
J S P	400	1,425.00	570,000
エフピコ	200	7,220.00	1,444,000
天馬	300	1,694.00	508,200
信越ポリマー	600	847.00	508,200
ニフコ	700	1,972.00	1,380,400
ユニ・チャーム	1,500	4,047.00	6,070,500
協和キリン	1,900	2,492.00	4,734,800
武田薬品工業	8,000	3,345.00	26,760,000
アステラス製薬	10,800	1,722.00	18,597,600
大日本住友製薬	1,900	1,442.00	2,739,800
塩野義製薬	1,300	5,426.00	7,053,800
日本新薬	200	8,530.00	1,706,000
中外製薬	800	12,405.00	9,924,000

科研製薬	300	5,140.00	1,542,000
エーザイ	1,200	7,833.00	9,399,600
ロート製薬	400	3,100.00	1,240,000
小野薬品工業	2,200	2,534.50	5,575,900
久光製薬	500	5,370.00	2,685,000
持田製薬	300	4,580.00	1,374,000
参天製薬	1,600	1,912.00	3,059,200
ツムラ	500	2,804.00	1,402,000
日医工	700	1,520.00	1,064,000
キッセイ薬品工業	400	2,933.00	1,173,200
生化学工業	400	1,154.00	461,600
鳥居薬品	200	2,710.00	542,000
東和薬品	400	2,385.00	954,000
沢井製薬	300	5,950.00	1,785,000
ゼリア新薬工業	300	2,197.00	659,100
第一三共	1,900	7,664.00	14,561,600
キョーリン製薬ホールディングス	700	2,199.00	1,539,300
大塚ホールディングス	3,100	4,295.00	13,314,500
大正製薬ホールディングス	600	7,050.00	4,230,000
日本コークス工業	4,800	63.00	302,400
ニチレキ	400	1,334.00	533,600
富士石油	2,200	188.00	413,600
出光興産	2,200	2,477.00	5,449,400
J X T Gホールディングス	49,600	367.80	18,242,880
コスモエネルギーホールディングス	1,200	1,508.00	1,809,600
横浜ゴム	1,700	1,457.00	2,476,900
TOYO TIRE	1,100	1,263.00	1,389,300
ブリヂストン	7,800	3,409.00	26,590,200
住友ゴム工業	4,000	1,069.00	4,276,000
オカモト	200	4,080.00	816,000
西川ゴム工業	300	1,236.00	370,800
ニッタ	300	2,208.00	662,400
住友理工	1,100	625.00	687,500
三ツ星ベルト	400	1,302.00	520,800
バンドー化学	600	685.00	411,000
日東紡績	200	4,960.00	992,000

A G C	2,400	2,774.00	6,657,600
日本電気硝子	1,400	1,498.00	2,097,200
住友大阪セメント	400	3,370.00	1,348,000
太平洋セメント	1,400	1,935.00	2,709,000
東海カーボン	1,400	903.00	1,264,200
ノリタケカンパニーリミテド	200	3,525.00	705,000
T O T O	800	3,720.00	2,976,000
日本硝子	2,600	1,452.00	3,775,200
日本特殊陶業	1,800	1,608.00	2,894,400
フジミインコーポレーテッド	200	2,671.00	534,200
ニチアス	500	2,000.00	1,000,000
ニチハ	300	2,134.00	640,200
日本製鉄	22,900	1,006.00	23,037,400
神戸製鋼所	9,700	354.00	3,433,800
合同製鐵	200	2,100.00	420,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	16,300	767.00	12,502,100
東京製鐵	1,600	699.00	1,118,400
共英製鋼	400	1,291.00	516,400
大和工業	700	1,864.00	1,304,800
大阪製鐵	500	1,217.00	608,500
淀川製鋼所	400	1,851.00	740,400
丸一鋼管	700	2,771.00	1,939,700
大同特殊鋼	500	3,655.00	1,827,500
山陽特殊製鋼	800	1,009.00	807,200
愛知製鋼	300	3,215.00	964,500
日立金属	3,500	1,148.00	4,018,000
新日本電工	2,100	155.00	325,500
日本軽金属ホールディングス	8,100	168.00	1,360,800
三井金属鉱業	600	1,803.00	1,081,800
東邦亜鉛	200	1,227.00	245,400
三菱マテリアル	1,900	2,207.00	4,193,300
住友金属鉱山	2,200	2,311.50	5,085,300
D O W Aホールディングス	600	2,786.00	1,671,600
古河機械金属	500	1,105.00	552,500
U A C J	600	1,624.00	974,400

古河電気工業	800	1,979.00	1,583,200
住友電気工業	8,400	1,166.50	9,798,600
フジクラ	3,700	317.00	1,172,900
リョービ	500	1,321.00	660,500
アーレスティ	1,100	360.00	396,000
アサヒホールディングス	300	2,347.00	704,100
トーカロ	400	998.00	399,200
SUMCO	1,600	1,383.00	2,212,800
川田テクノロジーズ	100	5,570.00	557,000
東洋製罐グループホールディングス	1,600	1,313.00	2,100,800
ホッカンホールディングス	300	1,705.00	511,500
コロナ	300	960.00	288,000
横河ブリッジホールディングス	300	1,989.00	596,700
三和ホールディングス	1,500	857.00	1,285,500
文化シャッター	700	833.00	583,100
三協立山	500	1,074.00	537,000
LIXILグループ	2,700	1,332.00	3,596,400
ノーリツ	500	1,303.00	651,500
長府製作所	300	2,614.00	784,200
リンナイ	300	7,740.00	2,322,000
岡部	500	747.00	373,500
ジーテクト	700	1,167.00	816,900
東プレ	800	1,223.00	978,400
高周波熱錬	400	738.00	295,200
パイオラックス	400	1,544.00	617,600
エイチワン	900	524.00	471,600
日本発條	2,700	747.00	2,016,900
三益半導体工業	200	1,724.00	344,800
日本製鋼所	400	1,267.00	506,800
三浦工業	300	3,940.00	1,182,000
タクマ	600	1,226.00	735,600
オークマ	300	3,465.00	1,039,500
東芝機械	200	2,090.00	418,000
アマダホールディングス	3,100	872.00	2,703,200
アイダエンジニアリング	700	678.00	474,600
FUJI	700	1,652.00	1,156,400

牧野フライス製作所	300	2,794.00	838,200
オーエスジー	700	1,466.00	1,026,200
旭ダイヤモンド工業	700	477.00	333,900
D M G 森精機	900	906.00	815,400
ソディック	600	633.00	379,800
ディスコ	200	21,540.00	4,308,000
日東工器	200	1,786.00	357,200
島精機製作所	300	1,485.00	445,500
やまびこ	500	837.00	418,500
ナブテスコ	700	2,432.00	1,702,400
三井海洋開発	600	1,331.00	798,600
S M C	300	46,000.00	13,800,000
ユニオンツール	200	2,659.00	531,800
オイレス工業	300	1,406.00	421,800
サトーホールディングス	200	2,183.00	436,600
小松製作所	8,700	1,877.50	16,334,250
住友重機械工業	1,200	2,016.00	2,419,200
日立建機	1,500	2,230.00	3,345,000
井関農機	300	1,171.00	351,300
ハーモニック・ドライブ・システムズ	200	4,650.00	930,000
クボタ	8,200	1,398.50	11,467,700
月島機械	300	1,410.00	423,000
新東工業	500	795.00	397,500
澁谷工業	200	2,590.00	518,000
アイチ コーポレーション	800	680.00	544,000
小森コーポレーション	700	767.00	536,900
荏原製作所	700	2,060.00	1,442,000
ダイキン工業	1,000	13,070.00	13,070,000
栗田工業	700	2,594.00	1,815,800
椿本チエイン	500	2,608.00	1,304,000
ダイフク	300	6,870.00	2,061,000
加藤製作所	300	1,239.00	371,700
タダノ	1,300	796.00	1,034,800
フジテック	600	1,431.00	858,600
C K D	400	1,444.00	577,600

