

【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】	2021年9月15日提出
【計算期間】	第4期(自 2020年6月23日至 2021年6月22日)
【ファンド名】	野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０
【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】	ＣＥＯ兼代表取締役社長 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目２番１号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【連絡場所】	東京都江東区豊洲二丁目２番１号
【電話番号】	03-6387-5000
【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】

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

投資対象とする別に定める親投資信託証券とは「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」とします。

■ 信託金の限度額 ■

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

< 商品分類 >

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

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

（野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040）

《商品分類表》

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

《属性区分表》

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)			
	年2回				
	年4回	日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	北米	ファミリーファンド	あり ()	
	年12回 (毎月)	欧州			T O P I X
	年12回 (毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	中南米		なし	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券、 不動産投信) 資産配分変更型))	その他 ()	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ		その他 (合成指数)
		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、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産（その他資産（投資信託証券））と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産（資産複合）とが異なります。

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産による区分]

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

があるものをいう。

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

〔投資形態による属性区分〕

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

〔為替ヘッジによる属性区分〕

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

〔インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分〕

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

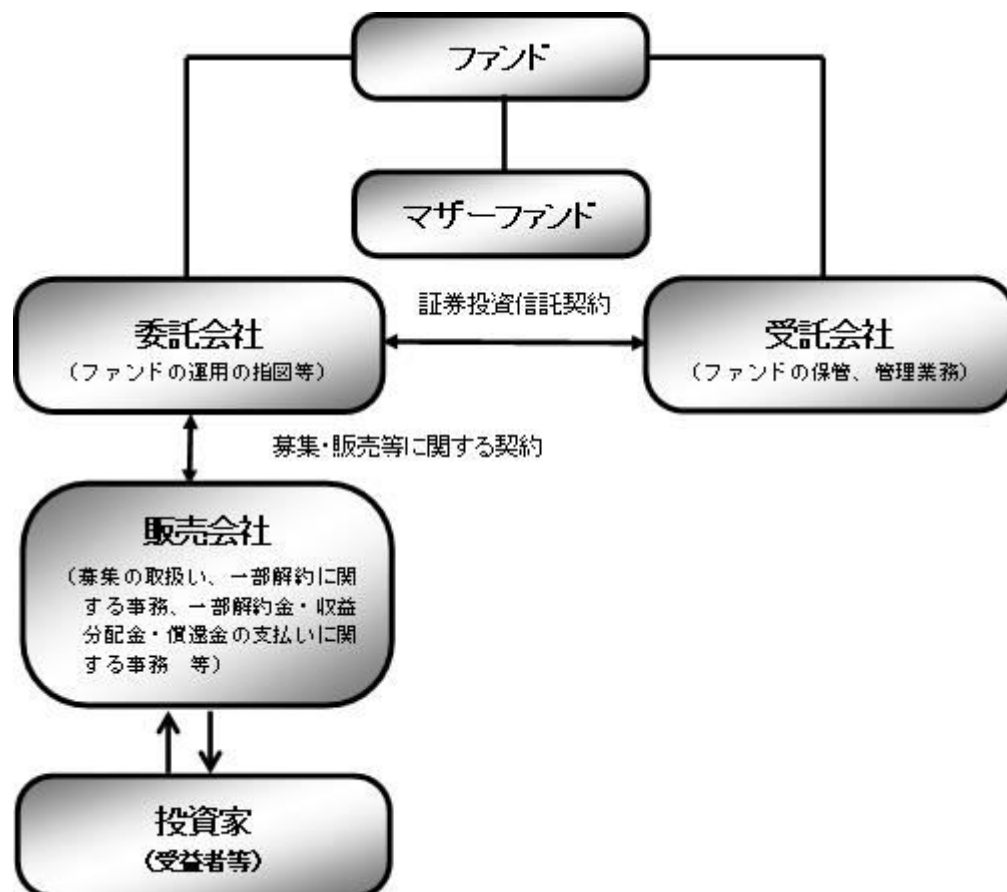
〔特殊型〕

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

（２）【ファンドの沿革】

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

（３）【ファンドの仕組み】



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

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



■ 委託会社の概況(2021年7月末現在) ■

・ 名称

野村アセットマネジメント株式会社

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月 1 日

野村證券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月 1 日

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

2000年11月 1 日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

- 投資を行なうマザーファンドは、原則として、金融指標の動きに連動する投資成果を目指すものとします。

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

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

当初設定時に投資するマザーファンドは、以下の通りです。各マザーファンドは、各々以下の対象指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

マザーファンド名	主要投資対象	対象指数
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	わが国の公社債	NOMURA-BPI総合
外国債券マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債	JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） ・JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。
国内株式マザーファンド	わが国の株式	東証株価指数（TOPIX）

外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） ・MSCI-KOKUSAI 指数をもとに、委託会社が円換算したもので す。
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR （預託証券） ^{*1} を含 みます。）	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込 み・円換算ベース） ・MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込 み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したもので す。
J-REITインデックス マザーファンド	J-REIT ^{*2}	東証REIT指数（配当込み）
海外REITインデックス マザーファンド	日本を除く世界各国 のREIT ^{*3}	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベー ス） ・S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、ドルベース）を もとに、委託会社が円換算したものです。

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

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

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

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

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

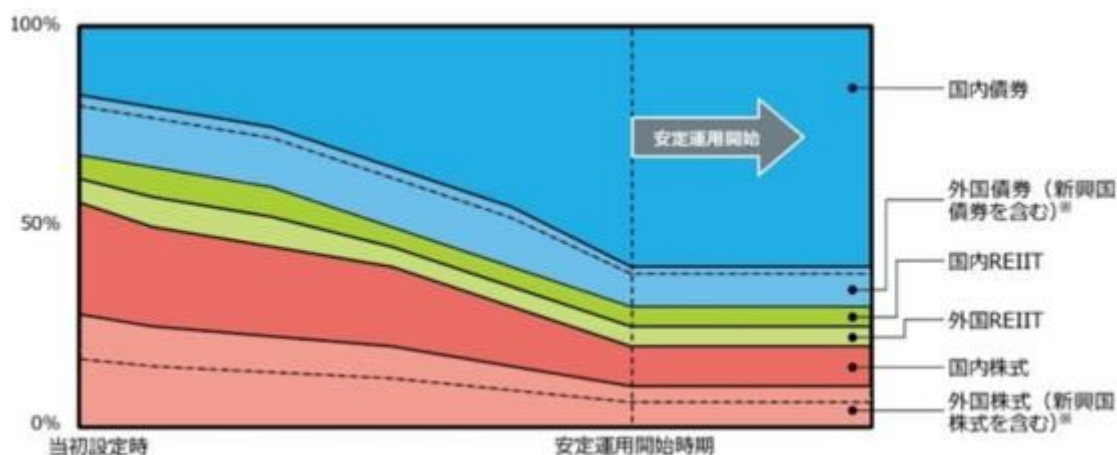
定期的な基本投資割合の変更は、家計や市場の構造変化等を考慮し、原則年1回行なうことを基本とします。

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

■ 基本投資割合 ■

		当初設定時	安定運用 開始時期以降	2021年9月 現在
国内債券	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	17.0%	60%	21.0%
外国債券	外国債券マザーファンド	12.3%	10%	9.7%
	新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	2.7%		5.3%
国内株式	国内株式マザーファンド	28.0%	10%	24.5%
外国株式	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	16.8%	10%	14.1%
	新興国株式マザーファンド	11.2%		10.4%
国内REIT	J-REITインデックス マザーファンド	6.0%	5%	7.5%
外国REIT	海外REITインデックス マザーファンド	6.0%	5%	7.5%

■ 基本投資割合のイメージ図 ■



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

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

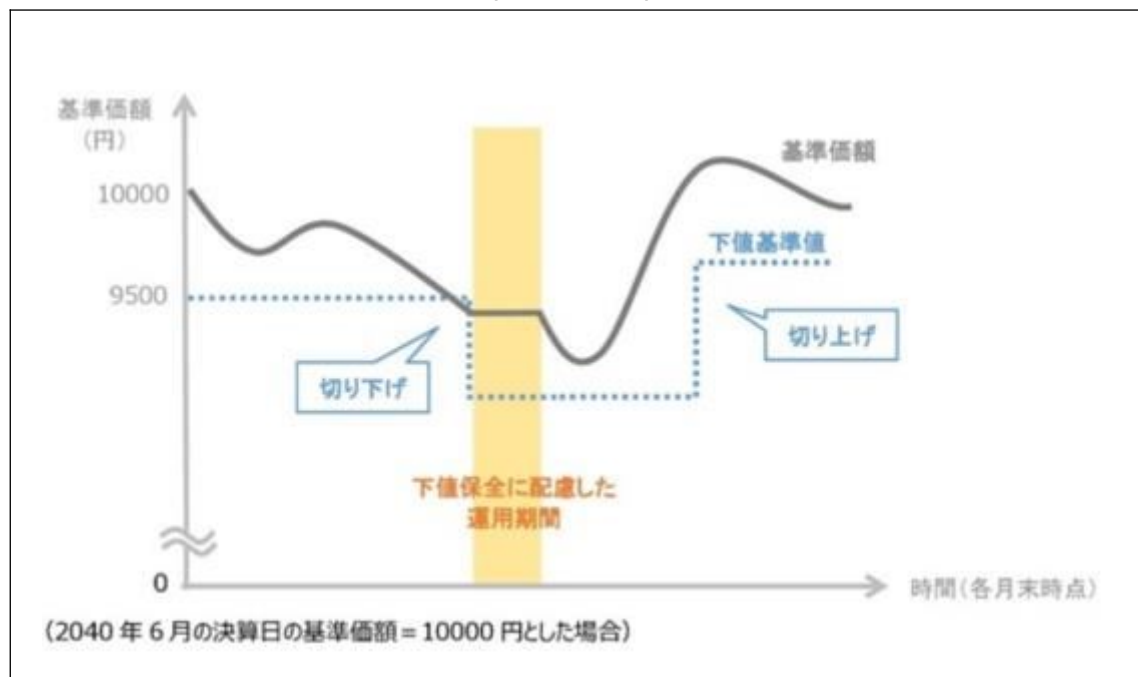
- 安定運用開始時期以降は、各月末時点において、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、マザーファンドを通じて投資する各資産への実質的なエクスポージャーを引き下げ、短期有価証券等へ投資する運用（「下値保全に配慮した運用」といいます。）を行ないます。

各資産への実質的なエクスポージャーをゼロに近づけることを基本とします。

下値保全に配慮した運用を行なうにあたっては、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的で国内外の株価指数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等の売建てを行なう場合があります。

- ・ 委託会社の定める下値基準値は、当初、2040年6月の決算日の基準価額の95%程度とします。毎月末の基準価額を勘案して下値基準値を見直すことを基本とし、原則として、月末の基準価額が下値基準値を下回った場合には切り下げを行ない、月末の基準価額が直近の下値基準値改定時（一度も改定されていない場合は2040年6月の決算日）の基準価額を一定水準上回った場合には切り上げを行ないます。
- ・ 下値保全に配慮した運用に切り替えた場合の、下値保全に配慮した運用を行なう一定期間は、3ヵ月程度を基本とします。なお、当該期間は、市況動向等により見直される場合があります。
- ・ 下値保全に配慮した運用期間終了後は、安定運用期における基本投資割合となるよう、各資産への実質的なエクスポージャーを引き上げます。

■ 基準価額と下値保全に配慮した運用（イメージ図） ■



- 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、2040年6月の決算日の翌日以降、下値保全に配慮した運用を行なう場合においては為替ヘッジを行なう場合があります。

■ 各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について ■

■ NOMURA-BPI総合 ■

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

■ FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース) ■

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

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

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

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

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

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

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

■ 東証株価指数（TOPIX） ■

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

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

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

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

本ファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、本ファンドの基準価額とTOPIXの指

数値の動向が乖離することがあります。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

■東証REIT指数（配当込み）■

東証REIT指数（配当込み）の指数値及び東証REIT指数（配当込み）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、利用など東証R

E I T 指数（配当込み）に関するすべての権利及び東証 R E I T 指数（配当込み）の商標に関するすべての権利は（株）東京証券取引所有します。

（株）東京証券取引所は、東証 R E I T 指数（配当込み）の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証 R E I T 指数（配当込み）の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証 R E I T 指数（配当込み）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、東証 R E I T 指数（配当込み）の商標の使用もしくは東証 R E I T 指数（配当込み）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、東証 R E I T 指数（配当込み）の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また（株）東京証券取引所は、東証 R E I T 指数（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

本ファンドは、東証 R E I T 指数（配当込み）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東証 R E I T 指数（配当込み）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、東証 R E I T 指数（配当込み）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。

■ S&P先進国REIT指数 ■

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

別に定めるマザーファンドを主要投資対象とし、実質的に国内および外国（新興国を含む）の各債券、国内および外国（新興国を含む）の各株式、国内および外国の各不動産投資信託証券（REIT）に投資を行ない

ます。なお、短期有価証券等に直接投資する場合があります。また、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等を取引対象とします。

■各マザーファンドの主要投資対象■

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

投資の対象とする資産の種類（信託約款）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、下記「（５）投資制限」、及び「（６）投資制限」に定めるものに限り、）に係る権利

ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

- 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

ロ．次に掲げるものをすべてみたす資産

- ・リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティー・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するもの
- ・流動性に考慮し、時価の取得が可能なもの
- ・前号または本号イに掲げるものに該当しないもの

有価証券の指図範囲等（信託約款）

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

- 株券または新株引受権証券
- 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
- 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債券のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債券についての社債券であって当該社債券と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債券を総称して以下「転換社債型新株予約

権付社債」といいます。）

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

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

金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記 に掲げるものを除く。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

7. 日本の会社に類似した性質を有しない外国の者が発行する債務証券または証書（上記 に定める証券または証書を除きます。）

8. 流動性のあるプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの（上記 第13号に定める証券または証書を除きます。なお、上記 第13号に定める証券または証書を含め、「優先証券」といいます。）

9. リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティ・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するものであって、流動性のある前各号および上記 各号以外のもの

10. 流動性のある外国の者に対する貸付債権

その他の投資対象

1. 先物取引等

2. スワップ取引

3. 金利先渡取引

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

4. 為替先渡取引

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

5. 直物為替先渡取引

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

(参考)各マザーファンドの概要

（国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

（外国債券マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

２．運用方法

（１）投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

（新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針

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

２．運用方法

（１）投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、現地通貨建て以外の通貨建

ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

（国内株式マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総

額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

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

（外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

（新興国株式マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

新興国の株式（DR（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エク

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

（J - REITインデックス マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

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

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

(2) 投資態度

J - REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への直接投資は行ないません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

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

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

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

（海外REITインデックス マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

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

2．運用方法

(1) 投資対象

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

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

(2) 投資態度

REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

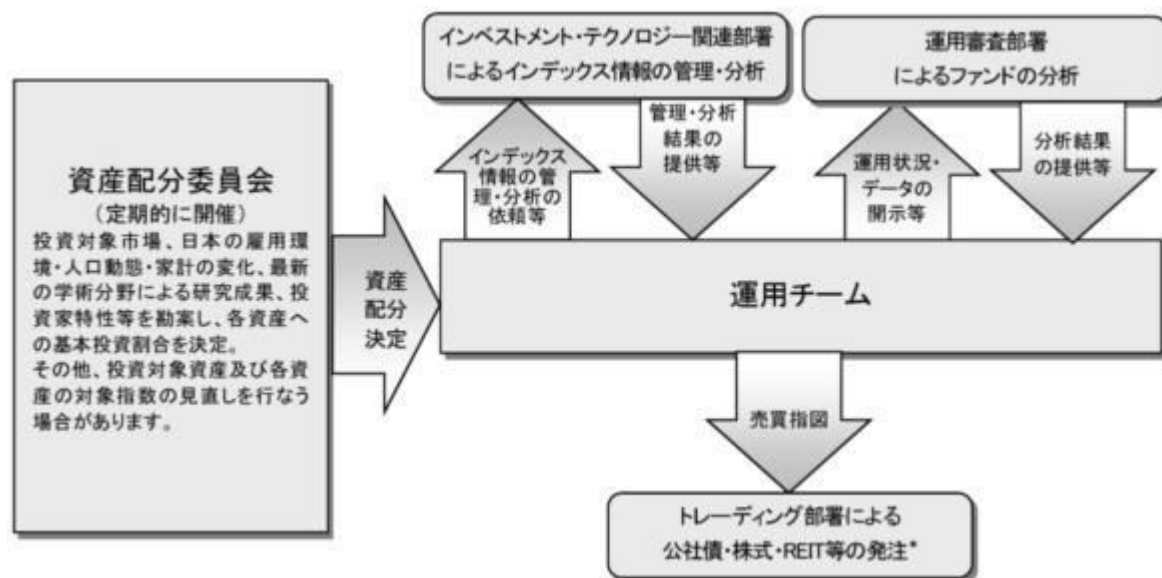
同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超えるREITがある場合には、当該REITをS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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

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

（３）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。

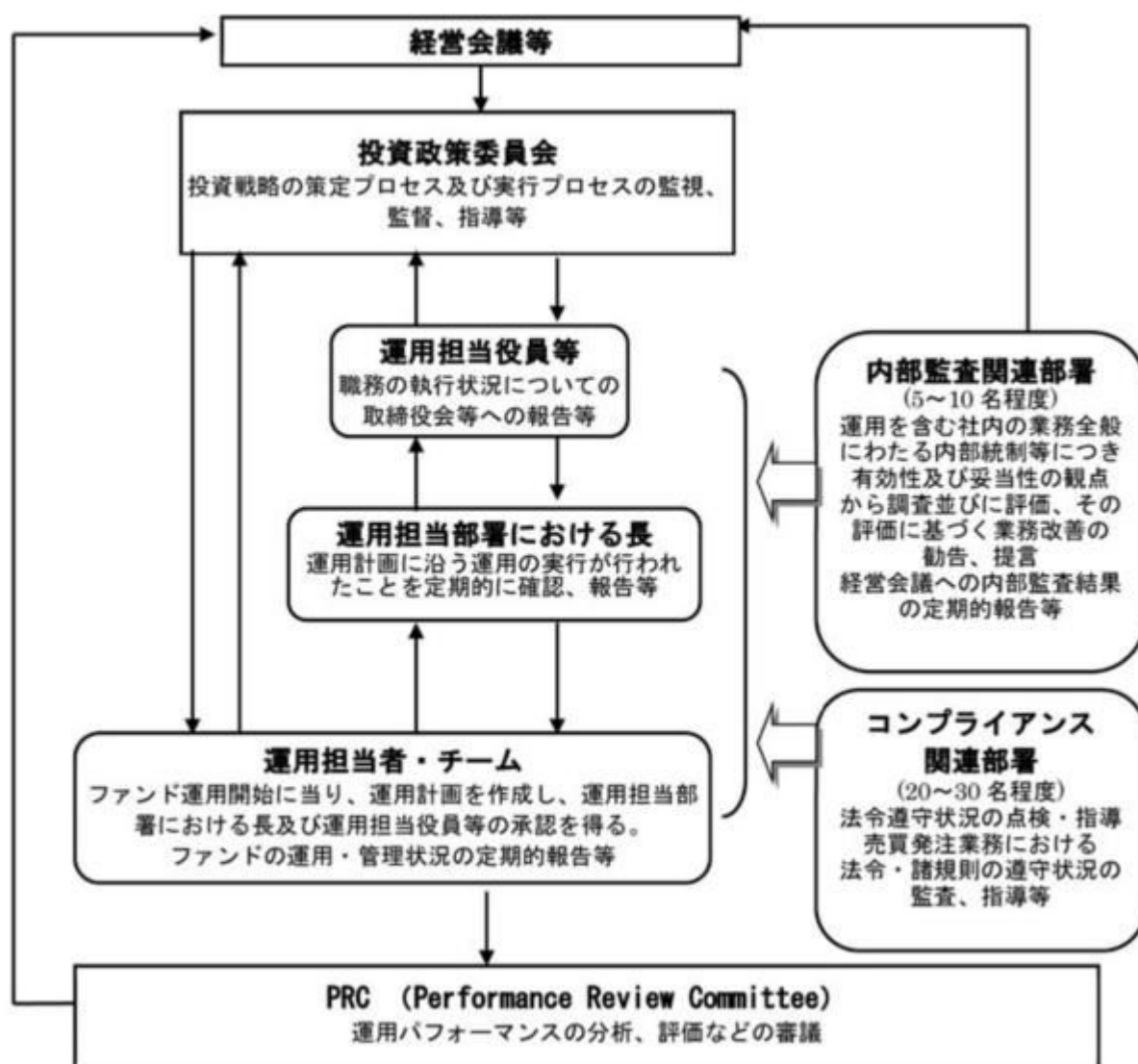


* 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおける公社債等の発注業務（発注に伴う裁量権は付与しないものとします。）の一部をノムラ・アセット・マネジメントU.K. リミテッドに代行させます。

運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

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

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

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

います。

* 委託会社の判断により分配を行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6月22日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

(5) 【投資制限】

運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限 (信託約款)

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

投資する株式等の範囲(信託約款)

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

信用取引の指図範囲(信託約款)

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

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

6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号のものを除きます。）の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図(信託約款)

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

スワップ取引の運用指図(信託約款)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

- () 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有

する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

- () 上記()に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- () 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

公社債の借入れ(信託約款)

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

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

直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

資金の借入れ(信託約款)

- () 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目

的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

（ ）一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

（ ）収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

（ ）借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

（ ）委託者が運用の指図を行なうすべてのファンドで保有する当該株式に係る議決権の総数

（ ）当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

3【投資リスク】

基準価額の変動要因

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

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

[株価変動リスク]

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

[REITの価格変動リスク]

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

[債券価格変動リスク]

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

[為替変動リスク]

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

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

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

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

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

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

ファンドの基準価額とファンドのベンチマークである合成指数は、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。また、ファンドの投資成果が合成指数に連動または上回ることを保証するものではありません。なお、下値保全に配慮した運用期間中は、ファンドの基準価額は合成指数に連動しません。投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

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

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

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

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

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

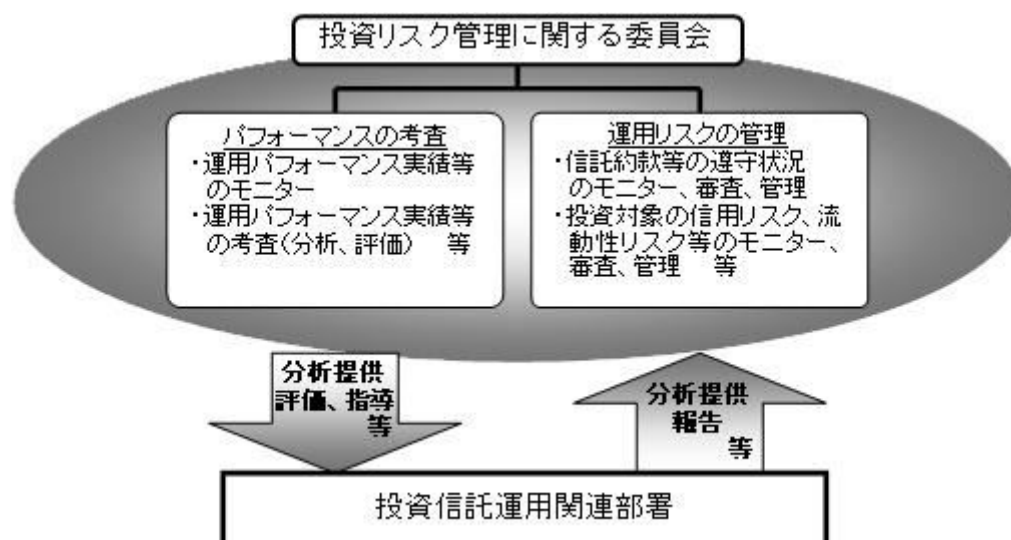
パフォーマンスの考査

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

運用リスクの管理

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

リスク管理体制図



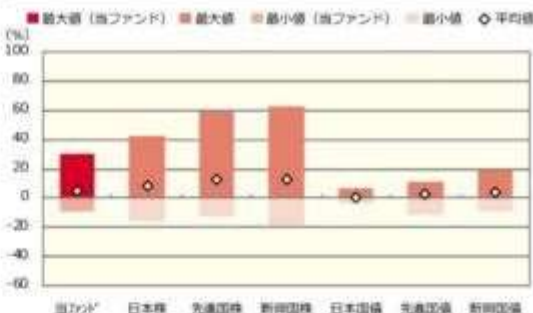
投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

■ リスクの定量的比較（2016年8月末～2021年7月末：月次）

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	30.0	42.1	59.8	62.7	6.5	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 8.7	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 11.4	△ 9.4
平均値 (%)	4.8	8.3	13.0	12.3	0.5	2.3	3.5

※ 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を 10,000 として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。

※ 年間騰落率は、2018 年 8 月から 2021 年 7 月の各月末における 1 年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

※ 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※ 2016 年 8 月から 2021 年 7 月の 5 年間（当ファンドは 2018 年 8 月から 2021 年 7 月）の各月末における 1 年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

※ 決算日に対応した数値とは異なります。

※ 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

※ 当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

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

<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・ディバースファイド（円ベース）

■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所に帰属しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
 - MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）と MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を中止する権利を有しています。
 - NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
 - FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
 - JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や損益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、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持っており、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または買主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての提供、保証または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
- JPMSLLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPST, J.P. Morgan Securities PLC., またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4 【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

申込手数料はありません。

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

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

信託報酬率の配分については、次の通り(税抜)とします。

計算期間	1期～23期 (設定日～2040年決算日)	24期以降 (2040年決算日翌日以降)
信託報酬率	年0.462% (税抜年0.42%)	年0.418% (税抜年0.38%)
委託会社	年0.19%	年0.17%
販売会社	年0.19%	年0.17%
受託会社	年0.04%	年0.04%

支払先の役務の内容

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

■個人、法人別の課税について■

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

なお、配当控除は適用されません。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

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

損益通算について

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

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 ^(注2)	《配当所得》
・特定公社債^(注1)の利子 ・公募公社債投資信託の収益分配金	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の ・譲渡益 ・譲渡損	・上場株式の配当 ・公募株式投資信託の収益分配金

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

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

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

法人の投資家に対する課税

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

なお、上記以外の受益者(法人)の場合の課税の取扱いは下記の通りです。

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

■ 換金（解約）時および償還時の課税について ■

〔個人の投資家の場合〕

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

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

〔法人の投資家の場合〕

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

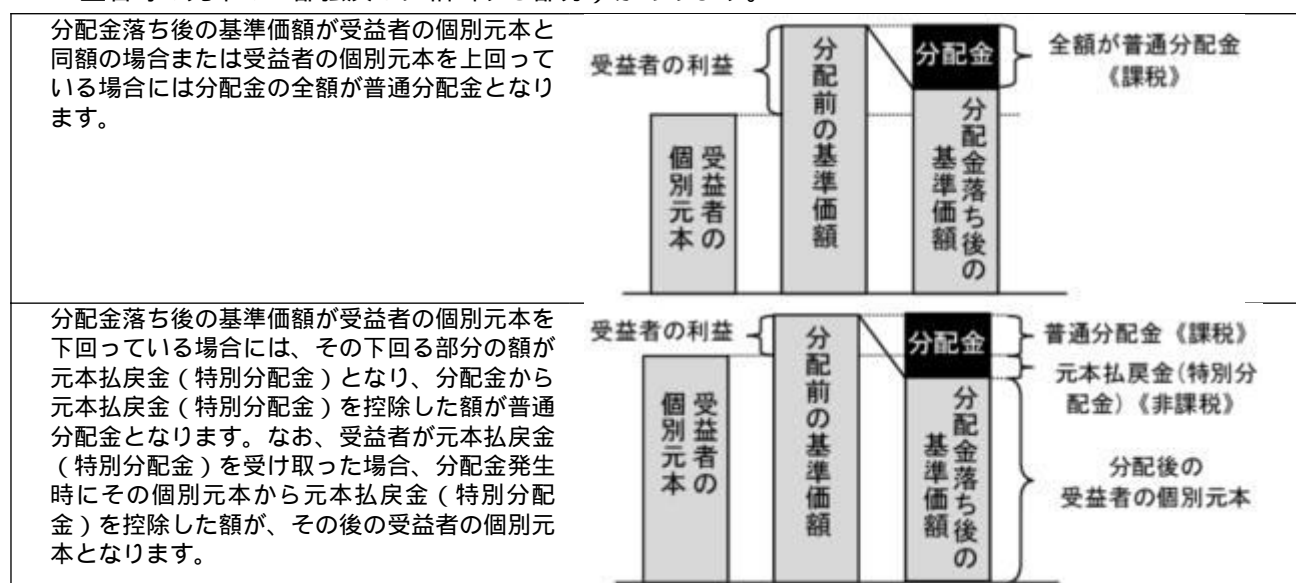
■ 個別元本について ■

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

■ 分配金の課税について ■

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



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

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

* 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容(2021年7月末現在)が変更になる場合があります。

5 【運用状況】

以下は2021年7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】

野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	149,285,349	99.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	150,568	0.10
合計（純資産総額）		149,435,917	100.00

（参考）国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	627,594,400,700	79.44
地方債証券	日本	52,880,412,912	6.69
特殊債券	日本	64,855,811,991	8.20
社債券	日本	33,654,822,950	4.26
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	10,998,210,832	1.39
合計（純資産総額）		789,983,659,385	100.00

（参考）外国債券マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	270,840,916,026	44.83
	カナダ	11,711,021,023	1.93
	メキシコ	4,259,602,751	0.70
	ドイツ	40,745,267,766	6.74
	イタリア	59,923,280,944	9.91
	フランス	58,527,334,023	9.68
	オランダ	10,148,483,838	1.67
	スペイン	38,377,042,853	6.35
	ベルギー	14,144,349,031	2.34
	オーストリア	8,693,786,093	1.43
	フィンランド	2,688,278,310	0.44
	アイルランド	8,125,542,620	1.34
	イギリス	39,576,449,940	6.55
	スウェーデン	1,759,202,577	0.29
	ノルウェー	1,438,627,006	0.23
	デンマーク	2,931,482,511	0.48
	ポーランド	3,647,336,318	0.60

	オーストラリア	12,226,572,273	2.02
	シンガポール	2,574,469,390	0.42
	マレーシア	2,764,345,966	0.45
	イスラエル	2,708,162,653	0.44
	小計	597,811,553,912	98.95
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	6,324,848,253	1.04
合計（純資産総額）		604,136,402,165	100.00

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	メキシコ	854,456,316	8.89
	ブラジル	796,081,807	8.29
	チリ	193,113,004	2.01
	コロンビア	413,011,543	4.30
	ペルー	191,302,292	1.99
	ウルグアイ	10,428,959	0.10
	ドミニカ共和国	17,498,891	0.18
	トルコ	180,754,533	1.88
	チェコ	385,656,568	4.01
	ハンガリー	360,133,772	3.75
	ポーランド	811,251,237	8.44
	ロシア	701,765,212	7.30
	ルーマニア	296,937,027	3.09
	マレーシア	704,527,686	7.33
	タイ	812,108,654	8.45
	フィリピン	25,739,378	0.26
	インドネシア	915,703,870	9.53
	南アフリカ	726,705,358	7.56
	中国	943,963,089	9.83
	小計	9,341,139,196	97.27
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	261,251,052	2.72
合計（純資産総額）		9,602,390,248	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	383,517,432,790	98.38
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	6,299,796,344	1.61
合計（純資産総額）		389,817,229,134	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	6,286,500,000	1.61

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	743,430,065,675	69.66
	カナダ	36,659,396,831	3.43
	ドイツ	30,614,582,120	2.86
	イタリア	7,927,615,011	0.74
	フランス	36,496,329,080	3.42
	オランダ	15,354,949,997	1.43
	スペイン	7,857,128,396	0.73
	ベルギー	2,780,778,967	0.26
	オーストリア	649,097,972	0.06
	ルクセンブルグ	532,740,210	0.04
	フィンランド	3,625,056,251	0.33
	アイルランド	2,331,209,364	0.21
	ポルトガル	603,271,019	0.05
	イギリス	47,090,791,546	4.41
	スイス	32,539,003,048	3.04
	スウェーデン	12,765,284,608	1.19
	ノルウェー	2,011,417,970	0.18
	デンマーク	8,700,199,246	0.81
	オーストラリア	21,614,908,060	2.02
	ニュージーランド	766,038,328	0.07
	香港	9,230,594,631	0.86
	シンガポール	2,978,746,979	0.27
	イスラエル	1,119,329,998	0.10
	小計	1,027,678,535,307	96.30
投資証券	アメリカ	20,506,887,067	1.92
	カナダ	123,961,125	0.01
	フランス	517,800,848	0.04
	イギリス	626,795,360	0.05
	オーストラリア	1,470,621,035	0.13
	香港	443,181,224	0.04
	シンガポール	440,379,676	0.04
	小計	24,129,626,335	2.26

現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	15,299,587,050	1.43
合計（純資産総額）		1,067,107,748,692	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,061,673,406	1.03
	買建	カナダ	533,144,876	0.04
	買建	ドイツ	1,583,829,022	0.14
	買建	イギリス	685,098,048	0.06
	買建	スイス	466,384,320	0.04
	買建	オーストラリア	340,851,174	0.03

（参考）新興国株式マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	6,464,182,330	9.48
	メキシコ	1,232,191,961	1.80
	ブラジル	3,583,257,801	5.25
	チリ	113,464,064	0.16
	コロンビア	40,509,987	0.05
	ギリシャ	116,314,708	0.17
	イギリス	66,142,788	0.09
	トルコ	168,405,157	0.24
	チェコ	68,060,069	0.09
	ハンガリー	155,945,729	0.22
	ポーランド	492,298,513	0.72
	香港	16,102,616,363	23.62
	マレーシア	828,471,054	1.21
	タイ	1,045,556,262	1.53
	フィリピン	389,086,752	0.57
	インドネシア	765,800,035	1.12
	韓国	8,868,710,471	13.00
	台湾	9,528,521,291	13.97
	インド	6,925,083,234	10.15
	パキスタン	12,348,030	0.01
	カタール	442,074,218	0.64
	エジプト	45,463,136	0.06
	南アフリカ	2,410,313,256	3.53
	アラブ首長国連邦	487,235,865	0.71

	クウェート	360,718,439	0.52
	サウジアラビア	2,008,738,935	2.94
	小計	62,721,510,448	92.00
新株予約権証券	タイ	0	0.00
投資信託受益証券	アメリカ	2,854,869,741	4.18
投資証券	メキシコ	27,748,107	0.04
	南アフリカ	33,186,690	0.04
	小計	60,934,797	0.08
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	2,532,511,733	3.71
合計（純資産総額）		68,169,826,719	100.00

その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,217,844,748	3.25
	買建	シンガポール	236,681,352	0.34

（参考）Ｊ－ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	45,098,293,550	96.95
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,416,032,210	3.04
合計（純資産総額）		46,514,325,760	100.00

その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
REIT指数先物取引	買建	日本	1,366,446,000	2.93

（参考）海外ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	31,828,649,573	74.37
	カナダ	825,021,740	1.92
	ドイツ	126,577,878	0.29

	イタリア	7,486,529	0.01
	フランス	956,293,017	2.23
	オランダ	80,497,361	0.18
	スペイン	185,546,228	0.43
	ベルギー	593,219,109	1.38
	アイルランド	49,389,756	0.11
	シンガポール	23,326,121	0.05
	イギリス	2,460,994,992	5.75
	オーストラリア	2,776,059,144	6.48
	ニュージーランド	173,674,870	0.40
	香港	672,469,203	1.57
	シンガポール	1,432,846,283	3.34
	韓国	72,090,715	0.16
	イスラエル	26,929,097	0.06
	小計	42,291,071,616	98.82
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	502,301,714	1.17
合計（純資産総額）		42,793,373,330	100.00

その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	462,577,729	1.08

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	18,096,135	2.0469	37,042,223	1.9901	36,013,118	24.09
2	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA - BPI 総合 マザーファンド	23,748,047	1.3295	31,573,073	1.3352	31,708,392	21.21
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド	5,148,848	4.0537	20,872,166	4.1737	21,489,746	14.38
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	5,735,295	2.5359	14,544,218	2.5582	14,672,031	9.81
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	9,090,456	1.6835	15,304,107	1.6097	14,632,907	9.79
6	日本	親投資信託 受益証券	海外REITインデックス マ ザーファンド	3,942,633	2.8841	11,371,266	2.9318	11,559,011	7.73
7	日本	親投資信託 受益証券	J - REITインデックス マ ザーファンド	3,987,866	2.8119	11,213,735	2.8468	11,352,656	7.59

8	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券（現地通貨建て）マ ザーファンド	5,567,554	1.4219	7,916,793	1.4113	7,857,488	5.25
---	----	---------------	--------------------------	-----------	--------	-----------	--------	-----------	------

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.89
合 計	99.89

（参考）国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （%）	償還期限	投資 比率 （%）
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 62回	11,400,000,000	100.27	11,430,955,000	100.96	11,509,782,000	0.1	2031/3/20	1.45
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 43回	9,500,000,000	100.97	9,592,534,000	101.13	9,607,350,000	0.1	2026/6/20	1.21
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 51回	9,400,000,000	100.90	9,484,600,000	101.56	9,546,734,000	0.1	2028/6/20	1.20
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 42回	8,550,000,000	100.93	8,630,016,000	101.07	8,641,570,500	0.1	2026/3/20	1.09
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 （5年）第13 5回	8,500,000,000	100.46	8,539,355,000	100.38	8,532,555,000	0.1	2023/3/20	1.08
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 61回	8,400,000,000	100.07	8,405,910,000	101.08	8,490,720,000	0.1	2030/12/20	1.07
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 60回	7,900,000,000	100.18	7,914,852,000	101.19	7,994,010,000	0.1	2030/9/20	1.01
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 41回	7,300,000,000	101.89	7,438,481,000	101.91	7,440,014,000	0.3	2025/12/20	0.94
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 （20年）第1 57回	7,040,000,000	98.57	6,939,328,000	100.00	7,040,000,000	0.2	2036/6/20	0.89
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 （20年）第1 76回	6,620,000,000	101.02	6,688,165,300	102.19	6,765,110,400	0.5	2041/3/20	0.85
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 34回	6,600,000,000	102.37	6,756,816,000	102.14	6,741,306,000	0.6	2024/6/20	0.85
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 52回	6,600,000,000	100.82	6,654,252,000	101.58	6,704,478,000	0.1	2028/9/20	0.84
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 （40年）第1 3回	7,170,000,000	93.56	6,708,794,500	93.06	6,673,047,300	0.5	2060/3/20	0.84
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 50回	6,550,000,000	100.93	6,611,118,000	101.50	6,648,512,000	0.1	2028/3/20	0.84
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 （5年）第14 0回	6,600,000,000	100.75	6,649,570,000	100.69	6,645,804,000	0.1	2024/6/20	0.84
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 44回	6,500,000,000	100.98	6,563,970,000	101.18	6,577,220,000	0.1	2026/9/20	0.83

17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 1 5 6 回	6,150,000,000	101.40	6,236,170,500	102.98	6,333,823,500	0.4	2036/3/20	0.80
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 3 3 回	6,200,000,000	100.33	6,220,522,000	100.26	6,216,182,000	0.1	2022/9/20	0.78
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 4 3 回	6,070,000,000	100.87	6,123,123,200	100.89	6,124,265,800	0.1	2025/3/20	0.77
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 2 9 回	6,000,000,000	102.08	6,124,860,000	101.74	6,104,700,000	0.8	2023/6/20	0.77
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 3 2 回	5,900,000,000	102.02	6,019,180,000	101.74	6,002,955,000	0.6	2023/12/20	0.75
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 1 5 5 回	5,350,000,000	110.10	5,890,403,500	111.57	5,969,262,500	1	2035/12/20	0.75
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 8 回	5,800,000,000	100.94	5,854,520,000	101.42	5,882,476,000	0.1	2027/9/20	0.74
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 5 9 回	5,600,000,000	100.32	5,617,920,000	101.29	5,672,408,000	0.1	2030/6/20	0.71
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 1 7 5 回	5,500,000,000	100.42	5,523,385,000	102.35	5,629,305,000	0.5	2040/12/20	0.71
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 5 8 回	5,470,000,000	100.40	5,491,934,700	101.38	5,545,923,600	0.1	2030/3/20	0.70
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 3 8 回	5,500,000,000	100.66	5,536,795,000	100.57	5,531,515,000	0.1	2023/12/20	0.70
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 7 回	5,400,000,000	100.96	5,452,218,000	101.36	5,473,602,000	0.1	2027/6/20	0.69
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 4 5 回	5,400,000,000	100.94	5,451,257,000	100.99	5,453,838,000	0.1	2025/9/20	0.69
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 2 8 回	5,250,000,000	101.43	5,325,547,500	101.19	5,312,580,000	0.6	2023/3/20	0.67

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	79.44
地方債証券	6.69
特殊債券	8.20
社債券	4.26
合 計	98.60

（参考）外国債券マザーファンド

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	97,400,000	14,814.21	14,429,041,448	15,077.96	14,685,942,512	5.375	2031/2/15	2.43
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	65,000,000	13,668.20	8,884,335,949	13,577.61	8,825,449,825	6	2026/2/15	1.46