平和	1,100	2,003.00	2,203,300
理想科学工業	400	1,701.00	680,400
SANKYO	700	3,170.00	2,219,000
マースグループホールディングス	200	1,804.00	360,800
フクシマガリレイ	200	3,370.00	674,000
ユニバーサルエンターテインメント	700	1,656.00	1,159,200
竹内製作所	500	1,366.00	683,000
アマノ	400	2,409.00	963,600
マックス	300	1,652.00	495,600
グローリー	500	2,605.00	1,302,500
大和冷機工業	400	958.00	383,200
セガサミーホールディングス	1,500	1,333.00	1,999,500
リケン	200	2,896.00	579,200
T P R	600	1,209.00	725,400
ツバキ・ナカシマ	400	693.00	277,200
ホシザキ	300	8,530.00	2,559,000
大豊工業	700	572.00	400,400
日本精工	5,800	711.00	4,123,800
NTN	6,500	196.00	1,274,000
ジェイテクト	4,100	755.00	3,095,500
不二越	300	3,005.00	901,500
THK	900	2,227.00	2,004,300
イーグル工業	900	710.00	639,000
キッツ	1,100	648.00	712,800
マキタ	1,300	3,400.00	4,420,000
日立造船	1,700	357.00	606,900
三菱重工業	4,200	2,819.50	11,841,900
I H I	1,300	1,316.00	1,710,800
スター精密	400	1,097.00	438,800
日清紡ホールディングス	1,700	730.00	1,241,000
イビデン	700	2,323.00	1,626,100
コニカミノルタ	6,700	455.00	3,048,500
ブラザー工業	2,200	1,758.00	3,867,600
ミネベアミツミ	2,000	1,613.00	3,226,000
日立製作所	9,500	3,109.00	29,535,500
三菱電機	15,800	1,354.50	21,401,100

富士電機	1,100	2,429.00	2,671,900
安川電機	700	3,010.00	2,107,000
明電舎	400	1,616.00	646,400
山洋電気	100	4,505.00	450,500
東芝テック	200	3,485.00	697,000
マブチモーター	600	3,360.00	2,016,000
日本電産	1,400	5,733.00	8,026,200
ダイヘン	200	2,995.00	599,000
JVCケンウッド	1,900	199.00	378,100
日新電機	800	873.00	698,400
オムロン	900	5,720.00	5,148,000
日東工業	300	1,804.00	541,200
I D E C	200	1,340.00	268,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	800	1,481.00	1,184,800
メルコホールディングス	200	2,152.00	430,400
日本電気	1,400	3,915.00	5,481,000
富士通	1,200	9,916.00	11,899,200
沖電気工業	900	1,024.00	921,600
サンケン電気	200	2,122.00	424,400
ルネサスエレクトロニクス	17,100	394.00	6,737,400
セイコーエプソン	4,200	1,229.00	5,161,800
ワコム	900	322.00	289,800
アルバック	400	2,613.00	1,045,200
E I Z O	200	3,235.00	647,000
日本信号	400	1,110.00	444,000
能美防災	300	2,092.00	627,600
エレコム	200	3,685.00	737,000
パナソニック	24,500	837.90	20,528,550
シャープ	1,500	1,170.00	1,755,000
アンリツ	400	2,038.00	815,200
富士通ゼネラル	500	1,949.00	974,500
ソニー	5,100	6,434.00	32,813,400
T D K	700	8,420.00	5,894,000
アルプスアルパイン	1,400	1,055.00	1,477,000
フォスター電機	300	1,122.00	336,600

ホシデン	400	761.00	304,400
ヒロセ電機	300	11,190.00	3,357,000
日本航空電子工業	700	1,341.00	938,700
マクセルホールディングス	600	1,081.00	648,600
横河電機	1,300	1,322.00	1,718,600
新電元工業	200	2,402.00	480,400
アズビル	600	2,870.00	1,722,000
日本光電工業	400	4,335.00	1,734,000
堀場製作所	200	5,480.00	1,096,000
アドバンテスト	400	4,295.00	1,718,000
キーエンス	400	35,400.00	14,160,000
シスメックス	500	7,994.00	3,997,000
O B A R A G R O U P	200	2,360.00	472,000
イリソ電子工業	100	3,090.00	309,000
スタンレー電気	1,200	2,175.00	2,610,000
ウシオ電機	800	1,060.00	848,000
カシオ計算機	1,300	1,512.00	1,965,600
ファナック	1,300	14,955.00	19,441,500
フクダ電子	200	9,100.00	1,820,000
エンプラス	200	2,251.00	450,200
ローム	700	6,200.00	4,340,000
浜松ホトニクス	500	4,590.00	2,295,000
新光電気工業	900	1,011.00	909,900
京セラ	2,100	6,395.00	13,429,500
太陽誘電	600	2,841.00	1,704,600
村田製作所	2,800	5,453.00	15,268,400
双葉電子工業	400	1,116.00	446,400
K O A	300	900.00	270,000
市光工業	600	481.00	288,600
小糸製作所	1,000	3,710.00	3,710,000
ミツバ	800	460.00	368,000
S C R E E Nホールディングス	300	3,985.00	1,195,500
キャノン電子	500	1,598.00	799,000
キャノン	12,700	2,441.00	31,000,700
リコー	5,300	780.00	4,134,000
象印マホービン	300	1,533.00	459,900

東京エレクトロン	700	20,295.00	14,206,500
トヨタ紡織	2,000	1,315.00	2,630,000
ユニプレス	900	1,003.00	902,700
豊田自動織機	2,800	5,370.00	15,036,000
モリタホールディングス	400	1,705.00	682,000
デンソー	7,900	3,590.00	28,361,000
東海理化電機製作所	1,000	1,369.00	1,369,000
三井E & Sホールディングス	1,100	539.00	592,900
川崎重工業	2,100	1,613.00	3,387,300
三菱ロジスネクスト	600	890.00	534,000
日産自動車	142,900	384.90	55,002,210
いすゞ自動車	11,600	745.10	8,643,160
トヨタ自動車	30,600	6,797.00	207,988,200
日野自動車	5,700	588.00	3,351,600
三菱自動車工業	15,600	328.00	5,116,800
武蔵精密工業	700	798.00	558,600
日産車体	1,000	995.00	995,000
新明和工業	600	1,145.00	687,000
極東開発工業	500	1,275.00	637,500
日信工業	600	2,211.00	1,326,600
トピー工業	400	1,363.00	545,200
タチエス	400	1,026.00	410,400
N O K	2,400	1,212.00	2,908,800
フタバ産業	900	474.00	426,600
K Y B	400	2,182.00	872,800
大同メタル工業	800	557.00	445,600
プレス工業	1,800	255.00	459,000
太平洋工業	600	990.00	594,000
ケーヒン	700	2,542.00	1,779,400
河西工業	1,000	548.00	548,000
アイシン精機	4,800	2,842.00	13,641,600
マツダ	11,500	606.00	6,969,000
本田技研工業	25,300	2,541.00	64,287,300
スズキ	4,800	2,800.00	13,440,000
S U B A R U	11,000	2,180.00	23,980,000
ヤマハ発動機	3,300	1,350.00	4,455,000

ショーワ	500	2,259.00	1,129,500
エクセディ	700	1,672.00	1,170,400
ハイレックスコーポレーション	600	1,207.00	724,200
豊田合成	1,300	1,934.00	2,514,200
愛三工業	1,000	525.00	525,000
日本精機	700	1,291.00	903,700
ヨロズ	500	1,108.00	554,000
エフ・シー・シー	500	1,585.00	792,500
シマノ	300	16,040.00	4,812,000
テイ・エス テック	800	2,701.00	2,160,800
テルモ	1,700	3,704.00	6,296,800
日機装	500	803.00	401,500
島津製作所	800	2,950.00	2,360,000
ナカニシ	400	1,394.00	557,600
東京精密	300	2,946.00	883,800
ニコン	3,500	1,009.00	3,531,500
トプコン	600	836.00	501,600
オリンパス	2,500	1,506.00	3,765,000
タムロン	200	1,879.00	375,800
HOYA	1,000	9,652.00	9,652,000
朝日インテック	200	2,694.00	538,800
シチズン時計	3,600	386.00	1,389,600
セイコーホールディングス	500	1,800.00	900,000
ニプロ	1,500	1,317.00	1,975,500
パラマウントベッドホールディングス	200	4,580.00	916,000
バンダイナムコホールディングス	800	5,385.00	4,308,000
パイロットコーポレーション	300	3,755.00	1,126,500
トッパン・フォームズ	1,000	984.00	984,000
フジシールインターナショナル	400	2,006.00	802,400
タカラトミー	500	782.00	391,000
大建工業	300	1,713.00	513,900
凸版印刷	3,000	1,716.00	5,148,000
大日本印刷	2,000	2,470.00	4,940,000
共同印刷	200	2,779.00	555,800
N I S S H A	900	730.00	657,000