3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	66,000,000	11,222.07	7,406,572,249	11,182.09	7,380,181,552	1.5	2023/2/28	1.22
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	49,600,000	14,199.64	7,043,022,815	14,303.84	7,094,705,377	5.5	2028/8/15	1.17
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	55,600,000	12,165.91	6,764,250,064	12,306.50	6,842,416,280	2.875	2028/5/15	1.13
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	48,000,000	14,071.17	6,754,164,112	14,201.19	6,816,573,412	5.25	2028/11/15	1.12
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,500,000	11,462.66	5,903,270,614	12,222.67	6,294,678,329	2.5	2046/2/15	1.04
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	53,100,000	11,255.96	5,976,919,960	11,212.46	5,953,816,426	1.75	2023/1/31	0.98
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,600,000	11,726.54	5,933,634,201	11,711.58	5,926,059,648	2.25	2025/11/15	0.98
10	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	28,200,000	20,370.41	5,744,456,424	20,753.84	5,852,584,600	5.75	2032/7/30	0.96
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,500,000	11,663.82	5,656,954,242	11,618.34	5,634,896,368	2.5	2024/5/15	0.93
12	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000	17,849.79	5,337,087,479	18,197.18	5,440,958,195	5.25	2029/11/1	0.90
13	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	25,550,000	20,118.95	5,140,391,964	21,076.88	5,385,143,660	3.25	2045/5/25	0.89
14	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,800,000	15,585.22	5,267,806,507	15,589.12	5,269,125,822	3.5	2026/4/25	0.87
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	11,667.95	5,262,247,766	11,614.06	5,237,943,429	2.375	2024/8/15	0.86
16	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	18,884.59	5,098,840,586	19,042.04	5,141,351,036	5.5	2029/4/25	0.85
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,300,000	11,782.17	4,983,859,527	11,811.23	4,996,151,877	2.375	2026/4/30	0.82
18	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	22,200,000	21,215.70	4,709,887,459	22,247.70	4,938,989,532	3.25	2044/1/22	0.81
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,000,000	11,528.52	4,957,266,262	11,474.63	4,934,094,083	2.25	2023/12/31	0.81
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,644.43	4,960,528,161	11,579.84	4,933,015,941	2.75	2023/11/15	0.81
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,700,000	11,593.10	4,950,257,486	11,547.77	4,930,899,258	2.125	2024/9/30	0.81
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,900,000	11,476.34	4,579,062,707	12,196.15	4,866,267,435	2.5	2045/2/15	0.80
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,500,000	11,197.75	4,871,022,739	11,162.41	4,855,652,266	1.875	2022/8/31	0.80
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,454.91	4,832,506,831	12,305.22	4,774,425,701	6.25	2023/8/15	0.79
25	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	21,800,000	20,850.38	4,545,384,992	21,358.31	4,656,111,828	4.75	2035/4/25	0.77
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,100,000	12,506.23	4,389,689,519	13,251.71	4,651,350,758	3	2044/11/15	0.76
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,000,000	11,817.22	4,490,543,852	11,902.33	4,522,886,432	2.375	2027/5/15	0.74
28	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,400,000	21,271.08	4,339,301,421	21,633.98	4,413,333,594	5.75	2032/10/25	0.73
29	イギリス	国債証券	UK TREASURY	18,440,000	22,196.63	4,093,060,240	23,308.11	4,298,015,785	3.5	2045/1/22	0.71
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,100,000	11,572.57	4,293,426,991	11,511.84	4,270,895,045	2.75	2023/7/31	0.70

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.95
合 計	98.95

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
1	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	8,700,000	3,080.88	268,037,395	3,123.01	271,702,352	2.75	2028/4/25	2.82
2	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	14,000,000	1,809.14	253,280,953	1,813.58	253,902,134	3.6	2030/5/21	2.64
3	ブラジル	国債証券	LETRA TESOIRO NACIONAL	13,100,000	1,799.81	235,775,682	1,735.16	227,306,888	—	2024/1/1	2.36
4	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	6,500,000	2,980.60	193,739,399	2,943.38	191,319,914	2.5	2023/1/25	1.99
5	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000	1,768.89	176,889,768	1,780.46	178,046,537	3.48	2027/6/29	1.85
6	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,500,000	1,661.74	174,483,718	1,675.25	175,901,282	2.2	2025/7/27	1.83
7	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	6,100,000	2,832.38	172,775,786	2,852.59	174,008,596	0.75	2025/4/25	1.81
8	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	21,100,000	715.92	151,059,715	713.00	150,443,428	8	2030/1/31	1.56
9	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	8,000,000	1,846.87	147,749,864	1,852.99	148,239,453	4.15	2027/12/4	1.54
10	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOIRO NACIONAL	610,000	2,361.28	144,048,968	2,234.79	136,322,246	10	2023/1/1	1.41
11	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	23,900,000	554.16	132,446,230	535.81	128,060,697	5.75	2026/3/5	1.33
12	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,900,000	874.32	130,274,081	854.82	127,368,556	10.5	2026/12/21	1.32
13	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOIRO NACIONAL	481,000	2,434.75	117,121,164	2,266.97	109,041,276	10	2025/1/1	1.13
14	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	18,700,000	609.85	114,043,207	578.99	108,272,023	8	2024/9/5	1.12
15	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,600,000	2,740.40	98,654,630	2,716.15	97,781,670	3.885	2029/8/15	1.01
16	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,200,000	3,040.94	97,310,111	2,992.22	95,751,169	2.25	2024/10/25	0.99
17	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,550,000	624.95	97,181,132	573.81	89,228,229	7.5	2027/6/3	0.92
18	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	11,100,000,000	0.79	88,574,626	0.79	88,746,720	7	2030/9/15	0.92
19	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,100,000	657.72	92,738,580	613.46	86,499,249	10	2024/12/5	0.90
20	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	16,600,000	503.99	83,662,653	494.54	82,095,142	1	2026/6/26	0.85
21	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,900,000	342.03	81,745,805	342.42	81,838,508	1.45	2024/12/17	0.85
22	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000	2,760.31	80,049,129	2,705.08	78,447,510	3.733	2028/6/15	0.81
23	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	47,700,000	162.40	77,467,828	157.28	75,024,175	7.95	2026/10/7	0.78
24	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,210,000,000	3.68	81,542,988	3.39	74,969,087	9.85	2027/6/28	0.78
25	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000	623.59	73,584,629	630.81	74,436,142	8.75	2044/1/31	0.77

26	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	8,800,000,000	0.82	73,014,903	0.83	73,314,525	8.125	2024/5/15	0.76
27	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000	2,480.64	79,386,186	2,276.92	72,861,589	10	2027/1/1	0.75
28	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,500,000	624.59	71,828,414	630.00	72,450,847	8.75	2048/2/28	0.75
29	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,200,000	635.72	71,200,808	638.80	71,545,667	8.5	2037/1/31	0.74
30	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000	2,759.83	71,755,761	2,725.68	70,867,809	4.181	2024/7/15	0.73

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.27
合 計	97.27

（参考）国内株式マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,491,300	8,552.53	12,754,398,552	9,805.00	14,622,196,500	3.75
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	922,200	10,782.89	9,943,984,771	11,375.00	10,490,025,000	2.69
3	日本	株式	キーエンス	電気機器	144,500	53,563.89	7,739,982,227	60,740.00	8,776,930,000	2.25
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,146,200	10,059.88	11,530,637,036	6,837.00	7,836,569,400	2.01
5	日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	9,932,000	608.26	6,041,271,208	578.50	5,745,662,000	1.47
6	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,007,700	5,269.50	5,310,084,264	5,629.00	5,672,343,300	1.45
7	日本	株式	任天堂	その他製品	84,200	62,326.18	5,247,864,631	56,400.00	4,748,880,000	1.21
8	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,689,600	2,856.05	4,825,595,955	2,802.50	4,735,104,000	1.21
9	日本	株式	信越化学工業	化学	266,600	18,571.44	4,951,147,749	17,750.00	4,732,150,000	1.21
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,224,800	3,729.50	4,567,902,891	3,682.00	4,509,713,600	1.15
11	日本	株式	日立製作所	電気機器	707,800	5,415.10	3,832,810,899	6,258.00	4,429,412,400	1.13
12	日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	287,200	13,218.66	3,796,401,437	15,405.00	4,424,316,000	1.13
13	日本	株式	日本電産	電気機器	354,300	12,491.73	4,425,823,058	12,240.00	4,336,632,000	1.11
14	日本	株式	ダイキン工業	機械	187,600	23,027.94	4,320,042,340	22,665.00	4,251,954,000	1.09
15	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,159,100	3,433.16	3,979,387,241	3,493.00	4,048,736,300	1.03
16	日本	株式	村田製作所	電気機器	432,400	8,688.78	3,757,031,892	9,040.00	3,908,896,000	1.00
17	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	86,200	49,899.44	4,301,332,405	44,920.00	3,872,104,000	0.99
18	日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,158,400	3,447.50	3,993,587,876	3,332.00	3,859,788,800	0.99
19	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,004,800	3,967.35	3,986,401,726	3,695.00	3,712,736,000	0.95
20	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,014,100	3,550.50	3,600,569,921	3,232.00	3,277,571,200	0.84
21	日本	株式	ファナック	電気機器	129,200	26,541.20	3,429,123,339	24,380.00	3,149,896,000	0.80
22	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,972,900	1,623.59	3,203,182,486	1,565.50	3,088,574,950	0.79
23	日本	株式	三井物産	卸売業	1,156,600	2,537.32	2,934,668,716	2,499.50	2,890,921,700	0.74

24	日本	株式	S M C	機械	43,100	65,230.42	2,811,431,486	64,800.00	2,792,880,000	0.71
25	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	567,200	4,717.13	2,675,556,285	4,868.00	2,761,129,600	0.70
26	日本	株式	三菱商事	卸売業	882,700	3,012.11	2,658,792,733	3,062.00	2,702,827,400	0.69
27	日本	株式	第一三共	医薬品	1,156,800	2,900.02	3,354,746,859	2,159.50	2,498,109,600	0.64
28	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	478,200	5,463.74	2,612,763,772	5,210.00	2,491,422,000	0.63
29	日本	株式	富士通	電気機器	132,500	16,879.90	2,236,586,828	18,565.00	2,459,862,500	0.63
30	日本	株式	デンソー	輸送用機器	324,100	7,284.51	2,360,911,034	7,482.00	2,424,916,200	0.62

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.18
		建設業	2.31
		食料品	3.32
		繊維製品	0.49
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.00
		医薬品	4.97
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.75
		鉄鋼	0.79
		非鉄金属	0.71
		金属製品	0.61
		機械	5.42
		電気機器	18.17
		輸送用機器	7.96
		精密機器	2.75
		その他製品	2.26
		電気・ガス業	1.18
		陸運業	3.22
		海運業	0.35
		空運業	0.44
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	8.37
		卸売業	4.80
		小売業	4.50
		銀行業	4.84
		証券、商品先物取引業	0.73
		保険業	1.86
		その他金融業	1.10

		有価証券	
		不動産業	1.95
		サービス業	5.58
合 計			98.38

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	2,915,900	13,189.04	38,457,937,455	15,946.12	46,497,301,805	4.35
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	1,244,500	25,528.95	31,770,784,573	31,368.88	39,038,577,382	3.65
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	74,340	336,043.13	24,981,446,285	394,155.24	29,301,500,601	2.74
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	417,800	31,742.89	13,262,183,486	39,232.45	16,391,320,451	1.53
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	52,230	225,834.36	11,795,328,822	297,325.56	15,529,314,495	1.45
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	51,200	227,150.94	11,630,128,485	298,996.38	15,308,615,009	1.43
7	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	133,370	69,580.63	9,279,969,139	74,163.05	9,891,126,179	0.92
8	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	430,040	14,281.26	6,141,513,289	21,527.92	9,257,868,351	0.86
9	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	530,000	16,930.89	8,973,372,961	16,751.97	8,878,544,100	0.83
10	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	456,600	18,087.84	8,258,908,739	18,851.98	8,607,817,812	0.80
11	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	294,600	23,310.24	6,867,197,485	27,144.76	7,996,846,532	0.74
12	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	164,800	41,103.37	6,773,836,855	45,118.63	7,435,551,740	0.69
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	238,100	28,408.35	6,764,029,823	30,630.92	7,293,222,623	0.68
14	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	500,400	12,834.81	6,422,540,860	13,740.64	6,875,818,758	0.64
15	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	187,000	33,504.33	6,265,310,657	35,850.31	6,704,008,101	0.62
16	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	154,000	39,284.46	6,049,807,694	42,570.80	6,555,904,263	0.61
17	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	427,700	14,839.64	6,346,915,637	15,271.66	6,531,691,206	0.61
18	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	315,300	20,286.53	6,396,343,842	19,527.54	6,157,033,835	0.57
19	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	72,860	67,435.60	4,913,358,259	83,621.69	6,092,676,843	0.57
20	アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	情報技術サービス	193,300	26,039.80	5,033,494,687	31,004.28	5,993,127,962	0.56

21	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,350,000	4,279.09	5,776,775,754	4,235.07	5,717,348,820	0.53
22	アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア	83,150	51,273.17	4,263,364,442	68,069.93	5,660,014,929	0.53
23	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	122,000	36,819.97	4,492,036,366	42,007.46	5,124,910,120	0.48
24	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	794,000	6,034.82	4,791,647,621	6,362.46	5,051,796,337	0.47
25	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	735,300	6,232.12	4,582,478,224	6,452.24	4,744,336,263	0.44
26	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	969,000	3,974.86	3,851,640,603	4,685.07	4,539,839,710	0.42
27	アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア	168,740	23,186.32	3,912,460,136	26,719.93	4,508,722,608	0.42
28	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	711,100	5,830.77	4,146,262,246	6,246.40	4,441,818,240	0.41
29	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	733,300	5,678.09	4,163,743,982	6,029.61	4,421,516,166	0.41
30	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	718,800	6,412.31	4,609,170,044	6,129.25	4,405,705,044	0.41

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.91
		メディア	1.08
		娯楽	1.41
		不動産管理・開発	0.41
		エネルギー設備・サービス	0.14
		石油・ガス・消耗燃料	2.91
		化学	2.10
		建設資材	0.26
		容器・包装	0.27
		金属・鉱業	1.60
		紙製品・林産品	0.11
		航空宇宙・防衛	1.46
		建設関連製品	0.64
		建設・土木	0.21
		電気設備	0.88
		コングロマリット	1.13
		機械	1.71
		商社・流通業	0.32
		商業サービス・用品	0.43
		航空貨物・物流サービス	0.67
		旅客航空輸送業	0.05
		海運業	0.07
		陸運・鉄道	1.01
		運送インフラ	0.13
		自動車部品	0.27
		自動車	1.63
		家庭用耐久財	0.37

		レジャー用品	0.07
		繊維・アパレル・贅沢品	1.59
		ホテル・レストラン・レジャー	1.81
		販売	0.09
		インターネット販売・通信販売	3.30
		複合小売り	0.53
		専門小売り	1.68
		食品・生活必需品小売り	1.34
		飲料	1.61
		食品	1.53
		タバコ	0.64
		家庭用品	1.07
		パーソナル用品	0.63
		ヘルスケア機器・用品	3.04
		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.93
		バイオテクノロジー	1.76
		医薬品	4.62
		銀行	5.80
		各種金融サービス	0.92
		保険	2.91
		情報技術サービス	4.66
		ソフトウェア	7.61
		通信機器	0.68
		コンピュータ・周辺機器	4.63
		電子装置・機器・部品	0.55
		半導体・半導体製造装置	4.55
		各種電気通信サービス	1.35
		無線通信サービス	0.28
		電力	1.71
		ガス	0.14
		総合公益事業	0.78
		水道	0.11
		消費者金融	0.49
		資本市場	3.22
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.09
		ヘルスケア・テクノロジー	0.15
		ライフサイエンス・ツール/サービス	1.15
		専門サービス	0.81
投資証券	—	—	2.26
合 計			98.56

（参考）新興国株式マザーファンド

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （%）
1	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	1,826,000	2,348.36	4,288,114,229	2,286.52	4,175,196,476	6.12
2	香港	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	インターネット販売・通信販売	1,123,080	3,070.24	3,448,126,694	2,779.95	3,122,114,108	4.57
3	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	426,700	8,437.73	3,600,383,039	6,932.28	2,958,003,876	4.33
4	アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	—	4,229,400	681.75	2,883,416,850	675.00	2,854,869,741	4.18
5	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	354,000	7,828.81	2,771,399,636	7,560.30	2,676,346,200	3.92
6	香港	株式	MEITUAN-CLASS B	インターネット販売・通信販売	267,400	3,997.16	1,068,841,231	3,218.15	860,534,914	1.26
7	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	293,821	2,485.76	730,369,535	2,490.12	731,652,194	1.07
8	南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インターネット販売・通信販売	32,280	24,906.74	803,989,816	21,475.07	693,215,269	1.01
9	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	211,500	2,880.79	609,287,207	3,038.81	642,708,315	0.94
10	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	252,600	2,010.09	507,748,779	2,393.16	604,512,216	0.88
11	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	7,128,000	87.81	625,943,516	76.22	543,345,343	0.79
12	アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	インターネット販売・通信販売	64,060	8,261.75	529,248,197	7,875.61	504,511,942	0.74
13	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	127,000	3,701.22	470,054,961	3,573.90	453,885,808	0.66
14	アメリカ	株式	NIO INC ADR	自動車	95,800	4,084.24	391,270,398	4,666.46	447,047,232	0.65

15	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	469,000	1,146.24	537,588,483	951.77	446,384,585	0.65
16	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	40,470	12,374.71	500,804,517	10,909.80	441,519,606	0.64
17	香港	株式	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	ライフサイ エンス・ ツール/ サービス	249,500	1,460.02	364,277,229	1,755.61	438,025,693	0.64
18	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュー タ・周辺機 器	60,990	7,145.53	435,806,400	6,947.82	423,747,542	0.62
19	台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半 導体製造装 置	111,538	4,076.35	454,668,534	3,659.22	408,142,750	0.59
20	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・ 機器・部品	924,649	460.16	425,489,624	435.34	402,538,545	0.59
21	香港	株式	XIAOMI CORPORATION	コンピュー タ・周辺機 器	1,064,000	357.77	380,671,731	364.93	388,286,584	0.56
22	韓国	株式	NAVER CORP	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	9,130	34,787.74	317,612,080	42,060.14	384,009,169	0.56
23	インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	374,200	901.99	337,526,463	1,017.50	380,748,500	0.55
24	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガ ス・消耗燃 料	434,000	716.54	310,982,329	857.74	372,261,182	0.54
25	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	19,980	20,961.24	418,805,633	18,291.39	365,462,160	0.53
26	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	777,000	471.81	366,600,214	455.42	353,865,881	0.51
27	アメリカ	株式	NETEASE INC-ADR	娯楽	29,790	12,052.65	359,048,728	11,047.54	329,106,246	0.48
28	アメリカ	株式	PINDUODUO INC ADR	インター ネット販 売・通信販 売	32,510	14,541.29	472,737,352	10,084.02	327,831,783	0.48
29	韓国	株式	KAKAO CORP	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	22,850	11,049.50	252,481,196	14,211.45	324,731,633	0.47
30	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術 サービス	67,800	4,638.74	314,507,011	4,729.78	320,679,355	0.47

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	6.42
		メディア	0.21
		娯楽	1.11
		不動産管理・開発	1.58
		エネルギー設備・サービス	0.04
		石油・ガス・消耗燃料	4.80
		化学	2.62
		建設資材	1.01
		容器・包装	0.07
		金属・鉱業	4.56
		紙製品・林産品	0.17
		航空宇宙・防衛	0.09
		建設関連製品	0.03
		建設・土木	0.44
		電気設備	0.28
		コングロマリット	0.91
		機械	0.37
		商社・流通業	0.07
		商業サービス・用品	0.25
		航空貨物・物流サービス	0.21
		旅客航空輸送業	0.09
		海運業	0.53
		陸運・鉄道	0.24
		運送インフラ	0.48
		自動車部品	0.51
		自動車	3.02
		家庭用耐久財	0.33
		レジャー用品	0.07
		繊維・アパレル・贅沢品	1.17
		ホテル・レストラン・レジャー	0.72
		インターネット販売・通信販売	8.62
		複合小売り	0.39

		専門小売り	0.53
		食品・生活必需品小売り	1.12
		飲料	0.80
		食品	1.49
		タバコ	0.30
		家庭用品	0.37
		パーソナル用品	0.60
		ヘルスケア機器・用品	0.25
		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.60
		バイオテクノロジー	0.86
		医薬品	1.19
		銀行	11.81
		各種金融サービス	0.69
		保険	2.40
		情報技術サービス	2.12
		ソフトウェア	0.29
		通信機器	0.14
		コンピュータ・周辺機器	5.82
		電子装置・機器・部品	2.53
		半導体・半導体製造装置	8.73
		各種電気通信サービス	1.03
		無線通信サービス	1.49
		電力	0.69
		ガス	0.57
		総合公益事業	0.02
		水道	0.10
		貯蓄・抵当・不動産金融	0.66
		消費者金融	0.50
		資本市場	0.82
		各種消費者サービス	0.11
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.42
		ヘルスケア・テクノロジー	0.13
		ライフサイエンス・ツール/サービス	1.10
		専門サービス	0.02
		その他の業種	0.00
新株予約権証券	—	—	0.00