アシックス	900	1,022.00	919,800
ヤマハ	700	4,315.00	3,020,500
ビジョン	300	4,220.00	1,266,000
リンテック	700	2,252.00	1,576,400
任天堂	300	40,930.00	12,279,000
三菱鉛筆	400	1,547.00	618,800
タカラスタンダード	600	1,712.00	1,027,200
コクヨ	900	1,580.00	1,422,000
オカムラ	1,000	882.00	882,000
美津濃	200	1,933.00	386,600
東京電力ホールディングス	82,300	399.00	32,837,700
中部電力	10,500	1,560.00	16,380,000
関西電力	13,500	1,222.00	16,497,000
中国電力	4,100	1,537.00	6,301,700
北陸電力	3,700	802.00	2,967,400
東北電力	10,000	1,070.00	10,700,000
四国電力	3,100	888.00	2,752,800
九州電力	7,600	889.00	6,756,400
北海道電力	5,400	488.00	2,635,200
沖縄電力	600	1,983.00	1,189,800
電源開発	2,700	2,329.00	6,288,300
東京瓦斯	4,600	2,646.50	12,173,900
大阪瓦斯	4,300	2,097.00	9,017,100
東邦瓦斯	700	5,210.00	3,647,000
北海道瓦斯	300	1,503.00	450,900
西部瓦斯	400	2,690.00	1,076,000
静岡ガス	800	943.00	754,400
メタウォーター	200	4,030.00	806,000
東武鉄道	1,100	3,840.00	4,224,000
相鉄ホールディングス	600	2,889.00	1,733,400
東急	3,200	1,734.00	5,548,800
京浜急行電鉄	1,100	1,929.00	2,121,900
小田急電鉄	1,400	2,472.00	3,460,800
京王電鉄	500	6,580.00	3,290,000
京成電鉄	700	3,205.00	2,243,500
東日本旅客鉄道	3,100	8,522.00	26,418,200

西日本旅客鉄道	1,300	7,697.00	10,006,100
東海旅客鉄道	1,400	17,875.00	25,025,000
西武ホールディングス	2,300	1,249.00	2,872,700
鴻池運輸	600	1,190.00	714,000
西日本鉄道	600	2,749.00	1,649,400
ハマキョウレックス	200	2,695.00	539,000
サカイ引越センター	100	5,890.00	589,000
近鉄グループホールディングス	700	5,270.00	3,689,000
阪急阪神ホールディングス	1,500	3,815.00	5,722,500
南海電気鉄道	800	2,514.00	2,011,200
京阪ホールディングス	400	4,970.00	1,988,000
名古屋鉄道	900	3,140.00	2,826,000
日本通運	700	5,300.00	3,710,000
ヤマトホールディングス	2,500	1,765.00	4,412,500
山九	400	4,370.00	1,748,000
丸全昭和運輸	200	2,313.00	462,600
センコーグループホールディングス	1,400	859.00	1,202,600
トナミホールディングス	100	4,580.00	458,000
ニッコンホールディングス	600	2,172.00	1,303,200
福山通運	400	3,840.00	1,536,000
セイノーホールディングス	1,800	1,224.00	2,203,200
神奈川中央交通	200	4,105.00	821,000
日立物流	700	2,405.00	1,683,500
九州旅客鉄道	700	3,110.00	2,177,000
S Gホールディングス	1,500	2,525.00	3,787,500
日本郵船	1,800	1,336.00	2,404,800
商船三井	1,200	1,789.00	2,146,800
川崎汽船	600	844.00	506,400
N S ユナイテッド海運	500	1,444.00	722,000
飯野海運	1,900	325.00	617,500
日本航空	6,100	2,069.00	12,620,900
A N Aホールディングス	3,100	2,700.00	8,370,000
日新	300	1,692.00	507,600
三菱倉庫	600	2,200.00	1,320,000
三井倉庫ホールディングス	300	1,478.00	443,400
住友倉庫	800	1,217.00	973,600

日本トランスシティ	800	494.00	395,200
名港海運	400	1,070.00	428,000
上組	900	1,878.00	1,690,200
近鉄エクスプレス	600	1,590.00	954,000
NEC ネットエスアイ	300	4,350.00	1,305,000
日鉄ソリューションズ	400	2,686.00	1,074,400
T I S	900	1,821.00	1,638,900
グリー	2,100	404.00	848,400
コーエーテクモホールディングス	500	2,683.00	1,341,500
ネクソン	3,100	1,837.00	5,694,700
コロブラ	900	829.00	746,100
ティーガイア	400	2,066.00	826,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	900	1,529.00	1,376,100
インターネットイニシアティブ	300	3,410.00	1,023,000
L I N E	200	5,220.00	1,044,000
アルテリア・ネットワークス	300	1,819.00	545,700
フジ・メディア・ホールディングス	2,900	1,109.00	3,216,100
オービック	200	14,660.00	2,932,000
Zホールディングス	26,900	345.00	9,280,500
トレンドマイクロ	600	5,400.00	3,240,000
日本オラクル	500	9,300.00	4,650,000
オービックビジネスコンサルタント	200	4,545.00	909,000
伊藤忠テクノソリューションズ	800	3,150.00	2,520,000
大塚商会	700	4,575.00	3,202,500
電通国際情報サービス	200	3,915.00	783,000
東映アニメーション	200	4,875.00	975,000
デジタルガレージ	200	3,425.00	685,000
WOWOW	300	2,491.00	747,300
ネットワンシステムズ	300	2,216.00	664,800
エイベックス	500	850.00	425,000
日本ユニシス	400	2,910.00	1,164,000
兼松エレクトロニクス	200	3,380.00	676,000
東京放送ホールディングス	1,600	1,625.00	2,600,000
日本テレビホールディングス	3,100	1,300.00	4,030,000
朝日放送グループホールディングス	600	701.00	420,600

テレビ朝日ホールディングス	1,000	1,722.00	1,722,000
スカパーJ S A Tホールディングス	3,700	393.00	1,454,100
テレビ東京ホールディングス	300	2,561.00	768,300
コネクシオ	400	1,382.00	552,800
日本電信電話	37,000	2,715.00	100,455,000
K D D I	18,000	3,211.00	57,798,000
ソフトバンク	25,500	1,354.50	34,539,750
光通信	200	19,190.00	3,838,000
沖縄セルラー電話	300	3,660.00	1,098,000
N T T ドコモ	21,000	3,473.00	72,933,000
G M O インターネット	500	1,811.00	905,500
K A D O K A W A	300	1,372.00	411,600
ゼンリン	300	1,117.00	335,100
松竹	100	12,320.00	1,232,000
東宝	700	3,285.00	2,299,500
東映	100	13,590.00	1,359,000
エヌ・ティ・ティ・データ	6,600	1,043.00	6,883,800
D T S	300	1,935.00	580,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	400	4,845.00	1,938,000
カブコン	400	3,465.00	1,386,000
S C S K	500	4,885.00	2,442,500
T K C	200	5,090.00	1,018,000
富士ソフト	200	3,545.00	709,000
N S D	400	1,507.00	602,800
コナミホールディングス	600	3,305.00	1,983,000
ソフトバンクグループ	22,400	3,693.00	82,723,200
伊藤忠食品	100	4,315.00	431,500
あらた	200	4,745.00	949,000
双日	14,800	263.00	3,892,400
アルフレッサ ホールディングス	1,400	2,241.00	3,137,400
横浜冷凍	400	984.00	393,600
神戸物産	200	4,390.00	878,000
あい ホールディングス	300	1,344.00	403,200
ダイワボウホールディングス	200	5,250.00	1,050,000
マクニカ・富士エレホールディングス	500	1,363.00	681,500

バイタルケーエスケー・ホールディングス	700	1,125.00	787,500
TOKAIホールディングス	1,000	957.00	957,000
シップヘルスケアホールディングス	300	4,610.00	1,383,000
小野建	400	1,154.00	461,600
ナガイレーベン	200	2,666.00	533,200
三菱食品	500	3,015.00	1,507,500
第一興商	400	2,991.00	1,196,400
メディバルホールディングス	1,500	2,183.00	3,274,500
アズワン	100	9,660.00	966,000
ドウシシャ	400	1,279.00	511,600
岡谷鋼機	200	8,050.00	1,610,000
シークス	400	871.00	348,400
伊藤忠商事	13,500	2,313.00	31,225,500
丸紅	23,700	562.40	13,328,880
長瀬産業	1,200	1,347.00	1,616,400
蝶理	300	1,641.00	492,300
豊田通商	3,000	2,587.00	7,761,000
兼松	900	1,129.00	1,016,100
三井物産	19,500	1,570.00	30,615,000
日本紙パルプ商事	200	3,840.00	768,000
日立ハイテク	500	7,960.00	3,980,000
カメイ	600	1,061.00	636,600
山善	900	969.00	872,100
住友商事	14,500	1,285.50	18,639,750
三菱商事	17,600	2,378.50	41,861,600
キャノンマーケティングジャパン	1,000	2,199.00	2,199,000
三谷商事	200	5,370.00	1,074,000
ユアサ商事	300	2,904.00	871,200
阪和興業	600	1,737.00	1,042,200
菱電商事	300	1,372.00	411,600
岩谷産業	500	3,625.00	1,812,500
三愛石油	700	1,185.00	829,500
稲畑産業	700	1,211.00	847,700
ワキタ	600	1,011.00	606,600
東邦ホールディングス	700	2,438.00	1,706,600

サンゲツ	500	1,654.00	827,000
ミツウロコグループホールディングス	400	1,178.00	471,200
伊藤忠エネクス	1,600	854.00	1,366,400
サンリオ	500	1,476.00	738,000
リョーサン	300	2,467.00	740,100
加賀電子	300	1,750.00	525,000
PALTAC	300	5,480.00	1,644,000
日鉄物産	400	3,685.00	1,474,000
トラスコ中山	400	2,391.00	956,400
オートバックスセブン	700	1,271.00	889,700
加藤産業	300	3,530.00	1,059,000
イエローハット	400	1,499.00	599,600
日伝	300	2,149.00	644,700
因幡電機産業	500	2,423.00	1,211,500
ミスミグループ本社	700	2,410.00	1,687,000
スズケン	600	4,350.00	2,610,000
ジェコス	500	836.00	418,000
ローソン	1,000	6,310.00	6,310,000
サンエー	200	4,660.00	932,000
カワチ薬品	300	2,517.00	755,100
エービーシー・マート	400	5,460.00	2,184,000
アスクル	200	3,360.00	672,000
ゲオホールディングス	700	1,365.00	955,500
アダストリア	300	1,291.00	387,300
日本マクドナルドホールディングス	200	4,940.00	988,000
バルグループホールディングス	400	1,342.00	536,800
エディオン	1,100	905.00	995,500
セリア	300	3,185.00	955,500
ナフコ	600	975.00	585,000
アルペン	400	1,603.00	641,200
ビックカメラ	1,000	901.00	901,000
DCMホールディングス	1,400	1,004.00	1,405,600
Monotaro	200	2,838.00	567,600
J.フロント リテイリング	2,100	907.00	1,904,700
ドトール・日レスホールディングス	400	1,657.00	662,800

マツモトキヨシホールディングス	500	4,115.00	2,057,500
Z O Z O	500	1,474.00	737,000
ココカラファイン	200	5,760.00	1,152,000
三越伊勢丹ホールディングス	3,200	641.00	2,051,200
ウエルシアホールディングス	300	7,810.00	2,343,000
クリエイトSDホールディングス	300	2,716.00	814,800
ジョイフル本田	600	1,325.00	795,000
すかいらーくホールディングス	900	1,614.00	1,452,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	1,100	998.00	1,097,800
日本調剤	400	1,680.00	672,000
コスモス薬品	100	26,000.00	2,600,000
セブン&アイ・ホールディングス	6,500	3,647.00	23,705,500
ツルハホールディングス	200	14,520.00	2,904,000
サンマルクホールディングス	300	1,776.00	532,800
トリドールホールディングス	400	1,141.00	456,400
クスリのアオキホールディングス	100	8,810.00	881,000
スシローグローバルホールディングス	400	1,537.00	614,800
LIXILピバ	500	1,825.00	912,500
ノジマ	500	1,913.00	956,500
良品計画	1,000	1,204.00	1,204,000
コーナン商事	500	2,244.00	1,122,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	1,400	2,058.00	2,881,200
西松屋チェーン	600	752.00	451,200
ゼンショーホールディングス	500	2,045.00	1,022,500
ワークマン	100	5,940.00	594,000
サイゼリヤ	300	2,000.00	600,000
VTホールディングス	1,300	309.00	401,700
ユナイテッドアローズ	200	1,598.00	319,600
荳番屋	100	4,515.00	451,500
スギホールディングス	300	5,950.00	1,785,000
ヨンドシーホールディングス	200	2,051.00	410,200
ファミリーマート	2,000	1,938.00	3,876,000
上新電機	300	2,141.00	642,300
日本瓦斯	300	3,685.00	1,105,500

島忠	500	2,735.00	1,367,500
チヨダ	400	1,203.00	481,200
ライフコーポレーション	400	2,960.00	1,184,000
A O K Iホールディングス	1,100	733.00	806,300
オークワ	400	1,812.00	724,800
コメリ	600	1,976.00	1,185,600
青山商事	1,200	967.00	1,160,400
しまむら	400	7,170.00	2,868,000
高島屋	2,200	1,003.00	2,206,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,600	785.00	1,256,000
丸井グループ	800	1,892.00	1,513,600
アクシアル リテイリング	200	4,100.00	820,000
イオン	5,000	2,450.00	12,250,000
イズミ	500	3,060.00	1,530,000
平和堂	600	1,973.00	1,183,800
フジ	300	1,865.00	559,500
ヤオコー	200	6,810.00	1,362,000
ゼビオホールディングス	500	889.00	444,500
ケーズホールディングス	1,600	1,065.00	1,704,000
A Tグループ	800	1,135.00	908,000
アインホールディングス	200	6,250.00	1,250,000
ヤマダ電機	6,200	451.00	2,796,200
アークランドサカモト	500	1,030.00	515,000
ニトリホールディングス	300	15,110.00	4,533,000
吉野家ホールディングス	200	2,020.00	404,000
王将フードサービス	100	5,710.00	571,000
プレナス	300	1,860.00	558,000
ミニストップ	300	1,482.00	444,600
アークス	600	2,023.00	1,213,800
パローホールディングス	600	1,961.00	1,176,600
ベルク	200	5,630.00	1,126,000
ファーストリテイリング	200	43,340.00	8,668,000
サンドラッグ	600	3,505.00	2,103,000
ベルーナ	1,100	496.00	545,600
めぶきフィナンシャルグループ	20,600	230.00	4,738,000
東京きらぼしフィナンシャルグルー	1,200	1,213.00	1,455,600

プ				
九州フィナンシャルグループ	8,300	442.00	3,668,600	
ゆうちょ銀行	5,200	1,018.00	5,293,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	18,800	340.00	6,392,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	3,400	659.00	2,240,600	
関西みらいフィナンシャルグループ	6,900	410.00	2,829,000	
三十三フィナンシャルグループ	1,000	1,576.00	1,576,000	
第四北越フィナンシャルグループ	900	2,455.00	2,209,500	
新生銀行	3,000	1,461.00	4,383,000	
あおぞら銀行	2,200	2,187.00	4,811,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	229,000	426.10	97,576,900	
りそなホールディングス	53,000	344.00	18,232,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	5,300	3,284.00	17,405,200	
三井住友フィナンシャルグループ	26,000	2,750.50	71,513,000	
千葉銀行	9,800	497.00	4,870,600	
群馬銀行	8,000	346.00	2,768,000	
武蔵野銀行	800	1,486.00	1,188,800	
千葉興業銀行	2,400	263.00	631,200	
筑波銀行	1,800	177.00	318,600	
七十七銀行	1,400	1,447.00	2,025,800	
青森銀行	300	2,640.00	792,000	
秋田銀行	400	1,648.00	659,200	
山形銀行	500	1,393.00	696,500	
岩手銀行	400	2,755.00	1,102,000	
東邦銀行	4,100	274.00	1,123,400	
みちのく銀行	300	1,234.00	370,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	2,300	1,546.00	3,555,800	
静岡銀行	7,100	696.00	4,941,600	
十六銀行	700	1,969.00	1,378,300	
スルガ銀行	2,900	370.00	1,073,000	
八十二銀行	8,000	401.00	3,208,000	
山梨中央銀行	900	783.00	704,700	
大垣共立銀行	700	2,285.00	1,599,500	
福井銀行	400	1,581.00	632,400	