投資信託受益証券	—	—	4.18
投資証券	—	—	0.08
合 計			96.28

（参考）Ｊ－ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,317	728,868	3,146,526,048	708,000	3,056,436,000	6.57
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3,809	687,001	2,616,787,151	687,000	2,616,783,000	5.62
3	日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	12,337	187,953	2,318,788,374	196,500	2,424,220,500	5.21
4	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	6,035	354,982	2,142,319,689	366,000	2,208,810,000	4.74
5	日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	19,219	115,514	2,220,072,214	114,500	2,200,575,500	4.73
6	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,318	182,878	2,252,701,427	174,100	2,144,563,800	4.61
7	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,435	327,029	1,777,407,234	326,000	1,771,810,000	3.80
8	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	7,590	213,985	1,624,151,766	209,000	1,586,310,000	3.41
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,809	367,408	1,399,460,157	373,500	1,422,661,500	3.05
10	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,575	161,071	1,381,192,228	161,100	1,381,432,500	2.96
11	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	5,408	205,722	1,112,544,954	211,900	1,145,955,200	2.46
12	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,204	92,702	1,038,642,843	96,600	1,082,306,400	2.32
13	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,503	449,893	1,126,083,405	428,000	1,071,284,000	2.30
14	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,178	807,870	951,671,602	807,000	950,646,000	2.04
15	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,909	509,007	971,694,420	497,500	949,727,500	2.04
16	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,663	180,726	842,728,275	201,000	937,263,000	2.01
17	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,315	650,959	856,012,215	671,000	882,365,000	1.89
18	日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,416	588,551	833,388,640	614,000	869,424,000	1.86
19	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,489	322,554	802,837,055	332,500	827,592,500	1.77
20	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	11,670	70,390	821,451,533	66,700	778,389,000	1.67
21	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	16,766	46,514	779,865,627	43,050	721,776,300	1.55
22	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,479	164,403	736,365,381	161,100	721,566,900	1.55
23	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,335	521,307	695,945,579	508,000	678,180,000	1.45
24	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,121	159,196	656,050,177	159,500	657,299,500	1.41
25	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,349	184,988	619,527,457	193,800	649,036,200	1.39

26	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	805	794,921	639,911,557	790,000	635,950,000	1.36
27	日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	2,602	233,318	607,093,644	237,300	617,454,600	1.32
28	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,715	356,978	612,217,270	350,500	601,107,500	1.29
29	日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	4,982	119,504	595,371,967	120,400	599,832,800	1.28
30	日本	投資証券	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	24,207	22,520	545,159,311	22,750	550,709,250	1.18

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.95
合 計	96.95

（参考）海外ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	184,640	13,530.61	2,498,293,287	14,002.67	2,585,454,115	6.04
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	22,360	88,700.91	1,983,352,444	86,100.74	1,925,212,685	4.49
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	37,940	32,197.16	1,221,560,529	34,140.07	1,295,274,518	3.02
4	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	70,180	17,591.96	1,234,604,050	16,477.15	1,156,366,394	2.70
5	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	81,890	14,823.94	1,213,932,765	13,786.98	1,129,015,858	2.63
6	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	104,100	8,644.20	899,861,850	9,605.55	999,938,557	2.33
7	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	34,810	23,084.02	803,554,774	25,173.94	876,304,879	2.04
8	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	85,800	8,688.49	745,472,629	9,248.62	793,531,622	1.85
9	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	419,400	1,639.19	687,479,082	1,819.35	763,035,390	1.78
10	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	34,220	20,778.86	711,052,849	21,870.62	748,412,873	1.74
11	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	93,200	7,760.76	723,303,093	7,688.38	716,557,743	1.67
12	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	33,370	17,386.27	580,179,846	19,022.79	634,790,589	1.48
13	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	141,700	4,103.17	581,420,586	4,449.67	630,518,749	1.47
14	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	93,600	6,319.15	591,472,644	6,529.98	611,206,465	1.42
15	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	28,640	18,495.71	529,717,252	21,132.66	605,239,523	1.41
16	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	27,970	19,208.57	537,263,730	21,419.52	599,104,218	1.39
17	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	16,220	33,957.58	550,791,964	36,197.39	587,121,731	1.37
18	香港	投資証券	LINK REIT	520,000	1,067.46	555,083,184	1,056.75	549,510,000	1.28
19	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	134,600	3,787.55	509,805,039	4,066.45	547,345,328	1.27
20	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	299,300	1,650.65	494,039,628	1,825.48	546,366,762	1.27
21	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	93,600	5,344.12	500,209,882	5,574.13	521,739,120	1.21
22	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	35,600	13,377.54	476,240,485	12,964.71	461,543,708	1.07
23	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	134,400	3,569.48	479,738,318	3,393.09	456,031,981	1.06
24	アメリカ	投資証券	JDR INC	74,300	5,445.56	404,605,404	6,086.54	452,230,598	1.05
25	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	24,260	14,545.92	352,884,102	16,286.63	395,113,826	0.92
26	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	44,200	8,435.09	372,831,407	8,809.56	389,382,791	0.90
27	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	42,500	8,331.51	354,089,346	9,119.42	387,575,439	0.90
28	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	71,700	5,137.56	368,363,119	4,756.24	341,022,809	0.79

29	アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	146,100	2,361.88	345,072,078	2,280.67	333,206,866	0.77
30	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	34,700	10,715.29	371,820,792	9,488.92	329,265,604	0.76

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.82
合 計	98.82

【投資不動産物件】

野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０

該当事項はありません。

（参考）国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）Ｊ－ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０

該当事項はありません。

（参考）国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （％）
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2021年09月限)	買建	330	日本円	6,360,145,043	6,286,500,000	1.61

（参考）外国株式M S C I - K O K U S A Iマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資 比率 （％）
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2021 年09月限)	買建	458	米ドル	98,390,125	10,772,734,782	101,029,075	11,061,673,406	1.03
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2021年09 月限)	買建	25	カナダド ル	6,005,960	527,563,528	6,069,500	533,144,876	0.04
	ドイツ	ユーレク ス・ドイツ 金融先物取 引所	ユーロ50株価指数 先物(2021年09月 限)	買建	296	ユーロ	11,968,260	1,557,190,311	12,173,000	1,583,829,022	0.14
	オース トラリア	シドニー先 物取引所	SP1200株価指数先 物(2021年09月限)	買建	23	豪ドル	4,143,025	335,004,999	4,215,325	340,851,174	0.03
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FT100株価指数先 物(2021年09月限)	買建	64	英ポンド	4,453,195	680,270,077	4,484,800	685,098,048	0.06
	スイス	ユーレク ス・チュー リッヒ取引 所	SMI株価指数先物 (2021年09月限)	買建	32	スイスフ ラン	3,830,010	462,856,712	3,859,200	466,384,320	0.04

（参考）新興国株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国／地域	取引所	名称	買建／売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額（円）	評価額	評価額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	E-mini MSCIエマージングマーケット株価指数先物(2021年09月限)	買建	314	米ドル	20,729,965	2,269,723,864	20,256,140	2,217,844,748	3.25
	シンガポール	シンガポール取引所	SGX FTSE China A50 指数先物(2021年08月限)	買建	141	米ドル	2,246,865	246,009,248	2,161,671	236,681,352	0.34

（参考）Ｊ－ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建／売建	枚数	通貨	帳簿価額（円）	評価額（円）	投資比率（％）
REIT指数先物取引	大阪取引所	REIT指数先物(2021年09月限)	買建	636	日本円	1,357,578,170	1,366,446,000	2.93

（参考）海外ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国／地域	取引所	名称	買建／売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額（円）	評価額	評価額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴボード オブトレード	ダウ・ジョーンズ米国不動産指数先物(2021年09月限)	買建	102	米ドル	4,158,270	455,288,983	4,224,840	462,577,729	1.08

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０

2021年7月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間	(2018年 6月22日)	3	3	1.0433	1.0438
第2計算期間	(2019年 6月24日)	11	11	1.0457	1.0462

第3計算期間	(2020年 6月22日)	50	50	1.0454	1.0459
第4計算期間	(2021年 6月22日)	138	138	1.2825	1.2830
	2020年 7月末日	57	—	1.0470	—
	8月末日	64	—	1.0906	—
	9月末日	69	—	1.0784	—
	10月末日	74	—	1.0616	—
	11月末日	84	—	1.1358	—
	12月末日	92	—	1.1602	—
	2021年 1月末日	99	—	1.1776	—
	2月末日	107	—	1.2032	—
	3月末日	119	—	1.2460	—
	4月末日	125	—	1.2564	—
	5月末日	133	—	1.2695	—
	6月末日	142	—	1.2865	—
	7月末日	149	—	1.2774	—

【分配の推移】

野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０

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

【収益率の推移】

野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０

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

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

（４）【設定及び解約の実績】

野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 8月31日～2018年 6月22日	3,834,123	59,096	3,775,027
第2計算期間	2018年 6月23日～2019年 6月24日	7,911,071	907,263	10,778,835
第3計算期間	2019年 6月25日～2020年 6月22日	39,475,833	2,269,171	47,985,497
第4計算期間	2020年 6月23日～2021年 6月22日	68,208,980	7,858,734	108,335,743

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報



運用実績（2021年7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）

2021年6月	5 円
2020年6月	5 円
2019年6月	5 円
2018年6月	5 円
--	--
設定来累計	20 円

■ 主要な資産の状況

銘柄別投資比率

順位	銘柄	投資比率(%)
1	国内株式マザーファンド	24.1
2	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	21.2
3	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	14.4
4	外国債券マザーファンド	9.8
5	新興国株式マザーファンド	9.8
6	海外REITインデックス マザーファンド	7.7
7	J-REITインデックス マザーファンド	7.6
8	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	5.3

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	国庫債券 利付（10年）第362回	国債証券	0.3
2	国庫債券 利付（10年）第343回	国債証券	0.3
3	国庫債券 利付（10年）第351回	国債証券	0.3
4	国庫債券 利付（10年）第342回	国債証券	0.2
5	国庫債券 利付（5年）第135回	国債証券	0.2

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.2
2	US TREASURY BOND	国債証券	0.1
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
4	US TREASURY BOND	国債証券	0.1
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.1

・「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1
2	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1
3	LETRA TESOURO NACIONAL	国債証券	0.1
4	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1
5	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.9
2	ソニーグループ	電気機器	0.6
3	キーエンス	電気機器	0.5
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.5
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.4

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.6
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.5
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.4
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.2
5	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.2

・「新興国株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.6
2	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	インターネット販売・通信販売	0.4
3	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.4
4	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	—	0.4
5	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.4

・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

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

・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	0.5
2	EQUINIX INC	投資証券	0.3
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.2
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	0.2
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.2

■ 年間収益率の推移（暦年ベース）



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドは合成指数をベンチマークとしていますが、年1回基本投資割合を変更するため、暦年ベースで収益率を表示した場合、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマークは掲載しておりません。
- ・2017年は設定日（2017年8月31日）から年末までの収益率。
- ・2021年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・ 販売の単位は、1円以上1円単位(当初元本1口＝1円)とします。

■ 積立方式 ■

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

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

- ・ 受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・ 取得申込日の翌々営業日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。
- ・ 金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号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、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付けを取り消す場合があります。

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

2【換金（解約）手続等】

- ・ 受益者は、委託者に1口単位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けについては、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付けにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。
- ・ 換金価額は、換金申込日の翌営業日の基準価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口換金には制限を設ける場合があります。
- ・解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。
- ・金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受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付けが中止された場合には、受益者は当該受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付けたものとして信託約款の規定に準じて計算された価額とします。

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

< 基準価額の計算方法 >

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

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

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

る評価を適用することができます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

2065年6月22日までとします(2017年8月31日設定)。

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年6月23日から翌年6月22日までとします。

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

（５）【その他】

（a）ファンドの繰上償還条項

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

（b）信託期間の終了

（ ）委託者は、上記「（a）ファンドの繰上償還条項」に従い信託期間を終了させるには、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。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於いて存続します。

(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於いても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決され

た場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

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

(g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

(i) 関係法人との契約の更新に関する手続

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

■ 収益分配金の支払い開始日 ■

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

して5営業日までに支払いを開始します。販売会社でお受取りください。

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

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

■ 収益分配金請求権の失効 ■

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

■ 償還金の支払い開始日 ■

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

■ 償還金請求権の失効 ■

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2020年6月23日から2021年6月22日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 (2020年 6月22日現在)	第4期 (2021年 6月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	311,822	539,930
親投資信託受益証券	50,112,756	138,802,040
未収入金	403,158	-
流動資産合計	50,827,736	139,341,970
資産合計	50,827,736	139,341,970
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	23,992	54,167
未払解約金	552,666	79,301
未払受託者報酬	8,224	25,164
未払委託者報酬	78,075	239,024
その他未払費用	564	1,825
流動負債合計	663,521	399,481
負債合計	663,521	399,481
純資産の部		
元本等		
元本	47,985,497	108,335,743
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,178,718	30,606,746
（分配準備積立金）	651,333	17,974,807
元本等合計	50,164,215	138,942,489
純資産合計	50,164,215	138,942,489
負債純資産合計	50,827,736	139,341,970

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自 2019年 6月25日 至 2020年 6月22日	第4期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	73,569	19,258,015
営業収益合計	73,569	19,258,015
営業費用		
支払利息	-	3
受託者報酬	12,316	40,261
委託者報酬	116,846	382,422
その他費用	829	2,889
営業費用合計	129,991	425,575
営業利益又は営業損失（ ）	56,422	18,832,440
経常利益又は経常損失（ ）	56,422	18,832,440
当期純利益又は当期純損失（ ）	56,422	18,832,440
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	21,349	780,444
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	492,205	2,178,718
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,910,483	11,013,515
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,910,483	11,013,515
剰余金減少額又は欠損金増加額	122,207	583,316
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	122,207	583,316
分配金	23,992	54,167
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,178,718	30,606,746

（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、2020年 6月23日から2021年 6月22日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

第3期 2020年 6月22日現在	第4期 2021年 6月22日現在
１． 計算期間の末日における受益権の総数 47,985,497口	１． 計算期間の末日における受益権の総数 108,335,743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 1.0454円 (10,000口当たり純資産額) (10,454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 1.2825円 (10,000口当たり純資産額) (12,825円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第3期 自 2019年 6月25日 至 2020年 6月22日	第4期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>533,758円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>1,527,385円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>141,567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>2,202,710円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>47,985,497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>459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>23,992円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	533,758円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	1,527,385円	分配準備積立金額	D	141,567円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,202,710円	当ファンドの期末残存口数	F	47,985,497口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	459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	23,992円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>1,967,172円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>15,473,565円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>12,631,939円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>588,237円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>30,660,913円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>108,335,743口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>2,830円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>5円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>54,167円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,967,172円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	15,473,565円	収益調整金額	C	12,631,939円	分配準備積立金額	D	588,237円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	30,660,913円	当ファンドの期末残存口数	F	108,335,743口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,830円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	54,167円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	533,758円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	1,527,385円																																																											
分配準備積立金額	D	141,567円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,202,710円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	47,985,497口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	459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	23,992円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,967,172円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	15,473,565円																																																											
収益調整金額	C	12,631,939円																																																											
分配準備積立金額	D	588,237円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	30,660,913円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	108,335,743口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,830円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	54,167円																																																											

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

第3期 自 2019年 6月25日 至 2020年 6月22日	第4期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 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。	1.金融商品に対する取組方針 同左 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第3期 2020年 6月22日現在	第4期 2021年 6月22日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法	1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2.時価の算定方法

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 2019年 6月25日 至 2020年 6月22日	第4期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第3期 自 2019年 6月25日 至 2020年 6月22日	第4期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日
期首元本額 10,778,835円	期首元本額 47,985,497円
期中追加設定元本額 39,475,833円	期中追加設定元本額 68,208,980円
期中一部解約元本額 2,269,171円	期中一部解約元本額 7,858,734円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第3期 自 2019年 6月25日 至 2020年 6月22日	第4期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	91,754	18,067,617
合計	91,754	18,067,617

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(2021年6月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年6月22日現在)

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	17,071,401	34,972,472	
		外国債券マザーファンド	5,234,310	13,267,928	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	4,925,351	19,937,820	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	20,677,952	27,489,269	
		J-REITインデックスマザーファンド	3,788,759	10,646,412	
		海外REITインデックスマザーファンド	3,713,580	10,704,022	
		新興国株式マザーファンド	8,645,833	14,566,499	
		新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	5,074,967	7,217,618	
		銘柄数：8	69,132,153	138,802,040	
	組入時価比率：99.9%		100.0%		
合計				138,802,040	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2021年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,247,086,149

(2021年 6月22日現在)

国債証券	626,662,407,900
地方債証券	54,077,815,068
特殊債券	64,903,411,696
社債券	32,166,594,300
未収利息	921,799,321
前払費用	19,931,481
流動資産合計	786,999,045,915
資産合計	786,999,045,915
負債の部	
流動負債	
未払金	2,507,328,000
未払解約金	422,766,506
未払利息	7,234
流動負債合計	2,930,101,740
負債合計	2,930,101,740
純資産の部	
元本等	
元本	589,810,715,161
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	194,258,229,014
元本等合計	784,068,944,175
純資産合計	784,068,944,175
負債純資産合計	786,999,045,915

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2021年 6月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3294円
(10,000口当たり純資産額)	(13,294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 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2021年 6月22日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 6月22日現在	
期首	2020年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	517,242,060,542円
同期中における追加設定元本額	129,388,623,264円
同期中における一部解約元本額	56,819,968,645円
期末元本額	589,810,715,161円
期末元本額の内訳*	
野村国内債券インデックスファンド	413,204,365円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	41,978,321,756円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	18,083,091,008円

野村世界6資産分散投信（成長コース）	3,282,984,833円
野村資産設計ファンド2015	353,146,376円
野村資産設計ファンド2020	353,509,083円
野村資産設計ファンド2025	333,845,609円
野村資産設計ファンド2030	266,237,647円
野村資産設計ファンド2035	141,863,039円
野村資産設計ファンド2040	195,238,158円
野村日本債券インデックスファンド	887,473,626円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	166,758,092,067円
のむラップ・ファンド（保守型）	13,579,188,121円
のむラップ・ファンド（普通型）	12,246,391,433円
のむラップ・ファンド（積極型）	1,712,172,851円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）	10,515,353,923円
野村資産設計ファンド2045	21,427,150円
野村円債投資インデックスファンド	843,425,478円
野村インデックスファンド・国内債券	2,269,660,530円
マイ・ロード	33,960,390,281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	1,365,178,998円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）	18,018,594,394円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,698,713,646円
野村資産設計ファンド2050	22,848,000円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	26,792,113円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	7,220,075円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	3,987,414円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	2,454,847円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	1,022,086,123円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	336,879,598円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	48,775,140円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	27,672,643円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	75,536,276円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	12,885,817円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	9,649,140円
野村6資産均等バランス	3,069,356,595円
世界6資産分散ファンド	119,058,048円
野村資産設計ファンド2060	8,316,608円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合連動型上場投信	17,443,115,061円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	23,125,141,687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）	571,274,562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）	90,720,936円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	1,899,895,759円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	1,196,000,948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）	18,884,847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）	10,449,706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）	1,016,629円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,666,914,299円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	9,525,799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）	67,960,509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）	70,097,564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）	388,142,326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）	312,093,107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）	925,919,518円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	173,349,510円
ノムラ日本債券インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	775,566,575円
ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・国内債券（適格機関投資家専用）	324,470,872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）	14,718,088円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	37,808,968,502円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	49,765,347,998円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	18,933,433,239円
野村国内債券インデックスファンド・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合（確定拠出年金向け）	50,495,956,767円
マイバランスＤＣ３０	13,380,371,351円
マイバランスＤＣ５０	10,911,090,880円
マイバランスＤＣ７０	3,661,060,474円
野村ＤＣ国内債券インデックスファンド・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合	13,027,546,030円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	1,061,874,109円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	2,580,333,188円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	1,193,999,896円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	170,799,563円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	26,376,960円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	30,214,893円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	51,773,253円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	20,677,952円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	8,205,817円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	775,145,080円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	393,318,206円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	143,153,079円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	184,494,681円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	3,693,960円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	26,406,866円
多資産分散投資ファンド（バランス１０）（確定拠出年金向け）	191,306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(2021年6月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年6月22日現在)

（単位：円）

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

国債証券	日本円	国庫債券 利付（２年）第４１５回	3,700,000,000	3,708,991,000	
		国庫債券 利付（２年）第４１６回	3,000,000,000	3,008,040,000	
		国庫債券 利付（２年）第４１７回	3,200,000,000	3,209,184,000	
		国庫債券 利付（２年）第４１８回	4,400,000,000	4,413,464,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２０回	500,000,000	501,680,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２１回	3,500,000,000	3,512,425,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２２回	1,400,000,000	1,405,208,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２３回	5,200,000,000	5,211,544,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２４回	1,500,000,000	1,503,480,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３３回	6,200,000,000	6,216,182,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３４回	2,500,000,000	2,507,850,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３５回	8,500,000,000	8,531,790,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３６回	3,300,000,000	3,314,157,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３７回	4,000,000,000	4,019,760,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３８回	5,500,000,000	5,530,910,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３９回	5,200,000,000	5,232,136,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４０回	6,600,000,000	6,644,550,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４１回	4,500,000,000	4,532,220,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４３回	6,070,000,000	6,120,138,200	
		国庫債券 利付（５年）第１４４回	6,500,000,000	6,557,330,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４５回	4,900,000,000	4,944,884,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４６回	2,100,000,000	2,119,425,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４７回	300,000,000	301,500,000	
		国庫債券 利付（４０年）第１回	2,360,000,000	3,409,562,800	
		国庫債券 利付（４０年）第２回	900,000,000	1,260,432,000	
		国庫債券 利付（４０年）第３回	900,000,000	1,265,391,000	
		国庫債券 利付（４０年）第４回	1,130,000,000	1,594,317,000	
		国庫債券 利付（４０年）第５回	1,200,000,000	1,636,008,000	
		国庫債券 利付（４０年）第６回	1,300,000,000	1,745,926,000	
		国庫債券 利付（４０年）第７回	1,400,000,000	1,809,024,000	
		国庫債券 利付（４０年）第８回	1,500,000,000	1,811,295,000	
		国庫債券 利付（４０年）第９回	2,050,000,000	1,854,799,000	
		国庫債券 利付（４０年）第１０回	2,010,000,000	2,127,946,800	
		国庫債券 利付（４０年）第１１回	1,750,000,000	1,795,885,000	
		国庫債券 利付（４０年）第１２回	2,070,000,000	1,917,772,200	
		国庫債券 利付（４０年）第１３回	7,170,000,000	6,621,925,200	
		国庫債券 利付（１０年）第３２５回	4,400,000,000	4,449,852,000	
		国庫債券 利付（１０年）第３２６回	2,100,000,000	2,125,431,000	
		国庫債券 利付（１０年）第３２７回	3,100,000,000	3,142,191,000	
		国庫債券 利付（１０年）第３２８回	5,250,000,000	5,314,942,500	

国庫債券 利付（１０年）第３２９回	6,000,000,000	6,109,560,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３０回	3,800,000,000	3,878,622,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３１回	1,900,000,000	1,930,761,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３２回	5,900,000,000	6,006,200,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３３回	3,600,000,000	3,671,748,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３４回	6,600,000,000	6,743,682,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３５回	4,600,000,000	4,692,874,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３６回	2,750,000,000	2,809,785,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３７回	3,000,000,000	3,044,190,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３８回	5,000,000,000	5,097,650,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３９回	5,000,000,000	5,104,250,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４０回	4,200,000,000	4,292,232,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４１回	7,300,000,000	7,433,444,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４２回	8,550,000,000	8,631,396,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４３回	9,200,000,000	9,289,976,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４４回	5,800,000,000	5,858,058,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４５回	5,000,000,000	5,052,400,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４６回	4,900,000,000	4,953,704,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４７回	5,400,000,000	5,461,776,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４８回	6,800,000,000	6,878,948,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４９回	2,800,000,000	2,832,872,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５０回	6,550,000,000	6,627,617,500	
国庫債券 利付（１０年）第３５１回	10,200,000,000	10,321,788,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５２回	6,600,000,000	6,679,200,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５３回	5,100,000,000	5,159,466,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５４回	4,350,000,000	4,400,677,500	
	5,100,000,000	5,157,222,000	

国庫債券 利付（１０年）第３５５回			
国庫債券 利付（１０年）第３５６回	4,800,000,000	4,849,536,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５７回	1,900,000,000	1,918,563,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５８回	5,470,000,000	5,520,214,600	
国庫債券 利付（１０年）第３５９回	5,600,000,000	5,645,248,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６０回	7,900,000,000	7,954,589,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６１回	8,400,000,000	8,447,628,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６２回	10,100,000,000	10,148,884,000	
国庫債券 利付（３０年）第１回	500,000,000	616,175,000	
国庫債券 利付（３０年）第２回	500,000,000	604,475,000	
国庫債券 利付（３０年）第３回	160,000,000	192,691,200	
国庫債券 利付（３０年）第４回	900,000,000	1,142,397,000	
国庫債券 利付（３０年）第５回	150,000,000	181,702,500	
国庫債券 利付（３０年）第６回	600,000,000	744,102,000	
国庫債券 利付（３０年）第７回	600,000,000	743,214,000	
国庫債券 利付（３０年）第８回	100,000,000	119,054,000	
国庫債券 利付（３０年）第９回	265,000,000	303,626,400	
国庫債券 利付（３０年）第１０回	250,000,000	278,200,000	
国庫債券 利付（３０年）第１１回	160,000,000	189,660,800	
国庫債券 利付（３０年）第１２回	220,000,000	271,904,600	
国庫債券 利付（３０年）第１３回	290,000,000	355,792,300	
国庫債券 利付（３０年）第１４回	800,000,000	1,024,368,000	
国庫債券 利付（３０年）第１５回	900,000,000	1,167,291,000	
国庫債券 利付（３０年）第１６回	915,000,000	1,191,128,700	
国庫債券 利付（３０年）第１７回	1,200,000,000	1,550,928,000	
国庫債券 利付（３０年）第１８回	2,200,000,000	2,821,566,000	
国庫債券 利付（３０年）第１９回	2,050,000,000	2,637,735,000	
国庫債券 利付（３０年）第２０回	1,270,000,000	1,674,533,100	
国庫債券 利付（３０年）第２１回	300,000,000	388,185,000	
国庫債券 利付（３０年）第２２回	600,000,000	795,306,000	
国庫債券 利付（３０年）第２３回	840,000,000	1,116,334,800	
国庫債券 利付（３０年）第２４回	700,000,000	933,331,000	
国庫債券 利付（３０年）第２５回	500,000,000	653,370,000	
国庫債券 利付（３０年）第２６回	850,000,000	1,125,893,000	
国庫債券 利付（３０年）第２７回	1,550,000,000	2,087,865,500	
国庫債券 利付（３０年）第２８回	1,200,000,000	1,624,680,000	
国庫債券 利付（３０年）第２９回	1,500,000,000	2,014,800,000	
国庫債券 利付（３０年）第３０回	1,700,000,000	2,263,142,000	

国庫債券	利付（３０年）第３１回	1,200,000,000	1,582,056,000	
国庫債券	利付（３０年）第３２回	1,200,000,000	1,610,100,000	
国庫債券	利付（３０年）第３３回	2,400,000,000	3,099,984,000	
国庫債券	利付（３０年）第３４回	1,600,000,000	2,134,704,000	
国庫債券	利付（３０年）第３５回	2,300,000,000	2,989,149,000	
国庫債券	利付（３０年）第３６回	2,000,000,000	2,607,820,000	
国庫債券	利付（３０年）第３７回	2,300,000,000	2,963,895,000	
国庫債券	利付（３０年）第３８回	1,600,000,000	2,033,760,000	
国庫債券	利付（３０年）第３９回	1,600,000,000	2,070,464,000	
国庫債券	利付（３０年）第４０回	1,300,000,000	1,656,525,000	
国庫債券	利付（３０年）第４１回	1,500,000,000	1,882,980,000	
国庫債券	利付（３０年）第４２回	1,600,000,000	2,010,496,000	
国庫債券	利付（３０年）第４３回	1,300,000,000	1,635,166,000	
国庫債券	利付（３０年）第４４回	1,400,000,000	1,762,684,000	
国庫債券	利付（３０年）第４５回	1,700,000,000	2,066,078,000	
国庫債券	利付（３０年）第４６回	1,800,000,000	2,188,926,000	
国庫債券	利付（３０年）第４７回	1,700,000,000	2,107,354,000	
国庫債券	利付（３０年）第４８回	1,900,000,000	2,272,191,000	
国庫債券	利付（３０年）第４９回	2,900,000,000	3,469,502,000	
国庫債券	利付（３０年）第５０回	1,900,000,000	2,009,991,000	
国庫債券	利付（３０年）第５１回	2,650,000,000	2,493,464,500	
国庫債券	利付（３０年）第５２回	1,900,000,000	1,872,697,000	
国庫債券	利付（３０年）第５３回	1,700,000,000	1,713,243,000	
国庫債券	利付（３０年）第５４回	1,700,000,000	1,791,783,000	
国庫債券	利付（３０年）第５５回	1,500,000,000	1,579,875,000	
国庫債券	利付（３０年）第５６回	1,900,000,000	1,997,470,000	
国庫債券	利付（３０年）第５７回	1,600,000,000	1,680,832,000	
国庫債券	利付（３０年）第５８回	2,100,000,000	2,204,391,000	
国庫債券	利付（３０年）第５９回	1,600,000,000	1,637,152,000	
国庫債券	利付（３０年）第６０回	1,150,000,000	1,232,225,000	
国庫債券	利付（３０年）第６１回	1,000,000,000	1,019,980,000	
国庫債券	利付（３０年）第６２回	500,000,000	484,075,000	
国庫債券	利付（３０年）第６３回	1,400,000,000	1,317,106,000	
国庫債券	利付（３０年）第６４回	1,500,000,000	1,407,150,000	
国庫債券	利付（３０年）第６５回	1,200,000,000	1,123,824,000	
国庫債券	利付（３０年）第６６回	2,600,000,000	2,430,818,000	
国庫債券	利付（３０年）第６７回	1,300,000,000	1,281,007,000	
国庫債券	利付（３０年）第６８回	1,950,000,000	1,918,956,000	
国庫債券	利付（３０年）第６９回	2,550,000,000	2,572,006,500	
国庫債券	利付（３０年）第７０回	1,500,000,000	1,511,145,000	
国庫債券	利付（２０年）第５８回	180,000,000	184,505,400	
国庫債券	利付（２０年）第５９回	230,000,000	236,226,100	

国庫債券 利付（２０年）第６０回	780,000,000	797,612,400
国庫債券 利付（２０年）第６１回	300,000,000	305,802,000
国庫債券 利付（２０年）第６２回	440,000,000	447,990,400
国庫債券 利付（２０年）第６３回	300,000,000	311,436,000
国庫債券 利付（２０年）第６４回	400,000,000	418,084,000
国庫債券 利付（２０年）第６５回	455,000,000	477,922,900
国庫債券 利付（２０年）第６６回	300,000,000	314,364,000
国庫債券 利付（２０年）第６７回	310,000,000	327,164,700
国庫債券 利付（２０年）第６８回	290,000,000	308,449,800
国庫債券 利付（２０年）第６９回	560,000,000	594,087,200
国庫債券 利付（２０年）第７０回	540,000,000	580,770,000
国庫債券 利付（２０年）第７１回	200,000,000	213,898,000
国庫債券 利付（２０年）第７２回	1,470,000,000	1,576,001,700
国庫債券 利付（２０年）第７３回	1,200,000,000	1,289,004,000
国庫債券 利付（２０年）第７４回	800,000,000	862,144,000
国庫債券 利付（２０年）第７５回	600,000,000	649,914,000
国庫債券 利付（２０年）第７６回	910,000,000	978,868,800
国庫債券 利付（２０年）第７７回	700,000,000	755,601,000
国庫債券 利付（２０年）第７８回	800,000,000	864,640,000
国庫債券 利付（２０年）第７９回	860,000,000	932,936,600
国庫債券 利付（２０年）第８０回	1,400,000,000	1,524,348,000
国庫債券 利付（２０年）第８１回	360,000,000	392,385,600
国庫債券 利付（２０年）第８２回	820,000,000	897,260,400
国庫債券 利付（２０年）第８３回	1,370,000,000	1,506,027,300
国庫債券 利付（２０年）第８４回	1,200,000,000	1,313,736,000
国庫債券 利付（２０年）第８５回	400,000,000	441,800,000
国庫債券 利付（２０年）第８６回	1,700,000,000	1,893,834,000
国庫債券 利付（２０年）第８７回	500,000,000	554,630,000
国庫債券 利付（２０年）第８８回	1,100,000,000	1,232,132,000
国庫債券 利付（２０年）第８９回	470,000,000	524,097,000
国庫債券 利付（２０年）第９０回	1,500,000,000	1,680,975,000
国庫債券 利付（２０年）第９１回	250,000,000	281,480,000
国庫債券 利付（２０年）第９２回	650,000,000	728,578,500
国庫債券 利付（２０年）第９３回	300,000,000	336,174,000
国庫債券 利付（２０年）第９４回	200,000,000	225,270,000
国庫債券 利付（２０年）第９５回	100,000,000	114,397,000
国庫債券 利付（２０年）第９６回	400,000,000	452,772,000
国庫債券 利付（２０年）第９７回	300,000,000	343,137,000
国庫債券 利付（２０年）第９８回	300,000,000	341,253,000
国庫債券 利付（２０年）第９９回	1,100,000,000	1,256,926,000
国庫債券 利付（２０年）第１００回	820,000,000	946,362,000
	250,000,000	291,912,500

国庫債券 利付（２０年）第１０１回			
国庫債券 利付（２０年）第１０２回	500,000,000	586,770,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０３回	600,000,000	699,912,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０４回	400,000,000	460,984,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０５回	1,900,000,000	2,199,383,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０６回	400,000,000	465,936,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０７回	300,000,000	348,642,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０８回	1,600,000,000	1,835,344,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０９回	900,000,000	1,036,359,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１０回	1,100,000,000	1,283,755,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１１回	800,000,000	943,664,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１２回	1,800,000,000	2,108,826,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１３回	2,000,000,000	2,351,080,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１４回	1,700,000,000	2,005,745,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１５回	1,000,000,000	1,188,360,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１６回	1,100,000,000	1,312,069,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１７回	1,400,000,000	1,657,670,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１８回	500,000,000	589,385,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１９回	800,000,000	928,640,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２０回	800,000,000	914,272,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２１回	1,200,000,000	1,407,504,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２２回	900,000,000	1,047,321,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２３回	500,000,000	597,690,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２４回	1,000,000,000	1,185,920,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２５回	400,000,000	483,588,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２６回	1,200,000,000	1,427,496,000	
	500,000,000	589,940,000	

国庫債券 利付（２０年）第１２７回			
国庫債券 利付（２０年）第１２８回	1,800,000,000	2,128,950,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２９回	1,100,000,000	1,290,102,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３０回	1,400,000,000	1,646,330,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３１回	800,000,000	932,624,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３２回	1,300,000,000	1,519,141,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３３回	1,400,000,000	1,650,558,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３４回	1,400,000,000	1,655,528,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３５回	700,000,000	820,309,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３６回	700,000,000	812,861,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３７回	1,000,000,000	1,174,590,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３８回	800,000,000	922,264,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３９回	1,000,000,000	1,163,710,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４０回	2,300,000,000	2,707,652,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４１回	2,600,000,000	3,067,454,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４２回	950,000,000	1,131,573,500	
国庫債券 利付（２０年）第１４３回	1,300,000,000	1,521,845,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４４回	1,300,000,000	1,506,804,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４５回	2,300,000,000	2,726,374,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４６回	2,400,000,000	2,850,672,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４７回	4,000,000,000	4,711,240,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４８回	2,100,000,000	2,451,330,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４９回	3,850,000,000	4,500,842,500	
国庫債券 利付（２０年）第１５０回	3,330,000,000	3,855,507,300	
国庫債券 利付（２０年）第１５１回	2,500,000,000	2,832,175,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５２回	2,650,000,000	3,004,358,000	
	1,600,000,000	1,838,288,000	

小計	国庫債券 利付（２０年）第１５３回			
	国庫債券 利付（２０年）第１５４回	1,220,000,000	1,386,078,600	
	国庫債券 利付（２０年）第１５５回	5,350,000,000	5,931,919,500	
	国庫債券 利付（２０年）第１５６回	5,850,000,000	5,978,992,500	
	国庫債券 利付（２０年）第１５７回	7,190,000,000	7,127,734,600	
	国庫債券 利付（２０年）第１５８回	2,100,000,000	2,172,303,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１５９回	2,000,000,000	2,098,140,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１６０回	2,300,000,000	2,445,613,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１６１回	2,100,000,000	2,199,477,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１６２回	1,700,000,000	1,778,982,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１６３回	2,600,000,000	2,718,300,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１６４回	2,600,000,000	2,674,334,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１６５回	2,200,000,000	2,260,170,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１６６回	2,300,000,000	2,436,850,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１６７回	2,600,000,000	2,664,272,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１６８回	2,700,000,000	2,715,741,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１６９回	2,530,000,000	2,495,895,600	
	国庫債券 利付（２０年）第１７０回	2,000,000,000	1,969,340,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１７１回	1,500,000,000	1,475,430,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１７２回	3,840,000,000	3,840,000,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１７３回	3,250,000,000	3,244,247,500	
	国庫債券 利付（２０年）第１７４回	3,340,000,000	3,328,076,200	
	国庫債券 利付（２０年）第１７５回	5,500,000,000	5,574,250,000	
	国庫債券 利付（２０年）第１７６回	5,420,000,000	5,488,996,600	
	メキシコ合衆国 第２５回円貨社債（２０１８）	100,000,000	100,230,000	
	銘柄数：264	587,885,000,000	626,662,407,900	
	組入時価比率：79.9%		80.6%	
合計		626,662,407,900		

地方債証券	日本円	東京都 公募第 7 1 2 回	100,000,000	100,949,000	
		東京都 公募第 7 1 5 回	100,000,000	101,123,000	
		東京都 公募第 7 1 6 回	200,000,000	202,276,000	
		東京都 公募第 7 3 1 回	100,000,000	101,698,000	
		東京都 公募第 7 3 6 回	100,000,000	101,593,000	
		東京都 公募第 7 4 5 回	300,000,000	306,129,000	
		東京都 公募第 7 6 0 回	100,000,000	99,999,000	
		東京都 公募第 7 6 1 回	100,000,000	100,156,000	
		東京都 公募第 7 6 9 回	500,000,000	504,625,000	
		東京都 公募第 7 7 8 回	100,000,000	100,704,000	
		東京都 公募（ 3 0 年 ）第 7 回	100,000,000	134,689,000	
		東京都 公募第 1 0 回	200,000,000	264,980,000	
		東京都 公募第 1 回	300,000,000	309,123,000	
		東京都 公募（ 2 0 年 ）第 3 回	200,000,000	212,298,000	
		東京都 公募第 7 回	100,000,000	109,076,000	
		東京都 公募（ 2 0 年 ）第 1 3 回	100,000,000	113,527,000	
		東京都 公募（ 2 0 年 ）第 1 6 回	200,000,000	228,860,000	
		東京都 公募（ 2 0 年 ）第 1 7 回	200,000,000	230,054,000	
		東京都 公募第 2 3 回	100,000,000	118,953,000	
		東京都 公募（ 2 0 年 ）第 2 6 回	100,000,000	116,873,000	
		東京都 公募（ 2 0 年 ）第 2 9 回	200,000,000	232,186,000	
		東京都 公募（ 5 年 ）第 3 1 回	300,000,000	299,919,000	
		北海道 公募平成 2 4 年度第 6 回	100,000,000	100,977,000	
		北海道 公募平成 2 4 年度第 9 回	100,000,000	101,047,000	
		北海道 公募平成 2 5 年度第 1 回	300,000,000	303,066,000	
		北海道 公募平成 2 6 年度第 1 3 回	100,000,000	101,527,000	
		北海道 公募平成 2 7 年度第 7 回	100,000,000	102,084,000	
		北海道 公募平成 2 9 年度第 5 回	200,000,000	201,318,000	
		北海道 公募平成 2 9 年度第 6 回	700,000,000	699,923,000	
		北海道 公募平成 2 9 年度第 7 回	100,000,000	100,863,000	
		北海道 公募平成 2 9 年度第 9 回	100,000,000	100,853,000	
		北海道 公募平成 3 0 年度第 1 5 回	269,280,000	269,759,318	
		北海道 公募令和 2 年度第 4 回	300,000,000	301,200,000	
		宮城県 公募第 3 2 回 2 号	100,000,000	100,315,000	
		神奈川県 公募第 1 9 6 回	100,000,000	101,155,000	
		神奈川県 公募第 2 0 0 回	100,000,000	101,819,000	
		神奈川県 公募第 2 0 5 回	100,000,000	101,777,000	
		神奈川県 公募第 2 0 6 回	100,000,000	101,916,000	
		神奈川県 公募第 2 1 0 回	200,000,000	203,042,000	
		神奈川県 公募第 2 1 2 回	100,000,000	101,491,000	
		神奈川県 公募第 2 3 1 回	200,000,000	202,070,000	
		神奈川県 公募第 2 4 7 回	200,000,000	200,266,000	