北國銀行	400	3,495.00	1,398,000
清水銀行	200	1,940.00	388,000
滋賀銀行	700	2,672.00	1,870,400
南都銀行	600	2,339.00	1,403,400
百五銀行	4,600	317.00	1,458,200
京都銀行	800	3,685.00	2,948,000
紀陽銀行	900	1,662.00	1,495,800
ほくほくフィナンシャルグループ	3,200	1,005.00	3,216,000
広島銀行	5,800	487.00	2,824,600
山陰合同銀行	2,700	574.00	1,549,800
中国銀行	2,600	1,011.00	2,628,600
伊予銀行	5,100	565.00	2,881,500
百十四銀行	700	2,020.00	1,414,000
四国銀行	900	911.00	819,900
阿波銀行	600	2,394.00	1,436,400
大分銀行	400	2,020.00	808,000
宮崎銀行	400	2,494.00	997,600
佐賀銀行	400	1,196.00	478,400
沖縄銀行	300	3,310.00	993,000
琉球銀行	700	1,098.00	768,600
セブン銀行	8,600	285.00	2,451,000
みずほフィナンシャルグループ	457,900	130.00	59,527,000
山口フィナンシャルグループ	4,700	646.00	3,036,200
名古屋銀行	400	2,784.00	1,113,600
北洋銀行	9,600	213.00	2,044,800
愛知銀行	300	3,270.00	981,000
中京銀行	300	2,237.00	671,100
大光銀行	300	1,468.00	440,400
愛媛銀行	600	1,209.00	725,400
京葉銀行	2,700	578.00	1,560,600
栃木銀行	3,700	163.00	603,100
東和銀行	1,000	667.00	667,000
トモニホールディングス	3,200	390.00	1,248,000
フィデアホールディングス	5,100	106.00	540,600
池田泉州ホールディングス	8,400	168.00	1,411,200
F P G	500	558.00	279,000

S B Iホールディングス	1,700	1,581.00	2,687,700
ジャフコ	400	2,979.00	1,191,600
大和証券グループ本社	40,400	434.40	17,549,760
岡三証券グループ	2,900	350.00	1,015,000
丸三証券	1,100	464.00	510,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	4,900	258.00	1,264,200
いちよし証券	700	455.00	318,500
松井証券	2,000	802.00	1,604,000
マネックスグループ	2,000	176.00	352,000
極東証券	600	638.00	382,800
岩井コスモホールディングス	400	950.00	380,000
かんぽ生命保険	2,700	1,366.00	3,688,200
S O M P Oホールディングス	4,600	3,544.00	16,302,400
M S & A Dインシュアランスグループホール	6,100	3,100.00	18,910,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	2,500	1,827.00	4,567,500
第一生命ホールディングス	17,100	1,305.00	22,315,500
東京海上ホールディングス	5,600	5,093.00	28,520,800
T & Dホールディングス	6,700	890.00	5,963,000
全国保証	400	3,525.00	1,410,000
アルヒ	300	1,055.00	316,500
クレディセゾン	1,700	1,288.00	2,189,600
芙蓉総合リース	300	5,650.00	1,695,000
みずほリース	400	2,183.00	873,200
東京センチュリー	600	3,645.00	2,187,000
Jトラスト	900	230.00	207,000
日本証券金融	7,100	513.00	3,642,300
リコーリース	300	2,934.00	880,200
イオンフィナンシャルサービス	2,500	1,196.00	2,990,000
アコム	3,300	460.00	1,518,000
ジャックス	400	1,843.00	737,200
オリエン트コーポレーション	12,200	123.00	1,500,600
日立キャピタル	1,000	2,150.00	2,150,000
アプラスフィナンシャル	7,300	59.00	430,700
オリックス	19,000	1,373.50	26,096,500

三菱UFJリース	12,200	562.00	6,856,400
日本取引所グループ	2,700	1,916.00	5,173,200
NECキャピタルソリューション	300	1,839.00	551,700
いちご	1,900	256.00	486,400
ヒューリック	3,500	1,131.00	3,958,500
サムティ	300	1,222.00	366,600
プレサンスコーポレーション	500	983.00	491,500
ユニゾホールディングス	200	5,970.00	1,194,000
オープンハウス	400	2,171.00	868,400
東急不動産ホールディングス	5,000	523.00	2,615,000
飯田グループホールディングス	3,100	1,545.00	4,789,500
パーク24	800	1,620.00	1,296,000
三井不動産	6,900	1,862.50	12,851,250
三菱地所	7,100	1,628.50	11,562,350
平和不動産	300	2,768.00	830,400
東京建物	1,600	1,115.00	1,784,000
ダイビル	800	904.00	723,200
京阪神ビルディング	400	1,342.00	536,800
住友不動産	2,500	2,789.00	6,972,500
テーオーシー	800	624.00	499,200
レオパレス21	2,300	269.00	618,700
スターツコーポレーション	500	2,067.00	1,033,500
ゴールドクレスト	400	1,730.00	692,000
タカラレーベン	1,200	358.00	429,600
イオンモール	2,000	1,404.00	2,808,000
サンフロンティア不動産	400	856.00	342,400
日本空港ビルディング	300	4,580.00	1,374,000
ミクシィ	1,600	1,625.00	2,600,000
日本M&Aセンター	200	2,800.00	560,000
パーソルホールディングス	900	1,100.00	990,000
総合警備保障	400	5,570.00	2,228,000
カカクコム	500	2,000.00	1,000,000
ディップ	200	1,682.00	336,400
エムスリー	400	3,035.00	1,214,000
ディー・エヌ・エー	1,200	1,206.00	1,447,200
博報堂DYホールディングス	1,700	1,154.00	1,961,800

ぐるなび	400	566.00	226,400
ケネディクス	1,100	418.00	459,800
電通グループ	3,700	2,119.00	7,840,300
みらかホールディングス	600	2,375.00	1,425,000
オリエンタルランド	500	14,090.00	7,045,000
ダスキン	400	2,971.00	1,188,400
ラウンドワン	800	562.00	449,600
リゾートトラスト	800	1,086.00	868,800
ビー・エム・エル	300	2,982.00	894,600
りらいあコミュニケーションズ	300	1,059.00	317,700
ユー・エス・エス	1,300	1,500.00	1,950,000
サイバーエージェント	400	4,155.00	1,662,000
楽天	7,100	824.00	5,850,400
エン・ジャパン	100	2,100.00	210,000
テクノプロ・ホールディングス	200	5,090.00	1,018,000
リクルートホールディングス	3,000	2,943.50	8,830,500
日本郵政	18,700	851.10	15,915,570
ベルシステム24ホールディングス	1,300	1,152.00	1,497,600
リログループ	300	2,228.00	668,400
エイチ・アイ・エス	400	1,419.00	567,600
共立メンテナンス	200	2,291.00	458,200
東京都競馬	200	2,796.00	559,200
カナモト	400	2,133.00	853,200
東京ドーム	900	725.00	652,500
西尾レントオール	300	2,309.00	692,700
帝国ホテル	300	1,520.00	456,000
トランス・コスモス	300	1,916.00	574,800
乃村工藝社	400	839.00	335,600
トーカイ	200	3,060.00	612,000
セコム	1,100	8,914.00	9,805,400
メイテック	200	4,180.00	836,000
ベネッセホールディングス	600	2,862.00	1,717,200
イオンディライト	300	3,375.00	1,012,500
ニチイ学館	300	1,063.00	318,900
ダイセキ	200	2,340.00	468,000
小計銘柄数：988			3,724,834,010