神奈川県 公募（３０年）第３回	100,000,000	134,285,000
神奈川県 公募第７回	300,000,000	337,170,000
神奈川県 公募（２０年）第１４回	100,000,000	116,866,000
神奈川県 公募（２０年）第１７回	200,000,000	236,264,000
神奈川県 公募（２０年）第２６回	100,000,000	115,449,000
大阪府 公募第３７８回	104,000,000	105,708,720
大阪府 公募第３８１回	100,000,000	101,765,000
大阪府 公募第３８２回	100,000,000	101,793,000
大阪府 公募第３８３回	100,000,000	101,905,000
大阪府 公募第３８４回	100,000,000	101,893,000
大阪府 公募第３８７回	300,000,000	304,743,000
大阪府 公募第３８９回	100,000,000	101,694,000
大阪府 公募第３９６回	200,000,000	204,108,000
大阪府 公募第４１７回	102,000,000	103,056,720
大阪府 公募第４２３回	100,000,000	100,708,000
大阪府 公募第４２９回	179,000,000	180,510,760
大阪府 公募第４５２回	100,000,000	99,717,000
大阪府 公募第５回	100,000,000	118,193,000
大阪府 公募第８回	100,000,000	117,128,000
大阪府 公募（５年）第１４１回	230,000,000	229,949,400
大阪府 公募（５年）第１７３回	200,000,000	199,756,000
大阪府 公募（５年）第１７４回	200,000,000	199,754,000
大阪府 公募（５年）第１７８回	400,000,000	399,476,000
京都府 公募平成２４年度第６回	100,000,000	101,052,000
京都府 公募平成２５年度第１５回	200,000,000	203,532,000
京都府 公募平成２６年度第５回	100,000,000	115,257,000
京都府 公募平成２６年度第７回	200,000,000	203,566,000
京都府 公募（２０年）平成２７年度第５回	200,000,000	225,704,000
京都府 公募（１５年）平成２７年度第８回	100,000,000	106,172,000
京都府 公募（１５年）平成２８年度第２回	200,000,000	201,744,000
京都府 公募（２０年）平成２８年度第５回	100,000,000	99,742,000
京都府 公募平成２９年度第４回	100,000,000	100,807,000
兵庫県 公募平成２６年度第１７回	100,000,000	101,583,000
兵庫県 公募平成２９年度第２２回	100,000,000	100,786,000
兵庫県 公募（３０年）第２回	200,000,000	267,658,000
兵庫県 公募（１５年）第１回	300,000,000	324,498,000
兵庫県 公募（１５年）第３回	200,000,000	215,466,000
兵庫県 公募（１２年）第３回	300,000,000	306,048,000
兵庫県 公募（１５年）第１１回	100,000,000	105,354,000
兵庫県 公募第２回	100,000,000	114,290,000

兵庫県 公募第 9 回	100,000,000	118,032,000
兵庫県 公募（ 2 0 年 ）第 1 1 回	200,000,000	231,252,000
兵庫県 公募（ 2 0 年 ）第 1 4 回	100,000,000	116,368,000
兵庫県 公募（ 2 0 年 ）第 2 2 回	100,000,000	114,496,000
静岡県 公募平成 2 4 年度第 5 回	100,060,000	100,963,541
静岡県 公募平成 2 4 年度第 1 0 回	100,000,000	101,158,000
静岡県 公募平成 2 5 年度第 5 回	101,000,000	102,922,030
静岡県 公募平成 2 6 年度第 3 回	165,000,000	168,210,900
静岡県 公募平成 2 6 年度第 8 回	100,000,000	101,792,000
静岡県 公募平成 2 6 年度第 9 回	200,000,000	203,602,000
静岡県 公募平成 2 7 年度第 1 1 回	115,400,000	115,891,604
静岡県 公募平成 2 8 年度第 2 回	300,000,000	300,852,000
静岡県 公募平成 2 9 年度第 3 回	100,000,000	100,658,000
静岡県 公募（ 3 1 年 ）第 1 回	174,000,000	174,332,340
静岡県 公募（ 5 年 ）令和 3 年度第 2 回	100,000,000	99,952,000
静岡県 公募（ 1 5 年 ）第 2 回	200,000,000	216,120,000
静岡県 公募（ 1 5 年 ）第 5 回	200,000,000	214,928,000
静岡県 公募（ 1 5 年 ）第 9 回	100,000,000	105,808,000
静岡県 公募（ 2 0 年 ）第 1 1 回	100,000,000	116,034,000
静岡県 公募（ 2 0 年 ）第 1 4 回	200,000,000	233,660,000
静岡県 公募（ 2 0 年 ）第 1 8 回	100,000,000	115,462,000
静岡県 公募（ 2 0 年 ）第 3 0 回	200,000,000	199,426,000
愛知県 公募平成 2 0 年度第 8 回	100,000,000	114,654,000
愛知県 公募（ 2 0 年 ）平成 2 4 年度第 4 回	100,000,000	116,273,000
愛知県 公募平成 2 4 年度第 8 回	150,000,000	151,468,500
愛知県 公募（ 1 5 年 ）平成 2 4 年度第 1 4 回	400,000,000	432,368,000
愛知県 公募平成 2 4 年度第 1 7 回	100,000,000	118,586,000
愛知県 公募（ 3 0 年 ）平成 2 5 年度第 8 回	120,000,000	155,907,600
愛知県 公募平成 2 6 年度第 8 回	100,000,000	126,170,000
愛知県 公募平成 2 6 年度第 1 3 回	100,000,000	114,203,000
愛知県 公募平成 2 6 年度第 1 7 回	300,000,000	304,893,000
愛知県 公募（ 1 5 年 ）平成 2 7 年度第 2 回	100,000,000	105,664,000
愛知県 公募平成 2 7 年度第 1 5 回	100,000,000	101,997,000
愛知県 公募平成 2 9 年度第 8 回	100,000,000	100,863,000
愛知県 公募平成 2 9 年度第 9 回	100,000,000	100,558,000
愛知県 公募平成 3 0 年度第 7 回	200,000,000	201,524,000
広島県 公募平成 2 4 年度第 4 回	100,000,000	101,149,000
広島県 公募平成 2 5 年度第 3 回	200,000,000	203,548,000
広島県 公募平成 2 6 年度第 5 回	109,650,000	110,881,369
広島県 公募平成 2 6 年度第 7 回	200,000,000	203,296,000

広島県	公募平成29年度第3回	100,000,000	100,561,000	
広島県	公募平成29年度第4回	211,300,000	213,463,712	
広島県	公募令和2年度第2回	100,000,000	100,584,000	
埼玉県	公募平成24年度第4回	300,000,000	302,715,000	
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	101,891,000	
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	150,650,680	
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	101,756,000	
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	101,765,000	
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	101,907,000	
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	203,522,000	
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	406,456,000	
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	101,505,000	
埼玉県	公募平成27年度第9回	100,000,000	101,005,000	
埼玉県	公募平成28年度第5回	100,000,000	100,025,000	
埼玉県	公募平成30年度第4回	200,000,000	201,878,000	
埼玉県	公募平成30年度第7回	200,000,000	200,022,000	
埼玉県	公募令和2年度第4回	300,000,000	301,068,000	
埼玉県	公募（15年）第1回	100,000,000	107,121,000	
埼玉県	公募（15年）第2回	200,000,000	213,600,000	
埼玉県	公募（15年）第3回	100,000,000	102,650,000	
埼玉県	公募（25年）第2回	200,000,000	209,980,000	
埼玉県	公募（30年）第9回	200,000,000	208,158,000	
埼玉県	公募（20年）第6回	100,000,000	115,761,000	
埼玉県	公募（20年）第16回	100,000,000	112,655,000	
埼玉県	公募（20年）第20回	100,000,000	103,920,000	
福岡県	公募平成26年度第1回	100,000,000	101,926,000	
福岡県	公募平成27年度第1回	300,000,000	306,696,000	
福岡県	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,867,000	
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	107,838,000	
福岡県	公募（15年）平成27年度第1回	200,000,000	212,482,000	
福岡県	公募（15年）令和元年度第1回	100,000,000	99,859,000	
福岡県	公募（30年）平成19年度第1回	100,000,000	135,113,000	
福岡県	公募（30年）平成26年度第1回	100,000,000	126,437,000	
福岡県	公募（30年・定時償還）平成29年度第2回	100,000,000	106,482,000	
福岡県	公募（20年）平成20年度第1回	300,000,000	346,722,000	
福岡県	公募（20年）平成20年度第2回	100,000,000	114,729,000	
福岡県	公募（20年）平成22年度第2回	300,000,000	357,426,000	

福岡県 公募（２０年）平成２４年度第２回	100,000,000	115,901,000	
千葉県 公募平成２４年度第７回	100,000,000	101,096,000	
千葉県 公募平成２４年度第８回	100,000,000	101,320,000	
千葉県 公募平成２５年度第３回	100,000,000	101,752,000	
千葉県 公募平成２５年度第４回	100,000,000	101,891,000	
千葉県 公募平成２６年度第１回	100,000,000	101,887,000	
千葉県 公募平成２６年度第３回	200,000,000	203,688,000	
千葉県 公募平成２７年度第６回	200,000,000	204,046,000	
千葉県 公募平成２８年度第４回	200,000,000	200,418,000	
千葉県 公募平成２９年度第４回	100,000,000	100,561,000	
千葉県 公募平成２９年度第８回	100,000,000	100,941,000	
千葉県 公募（２０年）第１回	400,000,000	436,640,000	
千葉県 公募（２０年）第８回	100,000,000	118,311,000	
千葉県 公募（２０年）第１６回	200,000,000	232,702,000	
千葉県 公募（２０年）第１７回	100,000,000	114,707,000	
長野県 公募令和３年度第１回	300,000,000	302,031,000	
群馬県 公募第１２回	100,000,000	102,066,000	
群馬県 公募（２０年）第３回	100,000,000	116,329,000	
岐阜県 公募平成２６年度第１回	186,670,000	189,966,592	
共同発行市場地方債 公募第１１２回	100,000,000	100,905,000	
共同発行市場地方債 公募第１１３回	800,000,000	807,144,000	
共同発行市場地方債 公募第１１４回	243,700,000	246,173,555	
共同発行市場地方債 公募第１１５回	100,000,000	101,061,000	
共同発行市場地方債 公募第１１６回	200,000,000	202,256,000	
共同発行市場地方債 公募第１１８回	100,000,000	101,320,000	
共同発行市場地方債 公募第１１９回	200,000,000	202,636,000	
共同発行市場地方債 公募第１２０回	300,000,000	303,498,000	
共同発行市場地方債 公募第１２１回	100,000,000	101,021,000	
共同発行市場地方債 公募第１２２回	400,000,000	404,652,000	
共同発行市場地方債 公募第１２４回	300,000,000	305,610,000	
共同発行市場地方債 公募第１２６回	100,000,000	101,796,000	
共同発行市場地方債 公募第１２８回	700,000,000	710,941,000	
共同発行市場地方債 公募第１２９回	100,000,000	101,743,000	
	100,000,000	101,932,000	

共同発行市場地方債 公募第 1 3 0 回			
共同発行市場地方債 公募第 1 3 2 回	100,000,000	101,777,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 3 6 回	200,000,000	203,688,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 3 7 回	500,000,000	508,745,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 3 9 回	155,000,000	157,740,400	
共同発行市場地方債 公募第 1 4 3 回	540,000,000	548,505,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 4 5 回	1,000,000,000	1,014,780,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 5 2 回	400,000,000	408,424,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 5 4 回	300,000,000	305,295,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 5 6 回	200,000,000	200,760,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 5 7 回	300,000,000	300,870,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 6 1 回	300,000,000	300,231,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 7 2 回	600,000,000	606,000,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 8 4 回	100,000,000	100,727,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 8 6 回	400,000,000	405,056,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 8 8 回	300,000,000	304,185,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 9 0 回	610,000,000	614,007,700	
共同発行市場地方債 公募第 1 9 1 回	100,000,000	100,522,000	
共同発行市場地方債 公募第 2 0 0 回	100,000,000	99,910,000	
共同発行市場地方債 公募第 2 1 3 回	300,000,000	300,279,000	
共同発行市場地方債 公募第 2 1 5 回	400,000,000	400,760,000	
堺市 公募平成 2 2 年度第 1 回	100,000,000	117,223,000	
堺市 公募平成 2 6 年度第 1 回	100,000,000	122,839,000	
島根県 公募（ 3 0 年 ）平成 2 9 年度第 1 回	100,000,000	106,213,000	
佐賀県 公募平成 2 8 年度第 1 回	100,000,000	100,189,000	
福島県 公募平成 2 6 年度第 1 回	200,000,000	203,294,000	
滋賀県 公募平成 2 5 年度第 1 回	100,000,000	101,548,000	
滋賀県 公募平成 2 6 年度第 1 回	142,000,000	144,338,740	
栃木県 公募平成 2 4 年度第 1 回	100,000,000	101,124,000	

栃木県	公募平成25年度第1回	100,000,000	101,548,000
熊本市	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,834,000
新潟市	公募平成25年度第1回	233,200,000	237,327,640
新潟市	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,972,000
浜松市	公募平成26年度第1回	100,000,000	101,138,000
大阪市	公募平成25年度第6回	100,000,000	101,642,000
大阪市	公募平成26年度第5回	100,000,000	101,890,000
大阪市	公募平成27年度第6回	100,000,000	101,995,000
大阪市	公募（15年）第1回	100,000,000	108,639,000
大阪市	公募（20年）第1回	300,000,000	342,855,000
大阪市	公募（20年）第5回	100,000,000	117,276,000
大阪市	公募（20年）第6回	100,000,000	115,922,000
大阪市	公募（20年）第17回	100,000,000	117,223,000
大阪市	公募（20年）第26回	100,000,000	104,001,000
名古屋市	公募第481回	100,000,000	101,099,000
名古屋市	公募第488回	300,000,000	305,685,000
名古屋市	公募第489回	100,000,000	101,556,000
名古屋市	公募第501回	200,000,000	201,436,000
名古屋市	公募第503回	100,000,000	100,975,000
名古屋市	公募第504回	200,000,000	202,020,000
名古屋市	公募第512回	300,000,000	301,200,000
名古屋市	公募（12年）第1回	200,000,000	208,080,000
名古屋市	公募（15年）第2回	100,000,000	106,882,000
京都市	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,922,000
京都市	公募平成29年度第4回	101,280,000	102,446,745
京都市	公募（20年）第2回	100,000,000	108,906,000
京都市	公募（20年）第5回	200,000,000	225,364,000
京都市	公募（20年）第6回	100,000,000	114,423,000
京都市	公募（20年）第13回	100,000,000	114,178,000
京都市	公募（20年）第15回	200,000,000	204,008,000
神戸市	公募平成26年度第17回	300,000,000	302,829,000
神戸市	公募平成28年度第1回	200,000,000	200,576,000
神戸市	公募平成30年度第2回	200,000,000	208,158,000
横浜市	公募公債平成24年度2回	200,000,000	202,128,000
横浜市	公募公債平成25年度1回	200,000,000	202,474,000
横浜市	公募公債平成25年度5回	200,000,000	203,078,000
横浜市	公募公債平成26年度5回	200,000,000	203,166,000
横浜市	公募平成28年度第5回	300,000,000	302,964,000
横浜市	公募平成29年度第3回	100,000,000	100,979,000
横浜市	公募（30年）第2回	200,000,000	259,006,000
横浜市	公募（20年）第18回	100,000,000	116,868,000
横浜市	公募（20年）第26回	100,000,000	117,936,000
横浜市	公募（20年）第30回	100,000,000	114,378,000

	札幌市 公募（１５年）平成２３年度第９回	200,000,000	216,184,000	
	札幌市 公募（２０年）平成２４年度第１回	100,000,000	117,173,000	
	札幌市 公募（２０年）平成２４年度第１１回	100,000,000	118,205,000	
	札幌市 公募平成２６年度第４回	100,000,000	101,574,000	
	札幌市 公募平成２６年度第９回	200,000,000	202,896,000	
	川崎市 公募第８５回	100,000,000	101,063,000	
	川崎市 公募（２０年）第１７回	100,000,000	115,261,000	
	川崎市 公募（２０年）第１９回	100,000,000	114,118,000	
	川崎市 公募（３０年）第１１回	100,000,000	103,443,000	
	北九州市 公募（１０年）令和２年度第２回	200,000,000	199,998,000	
	北九州市 公募（２０年）第３回	200,000,000	228,130,000	
	北九州市 公募（２０年）第１４回	100,000,000	117,124,000	
	福岡市 公募（２０年）平成２１年度第３回	200,000,000	233,742,000	
	福岡市 公募（２０年）平成２３年度第４回	100,000,000	117,409,000	
	福岡市 公募平成２６年度第２回	100,000,000	115,613,000	
	福岡市 公募平成２６年度第５回	100,000,000	101,756,000	
	福岡市 公募平成２６年度第８回	160,000,000	162,665,600	
	広島市 公募平成２６年度第２回	100,000,000	101,544,000	
	広島市 公募平成２７年度第２回	500,000,000	510,000,000	
	広島市 公募（１０年）平成３０年度第６回	241,000,000	242,368,880	
	千葉市 公募平成２６年度第２回	200,000,000	203,362,000	
	三重県 公募平成２４年度第１回	140,660,000	142,155,215	
	三重県 公募平成２８年度第１回	155,000,000	155,936,200	
	福井県 公募平成２４年度第４回	100,000,000	100,820,000	
	福井県 公募平成２７年度第４回	200,000,000	200,628,000	
	徳島県 公募平成２９年度第２回	200,000,000	201,668,000	
	山梨県 公募平成２４年度第１回	200,000,000	202,136,000	
	岡山県 公募平成２８年度第２回	168,900,000	170,357,607	
	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第９６回	100,000,000	115,512,000	
	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第１０２回	300,000,000	351,393,000	
	福岡北九州高速道路債券 第１１７回	100,000,000	115,007,000	
	福岡北九州高速道路債券 第１３６回	100,000,000	105,086,000	
小計	銘柄数：２９６	51,656,100,000	54,077,815,068	
	組入時価比率：６.９％		７.０％	
合計			54,077,815,068	

特殊債券	日本円	フランス預金供託公庫 第4回円貨債券（2014）	100,000,000	101,698,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	152,461,680	
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	194,353,960	
		新関西国際空港債券 政府保証第5回	117,000,000	117,808,470	
		新関西国際空港社債 財投機関債第6回	300,000,000	328,404,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第9回	100,000,000	108,177,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	107,472,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第22回	200,000,000	199,974,000	
		原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券 政府保証第16回	300,000,000	299,934,000	
		日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	104,402,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000	302,886,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	107,408,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第78回	200,000,000	201,560,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第82回	100,000,000	101,084,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000	302,727,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第96回	200,000,000	201,314,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第137回	400,000,000	399,808,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000	103,060,800	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	159,000,000	160,863,480	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第37回	400,000,000	401,312,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第38回	1,500,000,000	1,500,315,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	300,000,000	302,523,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第52回	300,000,000	299,820,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第55回	300,000,000	301,503,000	
		道路債券 財投機関債第17回	300,000,000	306,867,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第4回	100,000,000	131,448,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第8回	200,000,000	222,806,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 7 回	100,000,000	111,850,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 2 3 回	300,000,000	341,712,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 3 3 回	200,000,000	305,802,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 3 9 回	200,000,000	232,594,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 4 7 回	100,000,000	117,901,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 8 9 回	100,000,000	116,121,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 0 0 回	200,000,000	202,316,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 0 2 回	100,000,000	101,134,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 0 3 回	350,000,000	408,170,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 0 5 回	100,000,000	118,482,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 0 7 回	100,000,000	101,834,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 1 6 回	400,000,000	406,260,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 2 2 回	100,000,000	101,859,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 2 3 回	100,000,000	101,820,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 3 0 回	200,000,000	203,208,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 3 4 回	200,000,000	203,022,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 3 6 回	200,000,000	203,592,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 4 5 回	300,000,000	355,197,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 4 9 回	100,000,000	120,089,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 5 7 回	100,000,000	106,370,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 6 4 回	100,000,000	111,057,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 7 3 回	100,000,000	91,976,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 8 8 回	100,000,000	103,103,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 2 6 0 回	200,000,000	195,250,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第 9 0 回	100,000,000	116,838,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第 9 2 回	200,000,000	233,938,000	
	200,000,000	234,474,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回	200,000,000	236,476,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回	200,000,000	235,650,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	200,000,000	232,922,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	100,000,000	129,854,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回	100,000,000	125,810,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回	100,000,000	100,940,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回	100,000,000	115,889,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	218,000,000	220,121,140	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	100,000,000	115,198,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回	300,000,000	383,043,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第173回	200,000,000	202,126,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回	200,000,000	202,192,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第180回	200,000,000	202,272,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	900,000,000	912,276,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回	100,000,000	117,448,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回	196,000,000	197,995,280	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回	400,000,000	404,768,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回	1,000,000,000	1,017,630,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回	272,000,000	276,917,760	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	300,000,000	305,157,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第211回	137,000,000	139,393,390	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	145,000,000	147,547,650	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第216回	100,000,000	115,573,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第217回	100,000,000	124,326,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第219回	100,000,000	115,617,000	
	300,000,000	305,697,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第224回	100,000,000	124,449,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回	190,000,000	193,283,200	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第229回	630,000,000	641,088,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回	100,000,000	101,581,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第239回	500,000,000	558,690,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第241回	200,000,000	203,234,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第258回	400,000,000	406,376,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第261回	401,000,000	407,416,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第271回	151,000,000	150,998,490	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第297回	100,000,000	100,330,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第306回	403,000,000	405,784,730	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第315回	100,000,000	100,631,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第321回	600,000,000	604,818,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第324回	100,000,000	100,407,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第335回	100,000,000	104,173,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第339回	500,000,000	505,675,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第342回	131,000,000	132,062,410	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第351回	100,000,000	100,766,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第354回	200,000,000	201,314,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第357回	100,000,000	101,220,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第13回	130,000,000	133,680,300	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第28回	400,000,000	525,116,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第33回	100,000,000	133,160,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第38回	1,000,000,000	1,072,360,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	133,223,000	
	100,000,000	114,621,000	