	組入時価比率：97.6%		100.0%
合計			3,724,834,010

(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。

(2)株式以外の有価証券(2020年3月30日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	個数	評価額	備考
新株予約権証券	日本円	千葉興業銀行	2,400		0
	小計	銘柄数：1	2,400		0
		組入時価比率：0.0%			0.0%
合計					0

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 3月30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	56,841,700	-	56,600,000	243,680
合計	56,841,700	-	56,600,000	243,680

(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。

野村日経225 マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2020年 3月30日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	652,425,387
株式	12,715,168,320

(2020年 3月30日現在)

派生商品評価勘定	2,129,505
未収配当金	134,965,956
差入委託証拠金	75,350,000
流動資産合計	13,580,039,168
資産合計	13,580,039,168
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	30,137,820
未払解約金	146,646,830
未払利息	572
流動負債合計	176,785,222
負債合計	176,785,222
純資産の部	
元本等	
元本	9,749,417,567
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,653,836,379
元本等合計	13,403,253,946
純資産合計	13,403,253,946
負債純資産合計	13,580,039,168

## 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 3月30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	1,3748円
(10,000口当たり純資産額)	(13,748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 3月30日 至 2020年 3月30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>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月30日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており</p> <p>ます。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 3月30日現在	
期首	2019年 3月30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	10,638,124,034円
同期中における追加設定元本額	3,677,301,256円
同期中における一部解約元本額	4,566,007,723円
期末元本額	9,749,417,567円
期末元本額の内訳*	
野村時間分散投資「日経225・国内債券」（限定追加型）	43,388,026円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	371,116,692円
野村日本株リスクコントロール・ファンドVA（豪ドル投資型）（適格機関投資家専用）	4,799,728,831円
野村日本株リスクコントロール・ファンドVA（米ドル投資型）（適格機関投資家専用）	383,943,568円
野村日経225ターゲット（公社債運用移行型）Hプライス（適格機関投資家専用）	685,650,353円
野村日経225ターゲット（公社債運用移行型）Iプライス（適格機関投資家専用）	603,055円
野村日経225インデックスオープン投信（少数私募）	2,531,280,691円
野村日経225ターゲット（公社債運用移行型）Kプライス（適格機関投資家専用）	933,706,351円

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2020年3月30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	日本水産	24,000	517.00	12,408,000	
		マルハニチロ	2,400	2,329.00	5,589,600	
		国際石油開発帝石	9,600	599.20	5,752,320	
		コムシスホールディングス	24,000	2,807.00	67,368,000	
		大成建設	4,800	3,355.00	16,104,000	
		大林組	24,000	956.00	22,944,000	
		清水建設	24,000	867.00	20,808,000	
		長谷工コーポレーション	4,800	1,203.00	5,774,400	
		鹿島建設	12,000	1,155.00	13,860,000	
		大和ハウス工業	24,000	2,718.50	65,244,000	
		積水ハウス	24,000	1,918.00	46,032,000	
		日揮ホールディングス	24,000	872.00	20,928,000	

日清製粉グループ本社	24,000	1,925.00	46,200,000
明治ホールディングス	4,800	7,760.00	37,248,000
日本ハム	12,000	3,980.00	47,760,000
サッポロホールディングス	4,800	2,052.00	9,849,600
アサヒグループホールディングス	24,000	3,661.00	87,864,000
麒麟ホールディングス	24,000	2,264.50	54,348,000
宝ホールディングス	24,000	819.00	19,656,000
キッコーマン	24,000	4,575.00	109,800,000
味の素	24,000	2,026.50	48,636,000
ニチレイ	12,000	3,070.00	36,840,000
日本たばこ産業	24,000	2,053.50	49,284,000
東洋紡	2,400	1,140.00	2,736,000
ユニチカ	2,400	275.00	660,000
帝人	4,800	1,900.00	9,120,000
東レ	24,000	480.00	11,520,000
王子ホールディングス	24,000	593.00	14,232,000
日本製紙	2,400	1,583.00	3,799,200
クラレ	24,000	1,129.00	27,096,000
旭化成	24,000	822.30	19,735,200
昭和電工	2,400	2,311.00	5,546,400
住友化学	24,000	329.00	7,896,000
日産化学	24,000	4,005.00	96,120,000
東ソー	12,000	1,244.00	14,928,000
トクヤマ	4,800	2,127.00	10,209,600
デンカ	4,800	2,346.00	11,260,800
信越化学工業	24,000	10,735.00	257,640,000
三井化学	4,800	2,105.00	10,104,000
三菱ケミカルホールディングス	12,000	668.00	8,016,000
宇部興産	2,400	1,691.00	4,058,400
日本化薬	24,000	1,009.00	24,216,000
花王	24,000	8,900.00	213,600,000
D I C	2,400	2,479.00	5,949,600
富士フイルムホールディングス	24,000	5,320.00	127,680,000
資生堂	24,000	6,440.00	154,560,000
日東電工	24,000	4,865.00	116,760,000
協和キリン	24,000	2,492.00	59,808,000

武田薬品工業	24,000	3,345.00	80,280,000
アステラス製薬	120,000	1,722.00	206,640,000
大日本住友製薬	24,000	1,442.00	34,608,000
塩野義製薬	24,000	5,426.00	130,224,000
中外製薬	24,000	12,405.00	297,720,000
エーザイ	24,000	7,833.00	187,992,000
第一三共	24,000	7,664.00	183,936,000
大塚ホールディングス	24,000	4,295.00	103,080,000
出光興産	9,600	2,477.00	23,779,200
J X T Gホールディングス	24,000	367.80	8,827,200
横浜ゴム	12,000	1,457.00	17,484,000
ブリヂストン	24,000	3,409.00	81,816,000
A G C	4,800	2,774.00	13,315,200
日本板硝子	2,400	346.00	830,400
日本電気硝子	7,200	1,498.00	10,785,600
住友大阪セメント	2,400	3,370.00	8,088,000
太平洋セメント	2,400	1,935.00	4,644,000
東海カーボン	24,000	903.00	21,672,000
T O T O	12,000	3,720.00	44,640,000
日本碍子	24,000	1,452.00	34,848,000
日本製鉄	2,400	1,006.00	2,414,400
神戸製鋼所	2,400	354.00	849,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	2,400	767.00	1,840,800
大平洋金属	2,400	1,550.00	3,720,000
日本軽金属ホールディングス	24,000	168.00	4,032,000
三井金属鉱業	2,400	1,803.00	4,327,200
東邦亜鉛	2,400	1,227.00	2,944,800
三菱マテリアル	2,400	2,207.00	5,296,800
住友金属鉱山	12,000	2,311.50	27,738,000
D O W Aホールディングス	4,800	2,786.00	13,372,800
古河電気工業	2,400	1,979.00	4,749,600
住友電気工業	24,000	1,166.50	27,996,000
フジクラ	24,000	317.00	7,608,000
S U M C O	2,400	1,383.00	3,319,200
東洋製罐グループホールディングス	24,000	1,313.00	31,512,000

日本製鋼所	4,800	1,267.00	6,081,600
オークマ	4,800	3,465.00	16,632,000
アマダホールディングス	24,000	872.00	20,928,000
小松製作所	24,000	1,877.50	45,060,000
住友重機械工業	4,800	2,016.00	9,676,800
日立建機	24,000	2,230.00	53,520,000
クボタ	24,000	1,398.50	33,564,000
荏原製作所	4,800	2,060.00	9,888,000
ダイキン工業	24,000	13,070.00	313,680,000
日本精工	24,000	711.00	17,064,000
NTN	24,000	196.00	4,704,000
ジェイテクト	24,000	755.00	18,120,000
日立造船	4,800	357.00	1,713,600
三菱重工業	2,400	2,819.50	6,766,800
IHI	2,400	1,316.00	3,158,400
日清紡ホールディングス	24,000	730.00	17,520,000
コニカミノルタ	24,000	455.00	10,920,000
ミネベアミツミ	24,000	1,613.00	38,712,000
日立製作所	4,800	3,109.00	14,923,200
三菱電機	24,000	1,354.50	32,508,000
富士電機	4,800	2,429.00	11,659,200
安川電機	24,000	3,010.00	72,240,000
オムロン	24,000	5,720.00	137,280,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	4,800	1,481.00	7,108,800
日本電気	2,400	3,915.00	9,396,000
富士通	2,400	9,916.00	23,798,400
沖電気工業	2,400	1,024.00	2,457,600
セイコーエプソン	48,000	1,229.00	58,992,000
パナソニック	24,000	837.90	20,109,600
ソニー	24,000	6,434.00	154,416,000
TDK	24,000	8,420.00	202,080,000
アルプスアルパイン	24,000	1,055.00	25,320,000
横河電機	24,000	1,322.00	31,728,000
アドバンテスト	48,000	4,295.00	206,160,000
カシオ計算機	24,000	1,512.00	36,288,000