地方公営企業等金融機構債券（20年）第1回			
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	100,000,000	116,911,000	
地方公共団体金融機構債券 F16回	100,000,000	110,834,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	300,000,000	355,260,000	
地方公共団体金融機構債券 F24回	100,000,000	102,889,000	
地方公共団体金融機構債券（20年）第10回	300,000,000	344,019,000	
地方公共団体金融機構債券 F104回	100,000,000	104,754,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	103,378,000	
地方公共団体金融機構債券 F122回	100,000,000	107,941,000	
地方公共団体金融機構債券 F124回	100,000,000	107,926,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第38回	194,000,000	195,759,580	
地方公共団体金融機構債券 F132回	500,000,000	521,715,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第39回	100,000,000	100,937,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第40回	101,000,000	102,041,310	
政保 地方公共団体金融機構債券第41回	102,000,000	103,088,340	
地方公共団体金融機構債券 第41回	600,000,000	606,414,000	
地方公共団体金融機構債券 F142回	100,000,000	103,401,000	
地方公共団体金融機構債券 F145回	200,000,000	207,682,000	
地方公共団体金融機構債券 F147回	100,000,000	106,920,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第42回	108,000,000	109,237,680	
地方公共団体金融機構債券 第42回	100,000,000	101,136,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第43回	202,000,000	204,246,240	
政保 地方公共団体金融機構債券第44回	145,000,000	146,941,550	
地方公共団体金融機構債券 第44回	100,000,000	101,246,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第45回	223,000,000	226,055,100	
地方公共団体金融機構債券 F160回	100,000,000	106,623,000	
	500,000,000	505,835,000	

政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 8 回			
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 9 回	13,000,000	13,229,840	
地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年 ） 第 2 9 回	100,000,000	117,270,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 0 回	100,000,000	101,856,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 1 回	600,000,000	610,686,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 2 回	300,000,000	305,298,000	
地方公共団体金融機構債券（ 1 5 年 ） 第 2 回	200,000,000	215,766,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 6 回	591,000,000	602,229,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 9 回	116,000,000	118,144,840	
地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年 ） 第 3 8 回	100,000,000	115,112,000	
地方公共団体金融機構債券 F 2 4 0 回	300,000,000	324,360,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	101,709,000	
地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	101,794,000	
地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年 ） 第 3 9 回	100,000,000	114,433,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 5 回	400,000,000	406,956,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 9 回	320,000,000	324,617,600	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 2 回	189,000,000	192,609,900	
地方公共団体金融機構債券 第 7 4 回	300,000,000	305,997,000	
地方公共団体金融機構債券 第 7 7 回	100,000,000	102,003,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 8 回	509,000,000	517,093,100	
地方公共団体金融機構債券 第 7 9 回	400,000,000	408,184,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 （ 8 年 ） 第 5 回	500,000,000	502,120,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 8 3 回	116,000,000	115,998,840	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 9 1 回	300,000,000	300,984,000	
地方公共団体金融機構債券 第 9 5 回	200,000,000	201,396,000	
地方公共団体金融機構債券 第 1 0 1 回	400,000,000	403,788,000	
	157,000,000	158,298,390	

政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 0 8 回			
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 0 回	100,000,000	100,659,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 3 回	110,000,000	111,436,600	
公営企業債券（ 2 0 年 ） 第 2 回財 投機関債	100,000,000	102,155,000	
公営企業債券（ 2 0 年 ） 第 5 回財 投機関債	200,000,000	209,364,000	
公営企業債券（ 2 0 年 ） 第 1 9 回 財投機関債	100,000,000	112,552,000	
公営企業債券（ 2 0 年 ） 第 2 0 回 財投機関債	100,000,000	112,431,000	
公営企業債券（ 2 0 年 ） 第 2 4 回 財投機関債	100,000,000	114,962,000	
公営企業債券（ 2 0 年 ） 第 2 5 回 財投機関債	100,000,000	116,716,000	
都市再生債券 財投機関債第 9 6 回	200,000,000	203,696,000	
都市再生債券 財投機関債第 9 7 回	100,000,000	107,327,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 0 1 回	100,000,000	106,740,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 0 9 回	100,000,000	106,913,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 1 3 回	300,000,000	319,329,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 2 1 回	200,000,000	206,130,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 2 7 回	100,000,000	99,973,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第 7 回	100,000,000	108,764,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第 1 6 回	360,000,000	365,774,400	
東京交通債券 第 3 4 7 回	157,000,000	165,518,820	
関西国際空港債券 政府保証第 5 4 回	300,000,000	349,818,000	
中部国際空港債券 政府保証第 1 8 回	368,000,000	372,357,120	
中部国際空港債券 政府保証第 2 2 回	300,000,000	299,925,000	
預金保険機構債券 政府保証第 2 3 0 回	600,000,000	601,608,000	
預金保険機構債券 政府保証第 2 3 1 回	300,000,000	300,843,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 3 回	400,000,000	449,576,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 6 回	200,000,000	228,242,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 1 8 回	100,000,000	104,772,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 4 2 回	100,000,000	107,112,000	

住宅金融支援機構債券 財投機関債 第49回	100,000,000	117,547,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第59回	100,000,000	116,629,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第75回	100,000,000	118,600,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第77回	300,000,000	325,578,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	118,582,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第85回	200,000,000	233,654,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	216,506,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第120回	100,000,000	117,955,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第123回	100,000,000	117,399,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	132,783,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第132回	200,000,000	213,346,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第137回	100,000,000	108,444,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第143回	100,000,000	107,909,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回	250,000,000	254,977,500	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第188回	300,000,000	300,732,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第198回	300,000,000	301,146,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第223回	100,000,000	101,855,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第244回	130,000,000	131,576,900	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第301回	300,000,000	299,997,000	
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	202,544,000	
成田国際空港 第17回	400,000,000	406,284,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第6回	200,000,000	215,990,000	
商工債券 利付第806回い号	300,000,000	300,228,000	
商工債券 利付第811回い号	300,000,000	300,636,000	
商工債券 利付第815回い号	100,000,000	100,239,000	
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	100,261,000	
商工債券 利付第819回い号	300,000,000	300,879,000	
商工債券 利付第829回い号	200,000,000	200,336,000	
商工債券 利付第831回い号	200,000,000	200,038,000	
商工債券 利付第833回い号	100,000,000	99,868,000	

商工債券 利付第 8 4 5 回い号	300,000,000	300,258,000
しんきん中金債券 利付第 3 3 5 回	200,000,000	200,190,000
しんきん中金債券 利付第 3 7 4 回	300,000,000	299,928,000
商工債券 利付（ 3 年 ）第 2 3 6 回	500,000,000	499,940,000
商工債券 利付（ 1 0 年 ）第 1 5 回	200,000,000	203,210,000
国際協力機構債券 第 6 回財投機関債	200,000,000	236,528,000
東日本高速道路 第 6 1 回	200,000,000	199,918,000
中日本高速道路 第 6 3 回	100,000,000	102,262,000
中日本高速道路 第 7 9 回	300,000,000	299,961,000
西日本高速道路 第 2 0 回	200,000,000	203,250,000
西日本高速道路 第 2 2 回	400,000,000	407,648,000
西日本高速道路 第 2 3 回	100,000,000	101,668,000
西日本高速道路 第 3 0 回	300,000,000	301,617,000
西日本高速道路 第 5 0 回	200,000,000	199,976,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 5 7 回	300,000,000	304,905,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 2 回	100,000,000	101,718,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 8 回	200,000,000	203,472,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 9 回	100,000,000	114,551,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 7 1 回	500,000,000	508,485,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 9 0 回	300,000,000	300,570,000
貸付債権担保第 1 9 回住宅金融公庫債券	52,500,000	52,969,875
貸付債権担保第 5 回 S 種住宅金融公庫債券	30,885,000	31,035,409
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融公庫債券	34,587,000	35,421,930
貸付債権担保第 7 回 S 種住宅金融公庫債券	10,757,000	10,898,777
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融公庫債券	23,600,000	24,074,124
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融公庫債券	26,994,000	28,046,226
貸付債権担保第 1 5 回住宅金融公庫債券	29,988,000	30,089,059
貸付債権担保第 3 2 回住宅金融公庫債券	48,788,000	49,866,214
貸付債権担保第 2 0 回住宅金融公庫債券	52,545,000	53,129,825
貸付債権担保第 4 4 回住宅金融公庫債券	46,696,000	47,808,765
貸付債権担保第 8 回住宅金融支援機構債券	76,452,000	78,441,281
	13,083,000	13,526,775

貸付債権担保第 7 回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第 2 5 回住宅金融支援機構債券	19,907,000	21,298,499	
貸付債権担保第 2 8 回住宅金融支援機構債券	65,361,000	69,572,209	
貸付債権担保 S 種第 1 6 回住宅金融支援機構債券	10,886,000	10,977,006	
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融支援機構債券	61,902,000	65,118,427	
貸付債権担保 S 種第 1 7 回住宅金融支援機構債券	21,882,000	22,078,938	
貸付債権担保第 4 5 回住宅金融支援機構債券	74,559,000	78,844,651	
貸付債権担保第 5 2 回住宅金融支援機構債券	60,982,000	64,251,854	
貸付債権担保第 2 4 回住宅金融支援機構債券	35,746,000	38,025,522	
貸付債権担保第 4 8 回住宅金融支援機構債券	71,673,000	75,780,579	
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融支援機構債券	78,606,000	82,088,245	
貸付債権担保第 6 2 回住宅金融支援機構債券	121,455,000	127,294,556	
貸付債権担保第 6 0 回住宅金融支援機構債券	116,670,000	122,836,009	
貸付債権担保第 6 1 回住宅金融支援機構債券	75,748,000	79,465,711	
貸付債権担保第 5 1 回住宅金融支援機構債券	27,907,000	29,435,187	
貸付債権担保第 4 3 回住宅金融支援機構債券	60,934,000	64,542,511	
貸付債権担保第 7 9 回住宅金融支援機構債券	39,171,000	40,825,974	
貸付債権担保第 8 1 回住宅金融支援機構債券	85,416,000	89,091,450	
貸付債権担保第 7 2 回住宅金融支援機構債券	38,021,000	39,628,147	
貸付債権担保第 2 2 回住宅金融公庫債券	21,704,000	21,941,224	
貸付債権担保第 7 0 回住宅金融支援機構債券	114,609,000	120,291,314	
貸付債権担保第 3 3 回住宅金融支援機構債券	24,469,000	26,089,092	
貸付債権担保第 3 4 回住宅金融支援機構債券	26,311,000	28,093,833	
貸付債権担保第 3 5 回住宅金融支援機構債券	24,482,000	26,009,187	
貸付債権担保第 4 6 回住宅金融支援機構債券	24,781,000	26,273,559	
貸付債権担保第 5 5 回住宅金融支援機構債券	75,168,000	79,371,394	
	106,806,000	112,587,408	

貸付債権担保第 5 6 回住宅金融支援 機構債券			
貸付債権担保第 5 7 回住宅金融支援 機構債券	35,503,000	37,453,534	
貸付債権担保第 7 6 回住宅金融支援 機構債券	74,752,000	78,293,002	
貸付債権担保 5 種第 3 回住宅金融公 庫債券	9,935,000	9,975,236	
貸付債権担保第 2 3 回住宅金融支援 機構債券	70,488,000	74,711,640	
貸付債権担保第 3 2 回住宅金融支援 機構債券	70,986,000	75,402,039	
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融支援 機構債券	129,140,000	135,509,184	
貸付債権担保第 5 8 回住宅金融支援 機構債券	78,506,000	82,866,223	
貸付債権担保第 6 4 回住宅金融支援 機構債券	128,502,000	134,554,444	
貸付債権担保第 7 1 回住宅金融支援 機構債券	111,717,000	116,357,724	
貸付債権担保第 7 3 回住宅金融支援 機構債券	87,288,000	92,070,509	
貸付債権担保第 7 5 回住宅金融支援 機構債券	73,772,000	77,448,796	
貸付債権担保第 8 3 回住宅金融支援 機構債券	180,220,000	187,814,470	
貸付債権担保第 8 4 回住宅金融支援 機構債券	310,429,000	323,063,460	
貸付債権担保第 8 8 回住宅金融支援 機構債券	47,664,000	49,451,876	
貸付債権担保第 8 9 回住宅金融支援 機構債券	49,276,000	51,185,445	
貸付債権担保第 9 0 回住宅金融支援 機構債券	50,593,000	52,363,249	
貸付債権担保第 9 2 回住宅金融支援 機構債券	106,204,000	109,232,938	
貸付債権担保第 9 3 回住宅金融支援 機構債券	112,254,000	114,619,191	
貸付債権担保第 9 4 回住宅金融支援 機構債券	59,014,000	60,901,267	
貸付債権担保第 9 6 回住宅金融支援 機構債券	62,825,000	64,665,772	
貸付債権担保第 9 7 回住宅金融支援 機構債券	187,473,000	193,899,574	
貸付債権担保第 9 8 回住宅金融支援 機構債券	193,491,000	200,915,249	
貸付債権担保第 9 9 回住宅金融支援 機構債券	130,024,000	134,877,795	
貸付債権担保第 1 0 0 回住宅金融支 援機構債券	63,042,000	65,262,339	
貸付債権担保第 1 0 1 回住宅金融支 援機構債券	63,938,000	66,367,004	
	239,148,000	241,572,960	

貸付債権担保第 1 1 5 回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第 1 1 6 回住宅金融支援機構債券	159,854,000	162,179,875	
貸付債権担保第 1 1 7 回住宅金融支援機構債券	161,506,000	163,613,653	
貸付債権担保第 1 1 8 回住宅金融支援機構債券	80,648,000	81,757,716	
貸付債権担保第 1 1 9 回住宅金融支援機構債券	160,916,000	163,025,608	
貸付債権担保第 1 2 0 回住宅金融支援機構債券	81,254,000	82,091,728	
貸付債権担保第 1 2 1 回住宅金融支援機構債券	81,779,000	82,773,432	
貸付債権担保第 1 2 3 回住宅金融支援機構債券	83,078,000	84,239,430	
貸付債権担保第 1 2 5 回住宅金融支援機構債券	332,840,000	336,584,450	
貸付債権担保第 1 2 6 回住宅金融支援機構債券	250,992,000	253,961,235	
貸付債権担保第 1 2 8 回住宅金融支援機構債券	167,414,000	169,278,991	
貸付債権担保第 1 2 9 回住宅金融支援機構債券	170,452,000	172,775,260	
貸付債権担保第 1 3 4 回住宅金融支援機構債券	173,164,000	174,748,450	
貸付債権担保第 1 3 5 回住宅金融支援機構債券	87,072,000	87,860,872	
貸付債権担保第 1 3 6 回住宅金融支援機構債券	87,780,000	88,907,095	
貸付債権担保第 1 4 0 回住宅金融支援機構債券	88,166,000	88,944,505	
貸付債権担保第 1 4 2 回住宅金融支援機構債券	270,828,000	272,098,183	
貸付債権担保第 1 4 4 回住宅金融支援機構債券	270,327,000	271,740,810	
貸付債権担保第 1 5 0 回住宅金融支援機構債券	466,070,000	464,420,112	
貸付債権担保第 1 5 2 回住宅金融支援機構債券	188,254,000	189,293,162	
貸付債権担保第 1 5 4 回住宅金融支援機構債券	190,136,000	190,693,098	
貸付債権担保第 1 6 4 回住宅金融支援機構債券	295,431,000	296,905,200	
貸付債権担保第 1 6 5 回住宅金融支援機構債券	197,510,000	198,995,275	
貸付債権担保第 1 6 6 回住宅金融支援機構債券	297,210,000	300,809,213	
貸付債権担保第 1 6 7 回住宅金融支援機構債券	198,860,000	201,238,365	
貸付債権担保第 1 6 8 回住宅金融支援機構債券	199,722,000	201,932,922	
	300,000,000	303,039,000	

	小計	貸付債権担保第 1 6 9 回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第 1 7 0 回住宅金融支援機構債券	500,000,000	501,900,000	
		銘柄数：326	62,134,478,000	64,903,411,696	
		組入時価比率：8.3%		8.3%	
		合計		64,903,411,696	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）第 2 9 回円貨社債	200,000,000	199,794,000	
		フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）第 3 1 回円貨社債	100,000,000	99,763,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第 1 4 回円貨社債	100,000,000	100,271,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第 6 回円貨社債（ 2 0 1 4 ）	100,000,000	102,001,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第 1 5 回円貨社債（ 2 0 1 8 ）	100,000,000	99,865,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第 1 6 回円貨社債（ 2 0 1 8 ）	100,000,000	100,231,000	
		スタンダード・チャータード 第 3 回円貨社債（ 2 0 1 5 ）	100,000,000	100,591,000	
		エイチエスビーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第 2 回円	100,000,000	101,050,000	
		エイチエスビーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第 3 回円	100,000,000	102,653,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第 6 回円貨社債	100,000,000	100,535,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第 7 回円貨社債	100,000,000	100,955,000	
		サンタンデール銀行 第 1 回円貨社債	100,000,000	100,308,000	
		フランス電力 第 4 回円貨社債（ 2 0 1 7 ）	100,000,000	102,987,000	
		現代キャピタル・サービス・インク 第 1 5 回円貨社債	200,000,000	198,166,000	
		ビー・エヌ・ピー・パリバ 第 1 回円貨社債（ 2 0 1 7 ）	100,000,000	101,168,000	
		ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第 1 2 回円貨社	200,000,000	199,860,000	
		オーストラリア・ニュージーランド銀行 第 1 0 回円貨社債	200,000,000	200,346,000	
		ＩＮＰＥＸ 第 1 回社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,528,000	
		長谷工コーポレーション 第 1 4 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,636,000	
		大和ハウス工業 第 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,716,000	
		日揮ホールディングス 第 6 回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,736,000	
		明治ホールディングス 第 1 0 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,828,000	

アサヒグループホールディングス 第16回特定社債間限定同順位	300,000,000	299,889,000	
味の素 第24回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,338,000	
日本たばこ産業 第13回	100,000,000	100,641,000	
三越伊勢丹ホールディングス 第6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,616,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	101,151,000	
森ヒルズリート投資法人 第17回 特定投資法人債間限定同順位特	200,000,000	198,150,000	
森ビル 第23回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	99,728,000	
セブン＆アイ・ホールディングス 第13回社債間限定同順位特約	100,000,000	99,976,000	
セブン＆アイ・ホールディングス 第14回社債間限定同順位特約	600,000,000	602,478,000	
セブン＆アイ・ホールディングス 第15回社債間限定同順位特約	200,000,000	201,558,000	
東レ 第30回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	100,566,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	100,403,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	199,304,000	
王子ホールディングス 第34回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	101,012,000	
王子ホールディングス 第42回社 債間限定同順位特約付	600,000,000	600,348,000	
住友化学 第56回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,589,000	
三井化学 第48回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,245,000	
三菱ケミカルホールディングス 第 29回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,554,000	
三菱ケミカルホールディングス 第 37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,045,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約 付	100,000,000	100,573,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	100,043,000	
オリエンタルランド 第16回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	100,117,000	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	99,843,000	
ヤフー 第12回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	99,411,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	97,963,000	
ブリヂストン 第11回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,440,000	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順 位特約付	300,000,000	299,814,000	

ジェイ エフ イー ホールディングス 第 2 8 回社債間限定同順	100,000,000	99,404,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第 3 4 回社債間限定同順	100,000,000	100,092,000	
住友電気工業 第 2 6 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,018,000	
ＬＩＸＩＬグループ 第 1 1 回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,601,000	
荏原製作所 第 1 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,925,000	
日立製作所 第 1 7 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	216,064,000	
日本電気 第 4 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,539,000	
パナソニック 第 1 7 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,030,000	
パナソニック 第 2 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,951,000	
パナソニック 第 2 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,212,000	
パナソニック 第 2 2 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,106,000	
ソニー 第 3 2 回	100,000,000	100,358,000	
東海理化電機製作所 第 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,659,000	
三菱重工業 第 3 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,151,000	
ＪＡ三井リース 第 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,528,000	
三井住友トラスト・パナソニックファイナンス 第 2 回社債間限定	100,000,000	100,159,000	
トヨタ自動車 第 1 4 回社債間限定同等特約付	100,000,000	101,624,000	
トヨタ自動車 第 2 6 回社債間限定同順位特約付	700,000,000	700,329,000	
トヨタ自動車 第 2 7 回社債間限定同順位特約付	300,000,000	301,116,000	
楽天カード 第 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,609,000	
ドンキホーテホールディングス 第 1 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,560,000	
ニコン 第 2 2 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,856,000	
丸紅 第 1 1 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,017,000	
豊田通商 第 1 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,720,000	
豊田通商 第 1 9 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	207,662,000	
三井物産 第 7 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,658,000	
住友商事 第 4 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,583,000	