ファナック	24,000	14,955.00	358,920,000
京セラ	48,000	6,395.00	306,960,000
太陽誘電	24,000	2,841.00	68,184,000
S C R E E Nホールディングス	4,800	3,985.00	19,128,000
キヤノン	36,000	2,441.00	87,876,000
リコー	24,000	780.00	18,720,000
東京エレクトロン	24,000	20,295.00	487,080,000
デンソー	24,000	3,590.00	86,160,000
三井E & Sホールディングス	2,400	539.00	1,293,600
川崎重工業	2,400	1,613.00	3,871,200
日産自動車	24,000	384.90	9,237,600
いすゞ自動車	12,000	745.10	8,941,200
トヨタ自動車	24,000	6,797.00	163,128,000
日野自動車	24,000	588.00	14,112,000
三菱自動車工業	2,400	328.00	787,200
マツダ	4,800	606.00	2,908,800
本田技研工業	48,000	2,541.00	121,968,000
スズキ	24,000	2,800.00	67,200,000
S U B A R U	24,000	2,180.00	52,320,000
ヤマハ発動機	24,000	1,350.00	32,400,000
テルモ	96,000	3,704.00	355,584,000
ニコン	24,000	1,009.00	24,216,000
オリンパス	96,000	1,506.00	144,576,000
シチズン時計	24,000	386.00	9,264,000
バンダイナムコホールディングス	24,000	5,385.00	129,240,000
凸版印刷	12,000	1,716.00	20,592,000
大日本印刷	12,000	2,470.00	29,640,000
ヤマハ	24,000	4,315.00	103,560,000
東京電力ホールディングス	2,400	399.00	957,600
中部電力	2,400	1,560.00	3,744,000
関西電力	2,400	1,222.00	2,932,800
東京瓦斯	4,800	2,646.50	12,703,200
大阪瓦斯	4,800	2,097.00	10,065,600
東武鉄道	4,800	3,840.00	18,432,000
東急	12,000	1,734.00	20,808,000
小田急電鉄	12,000	2,472.00	29,664,000

京王電鉄	4,800	6,580.00	31,584,000
京成電鉄	12,000	3,205.00	38,460,000
東日本旅客鉄道	2,400	8,522.00	20,452,800
西日本旅客鉄道	2,400	7,697.00	18,472,800
東海旅客鉄道	2,400	17,875.00	42,900,000
日本通運	2,400	5,300.00	12,720,000
ヤマトホールディングス	24,000	1,765.00	42,360,000
日本郵船	2,400	1,336.00	3,206,400
商船三井	2,400	1,789.00	4,293,600
川崎汽船	2,400	844.00	2,025,600
A N Aホールディングス	2,400	2,700.00	6,480,000
三菱倉庫	12,000	2,200.00	26,400,000
Zホールディングス	9,600	345.00	3,312,000
トレンドマイクロ	24,000	5,400.00	129,600,000
スカパーJ S A Tホールディングス	2,400	393.00	943,200
日本電信電話	9,600	2,715.00	26,064,000
K D D I	144,000	3,211.00	462,384,000
N T Tドコモ	2,400	3,473.00	8,335,200
東宝	2,400	3,285.00	7,884,000
エヌ・ティ・ティ・データ	120,000	1,043.00	125,160,000
コナミホールディングス	24,000	3,305.00	79,320,000
ソフトバンクグループ	144,000	3,693.00	531,792,000
双日	2,400	263.00	631,200
伊藤忠商事	24,000	2,313.00	55,512,000
丸紅	24,000	562.40	13,497,600
豊田通商	24,000	2,587.00	62,088,000
三井物産	24,000	1,570.00	37,680,000
住友商事	24,000	1,285.50	30,852,000
三菱商事	24,000	2,378.50	57,084,000
J . フロント リテイリング	12,000	907.00	10,884,000
三越伊勢丹ホールディングス	24,000	641.00	15,384,000
セブン&アイ・ホールディングス	24,000	3,647.00	87,528,000
ファミリーマート	96,000	1,938.00	186,048,000
高島屋	12,000	1,003.00	12,036,000
丸井グループ	24,000	1,892.00	45,408,000
イオン	24,000	2,450.00	58,800,000

ファーストリテイリング	24,000	43,340.00	1,040,160,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	24,000	340.00	8,160,000
新生銀行	2,400	1,461.00	3,506,400
あおぞら銀行	2,400	2,187.00	5,248,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	24,000	426.10	10,226,400
りそなホールディングス	2,400	344.00	825,600
三井住友トラスト・ホールディングス	2,400	3,284.00	7,881,600
三井住友フィナンシャルグループ	2,400	2,750.50	6,601,200
千葉銀行	24,000	497.00	11,928,000
ふくおかフィナンシャルグループ	4,800	1,546.00	7,420,800
静岡銀行	24,000	696.00	16,704,000
みずほフィナンシャルグループ	24,000	130.00	3,120,000
大和証券グループ本社	24,000	434.40	10,425,600
野村ホールディングス	24,000	478.90	11,493,600
松井証券	24,000	802.00	19,248,000
SOMPOホールディングス	6,000	3,544.00	21,264,000
MS&ADインシュアランスグループホール	7,200	3,100.00	22,320,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	4,800	1,827.00	8,769,600
第一生命ホールディングス	2,400	1,305.00	3,132,000
東京海上ホールディングス	12,000	5,093.00	61,116,000
T&Dホールディングス	4,800	890.00	4,272,000
クレディセゾン	24,000	1,288.00	30,912,000
東急不動産ホールディングス	24,000	523.00	12,552,000
三井不動産	24,000	1,862.50	44,700,000
三菱地所	24,000	1,628.50	39,084,000
東京建物	12,000	1,115.00	13,380,000
住友不動産	24,000	2,789.00	66,936,000
エムスリー	57,600	3,035.00	174,816,000
ディー・エヌ・エー	7,200	1,206.00	8,683,200
電通グループ	24,000	2,119.00	50,856,000
サイバーエージェント	4,800	4,155.00	19,944,000
楽天	24,000	824.00	19,776,000
リクルートホールディングス	72,000	2,943.50	211,932,000

	日本郵政	24,000	851.10	20,426,400	
	セコム	24,000	8,914.00	213,936,000	
	小計 銘柄数：225			12,715,168,320	
	組入時価比率：94.9%			100.0%	
	合計			12,715,168,320	

(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。

(2)株式以外の有価証券(2020年3月30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 3月30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	723,590,000	-	695,600,000	28,008,315
合計	723,590,000	-	695,600,000	28,008,315

(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。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式

2020年4月30日現在

資産総額	3,271,086,985円
負債総額	4,917,073円
純資産総額（ - ）	3,266,169,912円
発行済口数	2,921,459,549口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1180円

（参考）国内株式マザーファンド

2020年4月30日現在

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

（参考）野村日本株IPストラテジー マザーファンド

2020年4月30日現在

資産総額	24,829,641,420円
負債総額	361円
純資産総額（ - ）	24,829,641,059円
発行済口数	16,104,321,606口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5418円

（参考）野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド

2020年4月30日現在

資産総額	13,807,323,297円
負債総額	403,728,429円
純資産総額（ - ）	13,403,594,868円
発行済口数	10,729,418,201口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2492円

## （参考）野村 R A F I（R）日本株投信マザーファンド

2020年4月30日現在

資産総額	3,804,933,318円
負債総額	60,543,706円
純資産総額（ - ）	3,744,389,612円
発行済口数	2,969,634,093口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2609円

## （参考）野村日経225 マザーファンド

2020年4月30日現在

資産総額	14,807,399,684円
負債総額	631,746,364円
純資産総額（ - ）	14,175,653,320円
発行済口数	9,740,392,526口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4553円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

## (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

## (3) 受益権の譲渡

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

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

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取扱い

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

## 第二部【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5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。

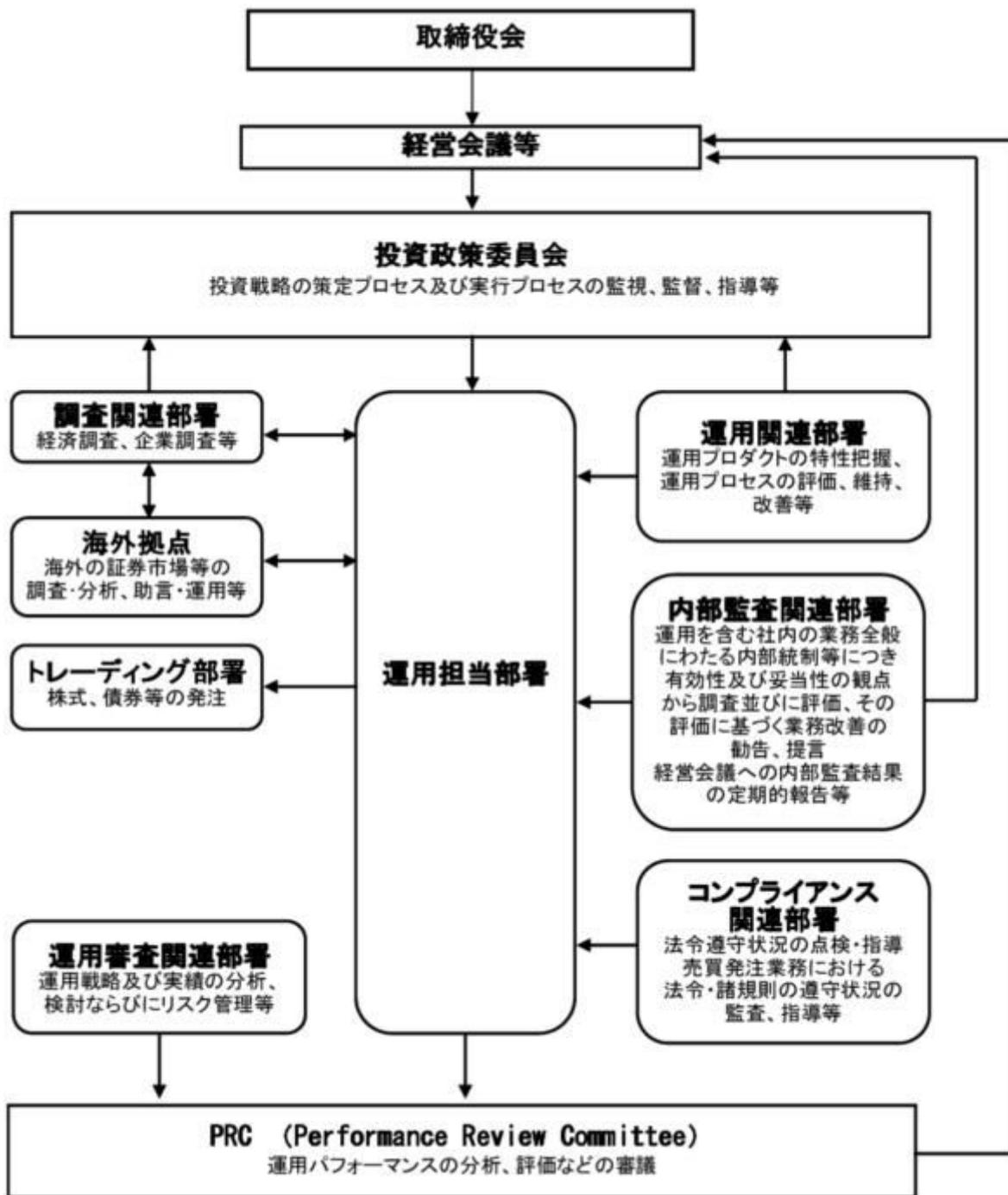
###### 代表取締役・業務執行取締役

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4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	1,014	27,839,261
単位型株式投資信託	178	815,084
追加型公社債投資信託	14	5,415,240
単位型公社債投資信託	459	1,603,257
合計	1,665	35,672,842

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

#### (1)【貸借対照表】

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

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

区分	注記 番号	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			133		145
未払金	1		17,853		16,709
未払収益分配金		1		0	
未払償還金		31		25	
未払手数料		7,884		7,724	
関係会社未払金		7,930		7,422	
その他未払金		2,005		1,535	
未払費用	1		12,441		11,704
未払法人税等			2,241		1,560
前受収益			33		29
賞与引当金			4,626		3,792
流動負債計			37,329		33,942
固定負債					
退職給付引当金			2,938		3,219
時効後支払損引当金			548		558
固定負債計			3,486		3,777
負債合計			40,816		37,720
(純資産の部)					
株主資本			86,078		86,924
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			55,168		56,014

利益準備金		685		685
その他利益剰余金		54,483		55,329
別途積立金		24,606		24,606
繰越利益剰余金		29,876		30,723
評価・換算差額等			11	33
その他有価証券評価差額金			11	33
純資産合計			86,090	86,958
負債・純資産合計			126,906	124,679

## (2) 【損益計算書】

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

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：百万円)

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

当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837
当期変動額									
剰余金の配当							25,598	25,598	25,598
当期純利益							24,840	24,840	24,840
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	758	758	758
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金			
		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

## [重要な会計方針]

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

<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>(5) 投資損失引当金  子会社等に対する投資に係る損失に備えるため、当該会社の財政状態等を勘案して必要額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理していません。</p> <p>連結納税制度を適用しております。</p>
---	--

## 【未適用の会計基準等】

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

### (1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

### (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 【表示方法の変更に関する注記】

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

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

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

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

#### [注記事項]

##### 貸借対照表関係

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

##### 損益計算書関係

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

##### 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

##### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

##### 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2017年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

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

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

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

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

## 金融商品関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### (1) 現金・預金

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

### (2) 金銭の信託

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

### (3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

ます。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1．売買目的有価証券(2018年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2018年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(2018年3月31日)

該当事項はありません。

## 4．その他有価証券(2018年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

## 当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 4．その他有価証券(2019年3月31日)

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

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

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

該当事項はありません。

## 退職給付関係

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

## 当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

## 及び前払年金費用の調整表

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

## 税効果会計関係

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

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

## セグメント情報等

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 関連当事者情報

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

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

(イ) 子会社等  
該当はありません。

## (ウ) 兄弟会社等

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

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

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

## (イ) 子会社等

該当はありません。

## (ウ) 兄弟会社等

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

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

## 1株当たり情報

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

## 中間財務諸表

## 中間貸借対照表

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

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

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

## 中間損益計算書

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

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

(単位:百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

## [重要な会計方針]

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

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

#### [注記事項]

##### 中間貸借対照表関係

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

##### 中間損益計算書関係

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

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

## 中間株主資本等変動計算書関係

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

## 金融商品関係

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

有価証券関係

当中間会計期間末（2019年9月30日）

## 1．満期保有目的の債券(2019年9月30日)

該当事項はありません。

## 2．子会社株式及び関連会社株式(2019年9月30日)

該当事項はありません。

## 3．その他有価証券(2019年9月30日)

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

## セグメント情報等

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

## 1．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2．関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 1 株当たり情報

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

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

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

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

2. 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託者

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

\* 2020年4月末現在

## (2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
F F G証券株式会社	3,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ごうぎん証券株式会社	3,000百万円	
株式会社熊本銀行	33,847百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社親和銀行	36,878百万円	
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	
株式会社福岡銀行	82,329百万円	

\* 2020年4月末現在

## 2【関係業務の概要】

## (1)受託者

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

## (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

## (1)受託者

該当事項はありません。

## (2)販売会社

該当事項はありません。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年 6月25日	有価証券届出書
2019年 6月25日	有価証券報告書
2019年12月25日	有価証券届出書の訂正届出書
2019年12月25日	半期報告書

## 独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

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

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

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2020年5月22日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 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

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」に掲げられているファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式の2019年3月30日から2020年3月30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。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式の2020年3月30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すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年11月28日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

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

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

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

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

#### 中間監査意見

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

#### 利害関係

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

以 上

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