住友商事 第 5 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,579,000	
クレディセゾン 第 5 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,218,000	
クレディセゾン 第 6 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,942,000	
イオン 第 2 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,904,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 第 1 回劣後特約付	100,000,000	101,591,000	
りそなホールディングス 第 2 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,133,000	
三井住友トラスト・ホールディングス 第 2 回劣後特約付	200,000,000	203,084,000	
みずほコーポレート銀行 第 8 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,763,000	
東京三菱銀行 第 5 7 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,896,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第 1 回劣後特約付	300,000,000	304,041,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第 3 回劣後特約付	100,000,000	101,611,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第 4 回劣後特約付	100,000,000	105,206,000	
三井住友信託銀行 第 1 回劣後特約付	300,000,000	304,353,000	
三井住友信託銀行 第 1 8 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,930,000	
セブン銀行 第 1 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,217,000	
セブン銀行 第 1 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,321,000	
セブン銀行 第 1 2 回社債間限定同順位特約付	300,000,000	303,162,000	
みずほフィナンシャルグループ 第 1 回劣後特約付	200,000,000	202,746,000	
みずほ銀行 第 7 回劣後特約付	100,000,000	112,066,000	
芙蓉総合リース 第 2 6 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,560,000	
みずほリース 第 3 回社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,882,000	
みずほリース 第 7 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,596,000	
ＮＴＴファイナンス 第 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,718,000	
ＮＴＴファイナンス 第 1 8 回日本電信電話保証付	200,000,000	202,382,000	
トヨタファイナンス 第 8 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,626,000	
トヨタファイナンス 第 9 6 回社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,069,000	
リコーリース 第 2 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,607,000	

アコム 第77回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,043,000	
ジャックス 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,189,000	
日立キャピタル 第61回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,752,000	
日立キャピタル 第80回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,889,000	
三井住友ファイナンス&リース 第27回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,299,000	
三菱ＵＦＪリース 第52回社債間限定同順位特約付	300,000,000	303,351,000	
三菱ＵＦＪリース 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,597,000	
三菱ＵＦＪリース 第76回社債間限定同順位特約付	300,000,000	301,794,000	
大和証券グループ本社 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,460,000	
三井不動産 第71回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,542,000	
三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	100,424,000	
東京建物 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,513,000	
ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,912,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,780,000	
日本ビルファンド投資法人 第13回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	101,808,000	
野村不動産オフィスファンド投資法人 第7回特定投資法人債間限	100,000,000	115,010,000	
積水ハウス・ＳＩレジデンシャル投資法人 第5回特定投資法人債	100,000,000	101,786,000	
東武鉄道 第124回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,688,000	
相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付	200,000,000	202,636,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,989,000	
東京急行電鉄 第83回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,172,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	214,824,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,735,000	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	200,000,000	232,920,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,727,000	
東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,276,000	
	100,000,000	114,009,000	

東日本旅客鉄道 第 1 0 7 回社債間 限定同順位特約付			
東日本旅客鉄道 第 1 3 3 回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	107,114,000	
東日本旅客鉄道 第 1 4 5 回社債間 限定同順位特約付	200,000,000	184,952,000	
西日本旅客鉄道 第 1 3 回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	112,490,000	
西日本旅客鉄道 第 1 5 回社債間限 定同順位特約付	300,000,000	341,172,000	
西日本旅客鉄道 第 6 5 回社債間限 定同順位特約付	200,000,000	201,082,000	
西日本旅客鉄道 第 6 6 回社債間限 定同順位特約付	200,000,000	202,734,000	
東海旅客鉄道 第 1 7 回社債間限定 同順位特約付	200,000,000	214,010,000	
東海旅客鉄道 第 5 1 回社債間限定 同順位特約付	200,000,000	235,370,000	
東海旅客鉄道 第 7 0 回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	110,935,000	
東海旅客鉄道 第 7 3 回社債間限定 同順位特約付	300,000,000	323,091,000	
東海旅客鉄道 第 7 4 回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	119,521,000	
東京地下鉄 第 2 2 回	100,000,000	100,565,000	
東京地下鉄 第 2 3 回	100,000,000	102,837,000	
東京地下鉄 第 2 4 回	100,000,000	105,505,000	
西武ホールディングス 第 1 回社債 間限定同順位特約付	200,000,000	201,090,000	
西日本鉄道 第 4 5 回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	103,607,000	
阪急阪神ホールディングス 第 4 7 回	400,000,000	430,864,000	
阪急阪神ホールディングス 第 4 9 回	100,000,000	103,677,000	
名古屋鉄道 第 5 0 回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	103,752,000	
日本通運 第 1 1 回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,759,000	
日本通運 第 1 2 回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,940,000	
日本郵船 第 3 2 回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	109,228,000	
横浜高速鉄道 第 2 回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,930,000	
九州旅客鉄道 第 2 回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	201,836,000	
九州旅客鉄道 第 4 回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	98,536,000	
A N A ホールディングス 第 3 2 回 社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,400,000	
澁澤倉庫 第 8 回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	99,473,000	

K D D I 第 2 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,675,000	
K D D I 第 2 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,697,000	
東京電力 第 5 4 8 回	100,000,000	111,244,000	
東京電力 第 5 6 0 回	100,000,000	110,459,000	
中部電力 第 5 0 0 回	200,000,000	204,696,000	
中部電力 第 5 2 4 回	100,000,000	101,319,000	
中部電力 第 5 3 0 回	200,000,000	200,848,000	
関西電力 第 5 0 9 回	100,000,000	101,610,000	
関西電力 第 5 1 1 回	100,000,000	101,200,000	
関西電力 第 5 2 7 回	200,000,000	201,078,000	
関西電力 第 5 3 5 回	200,000,000	200,400,000	
中国電力 第 3 7 7 回	100,000,000	102,294,000	
中国電力 第 4 0 0 回	100,000,000	100,958,000	
中国電力 第 4 0 2 回	100,000,000	100,568,000	
北陸電力 第 3 0 1 回	100,000,000	101,905,000	
北陸電力 第 3 0 7 回	100,000,000	104,551,000	
北陸電力 第 3 0 8 回	100,000,000	102,227,000	
北陸電力 第 3 2 6 回	100,000,000	102,286,000	
東北電力 第 4 7 5 回	100,000,000	102,357,000	
東北電力 第 4 8 1 回	200,000,000	205,596,000	
東北電力 第 4 8 4 回	100,000,000	103,445,000	
東北電力 第 4 9 1 回	100,000,000	101,434,000	
東北電力 第 5 2 1 回	300,000,000	304,575,000	
四国電力 第 2 8 1 回	100,000,000	102,349,000	
九州電力 第 4 2 4 回	100,000,000	102,790,000	
九州電力 第 4 2 8 回	105,000,000	107,757,300	
九州電力 第 4 4 9 回	200,000,000	203,062,000	
九州電力 第 4 5 1 回	100,000,000	101,642,000	
九州電力 第 4 7 6 回	100,000,000	101,516,000	
九州電力 第 4 8 1 回	300,000,000	301,998,000	
九州電力 第 4 8 4 回	200,000,000	201,798,000	
北海道電力 第 3 2 1 回	100,000,000	102,728,000	
北海道電力 第 3 2 3 回	100,000,000	108,812,000	
北海道電力 第 3 3 8 回	100,000,000	104,047,000	
北海道電力 第 3 4 5 回	300,000,000	301,665,000	
電源開発 第 4 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,401,000	
電源開発 第 4 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,180,000	
電源開発 第 5 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,421,000	
電源開発 第 5 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,391,000	

		東京電力パワーグリッド 第 6 回	100,000,000	102,418,000	
		東京電力パワーグリッド 第 1 1 回	300,000,000	305,478,000	
		東京電力パワーグリッド 第 1 4 回	100,000,000	100,532,000	
		東京電力パワーグリッド 第 2 8 回	100,000,000	103,000,000	
		東京電力パワーグリッド 第 3 5 回	100,000,000	104,566,000	
		東京電力パワーグリッド 第 3 8 回	400,000,000	404,708,000	
		東京電力パワーグリッド 第 4 0 回	400,000,000	424,044,000	
		東京瓦斯 第 3 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	125,438,000	
		東京瓦斯 第 5 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,919,000	
		大阪瓦斯 第 3 6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,194,000	
		大阪瓦斯 第 4 3 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,046,000	
		北海道瓦斯 第 1 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,299,000	
		北海道瓦斯 第 2 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,076,000	
		広島ガス 第 1 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,036,000	
		東京都競馬 第 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,870,000	
		ファーストリテイリング 第 7 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,588,000	
		ソフトバンクグループ 第 5 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,291,000	
	小計	銘柄数：213	31,505,000,000	32,166,594,300	
		組入時価比率：4.1%		4.1%	
	合計			32,166,594,300	
合計				777,810,228,964	

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

第 2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2021年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	309,817,105
コール・ローン	1,692,510,437
国債証券	583,284,892,024
派生商品評価勘定	4,900,035
未収利息	4,860,745,059

前払費用	247,002,769
その他未収収益	8,832,530
流動資産合計	590,408,699,959
資産合計	590,408,699,959
負債の部	
流動負債	
未払金	1,693,990,079
未払解約金	151,791,155
未払利息	1,484
その他未払費用	3,940,945
流動負債合計	1,849,723,663
負債合計	1,849,723,663
純資産の部	
元本等	
元本	232,190,413,709
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	356,368,562,587
元本等合計	588,558,976,296
純資産合計	588,558,976,296
負債純資産合計	590,408,699,959

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2021年 6月22日現在
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額

1口当たり純資産額	2,5348円
(10,000口当たり純資産額)	(25,348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	
	199,638,771,205円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	
3. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価	
貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。	
有価証券	209,289,686,040円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

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

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 6月22日現在	
期首	2020年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	241,015,940,773円
同期中における追加設定元本額	34,447,923,815円
同期中における一部解約元本額	43,273,450,879円
期末元本額	232,190,413,709円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	83,535,398円
バランスセレクト５０	83,894,400円
バランスセレクト７０	79,199,142円
野村外国債券インデックスファンド	277,057,244円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	3,651,286,995円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	23,595,171,073円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	1,713,480,419円
野村資産設計ファンド２０１５	19,963,468円
野村資産設計ファンド２０２０	19,987,346円
野村資産設計ファンド２０２５	37,553,523円
野村資産設計ファンド２０３０	38,510,765円
野村資産設計ファンド２０３５	28,725,756円
野村資産設計ファンド２０４０	49,412,936円
野村外国債券インデックス Ｂコース（野村投資一任口座向け）	74,479,502,325円
のむラップ・ファンド（保守型）	5,733,280,394円
のむラップ・ファンド（普通型）	14,955,903,097円
のむラップ・ファンド（積極型）	3,435,438,111円
野村外国債券インデックス（野村ＳＭＡ向け）	520,315,406円
野村資産設計ファンド２０４５	7,230,554円
野村インデックスファンド・外国債券	871,567,834円
マイ・ロード	8,962,838,075円
ネクストコア	207,691,753円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	207,432,030円
野村外国債券インデックスＢコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	8,441,173,162円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	1,354,089,820円
野村資産設計ファンド２０５０	7,727,393円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	4,809,335円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	2,053,116円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	1,401,589円

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,044,256円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	620,477,639円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	531,962,442円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,860,199円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,423,461円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	6,191,254円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,350,185円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,761,854円
野村6資産均等バランス	1,601,981,587円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	6,171,251,982円
世界6資産分散ファンド	62,140,190円
野村資産設計ファンド2060	2,821,441円
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信	6,224,140,147円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	3,035,176,154円
野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	6,369,730円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,192,527,006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）	189,391,556円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	1,387,960,158円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	1,040,284,050円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	2,688,192円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	8,181,138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）	530,616円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,189,103,658円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	11,186,675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）	53,194,028円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	13,719,951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）	177,262,727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）	162,888,988円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	1,932,850,998円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	90,545,863円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,378,096,765円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券（適格機関投資家専用）	1,064,344,085円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	5,763,513円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3,438,793円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	7,261,116円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	6,021,135円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	558,192,528円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	5,370,490,626円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	6,471,179,415円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	4,902,792,215円
野村外国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	18,354,899,310円
マイバランスDC30	1,904,099,400円
マイバランスDC50	1,418,038,502円
マイバランスDC70	950,333,501円
野村DC外国債券インデックスファンド	7,261,606,318円
野村DC運用戦略ファンド	4,296,569,976円

野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	542,929,716円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	223,950,899円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	353,308,376円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	178,583,246円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	14,857,488円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	34,414,176円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	15,769,984円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	7,488,773円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	5,234,310円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	2,774,863円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	101,142,353円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	68,663,873円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	37,357,606円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	48,146,243円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,252,887円
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	6,891,167円
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	19,967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(2021年6月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年6月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	38,800,000.00	43,769,732.92	
		US TREASURY BOND	45,100,000.00	47,763,718.75	
		US TREASURY BOND	63,300,000.00	78,279,349.98	
		US TREASURY BOND	15,000,000.00	19,646,484.00	
		US TREASURY BOND	48,600,000.00	62,864,858.16	
		US TREASURY BOND	48,000,000.00	61,541,246.40	
		US TREASURY BOND	28,200,000.00	36,333,937.50	
		US TREASURY BOND	100,000.00	137,148.43	
		US TREASURY BOND	500,000.00	571,582.00	
		US TREASURY BOND	200,000.00	261,109.36	
		US TREASURY N/B	200,000.00	203,351.56	

US TREASURY N/B	700,000.00	711,046.84	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	34,551,170.60	
US TREASURY N/B	22,100,000.00	22,562,718.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	101,691.40	
US TREASURY N/B	200,000.00	203,503.90	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,083.98	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,019,472.60	
US TREASURY N/B	900,000.00	915,785.10	
US TREASURY N/B	400,000.00	406,375.00	
US TREASURY N/B	34,700,000.00	35,412,973.96	
US TREASURY N/B	8,200,000.00	8,343,179.38	
US TREASURY N/B	100,000.00	101,683.59	
US TREASURY N/B	900,000.00	918,597.60	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,635,562.40	
US TREASURY N/B	600,000.00	609,703.08	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,355.46	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,537,617.15	
US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,248,933.15	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,613.28	
US TREASURY N/B	400,000.00	408,625.00	
US TREASURY N/B	24,100,000.00	24,799,463.94	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,633,062.40	
US TREASURY N/B	50,900,000.00	52,144,662.79	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,507.81	
US TREASURY N/B	400,000.00	412,093.72	
US TREASURY N/B	500,000.00	509,726.55	
US TREASURY N/B	66,000,000.00	67,399,919.40	
US TREASURY N/B	17,900,000.00	18,618,096.09	
US TREASURY N/B	500,000.00	502,597.65	
US TREASURY N/B	400,000.00	408,828.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,031.25	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,376,171.50	
US TREASURY N/B	400,000.00	418,343.72	
US TREASURY N/B	37,200,000.00	38,278,215.96	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,445,093.52	

US TREASURY N/B	9,100,000.00	9,540,425.44	
US TREASURY N/B	800,000.00	818,031.20	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,757.81	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,388,687.50	
US TREASURY N/B	37,100,000.00	39,034,705.64	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,809,003.50	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,158,875.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,053,710.90	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	36,056,623.68	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,058,359.30	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,923,382.68	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,059,765.60	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	45,059,481.18	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,598,905.56	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	31,102,635.62	
US TREASURY N/B	43,000,000.00	45,007,222.80	
US TREASURY N/B	800,000.00	845,500.00	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,508,784.78	
US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,482,273.19	
US TREASURY N/B	800,000.00	850,000.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	523,105.45	
US TREASURY N/B	400,000.00	421,187.48	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,780,218.75	
US TREASURY N/B	500,000.00	522,226.55	
US TREASURY N/B	700,000.00	736,093.75	
US TREASURY N/B	44,000,000.00	46,621,093.20	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,299,687.50	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,513,784.05	
US TREASURY N/B	500,000.00	519,277.30	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,992,375.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	519,648.40	
US TREASURY N/B	300,000.00	312,984.36	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,125,910.06	
US TREASURY N/B	42,700,000.00	44,920,062.67	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,134,804.66	

US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,535,187.44	
US TREASURY N/B	500,000.00	515,937.50	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	36,139,779.54	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,421,109.26	
US TREASURY N/B	500,000.00	515,957.00	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	2,009,695.17	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,074.21	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,067,812.50	
US TREASURY N/B	18,100,000.00	19,004,292.29	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	2,047,250.00	
US TREASURY N/B	17,300,000.00	17,614,913.63	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	35,101,406.25	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	37,428,456.60	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	8,499,038.66	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,085,585.90	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,432,323.86	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,653,171.68	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	28,394,296.20	
US TREASURY N/B	700,000.00	758,242.17	
US TREASURY N/B	29,200,000.00	31,969,436.04	
US TREASURY N/B	100,000.00	109,531.25	
US TREASURY N/B	50,600,000.00	53,796,098.40	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,908,593.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,808,593.00	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	19,145,728.92	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,072,031.20	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,076,132.80	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,328,125.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	198,992.18	
US TREASURY N/B	30,500,000.00	32,675,507.05	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,864,757.70	
US TREASURY N/B	300,000.00	318,058.59	
US TREASURY N/B	800,000.00	838,156.24	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,143,202.90	
US TREASURY N/B	24,000,000.00	24,679,687.20	

US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,267,187.20	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,347,265.00	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,795,124.72	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,705,351.40	
US TREASURY N/B	31,400,000.00	32,480,599.60	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,101.56	
US TREASURY N/B	200,000.00	205,421.86	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,072,901.92	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,407,984.34	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,458,125.00	
US TREASURY N/B	38,000,000.00	40,851,482.00	
US TREASURY N/B	700,000.00	677,003.88	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	9,299,483.94	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,068,945.30	
US TREASURY N/B	500,000.00	482,812.50	
US TREASURY N/B	500,000.00	486,152.30	
US TREASURY N/B	25,500,000.00	28,075,897.80	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,550.78	
US TREASURY N/B	500,000.00	501,250.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	100,207.03	
US TREASURY N/B	40,600,000.00	45,064,412.54	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	10,999,054.44	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,355,765.52	
US TREASURY N/B	500,000.00	547,792.95	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,185,163.98	
US TREASURY N/B	300,000.00	306,339.84	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,164,394.40	
US TREASURY N/B	600,000.00	569,203.08	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,713,281.25	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	18,316,795.90	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	15,474,959.90	
US TREASURY N/B	81,800,000.00	111,056,277.16	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	968,671.80	
US TREASURY N/B	100,000.00	101,316.40	
US TREASURY N/B	18,500,000.00	25,323,319.85	

US TREASURY N/B	6,200,000.00	9,005,015.16	
US TREASURY N/B	100,000.00	139,089.84	
US TREASURY N/B	100,000.00	124,546.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	136,210.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	140,375.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	138,460.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	142,882.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	139,144.53	
US TREASURY N/B	100,000.00	130,859.37	
US TREASURY N/B	100,000.00	137,210.93	
US TREASURY N/B	300,000.00	437,976.54	
US TREASURY N/B	100,000.00	139,789.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	129,242.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	118,554.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	118,757.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	116,453.12	
US TREASURY N/B	200,000.00	224,234.36	
US TREASURY N/B	100,000.00	112,093.75	
US TREASURY N/B	290,000.00	344,488.27	
US TREASURY N/B	100,000.00	128,035.15	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	5,527,179.58	
US TREASURY N/B	15,200,000.00	18,847,405.68	
US TREASURY N/B	25,000,000.00	29,832,030.00	
US TREASURY N/B	35,100,000.00	41,064,255.18	
US TREASURY N/B	39,900,000.00	42,904,968.75	
US TREASURY N/B	23,400,000.00	27,430,100.10	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	20,110,643.00	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,347,500.00	
US TREASURY N/B	51,500,000.00	55,451,013.05	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	30,362,364.72	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	35,439,314.25	
US TREASURY N/B	14,200,000.00	16,371,600.32	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,360,000.00	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,007,394.51	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	12,875,319.60	

小計	US TREASURY N/B	9,300,000.00	10,512,995.28	
	US TREASURY N/B	9,500,000.00	11,245,995.50	
	US TREASURY N/B	5,100,000.00	6,180,163.68	
	US TREASURY N/B	10,500,000.00	12,454,394.40	
	US TREASURY N/B	6,100,000.00	7,739,375.00	
	US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,936,694.89	
	US TREASURY N/B	100,000.00	116,281.25	
	US TREASURY N/B	11,250,000.00	11,565,526.50	
	US TREASURY N/B	300,000.00	316,968.75	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	974,531.20	
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,780,968.64	
	US TREASURY N/B	9,100,000.00	7,608,452.67	
	US TREASURY N/B	6,900,000.00	6,147,468.75	
	US TREASURY N/B	15,200,000.00	14,397,250.00	
	US TREASURY N/B	5,800,000.00	6,144,375.00	
	銘柄数：201	2,152,960,000.00	2,367,976,326.27	
			(261,140,429,261)	
	組入時価比率：44.4%		44.7%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	14,350,000.00	14,688,703.05	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	299,874.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	12,000,000.00	12,098,544.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,329,464.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,460,000.00	4,551,260.52	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,135,962.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	522,226.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,649,056.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	17,000,000.00	17,300,713.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,911,088.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	338,390.15	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	307,472.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,396,288.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	9,356,014.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	199,008.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	843,946.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	11,380,000.00	15,221,273.48	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,075,005.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	601,334.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	14,823,190.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	3,815,676.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,100,000.00	5,658,164.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	13,261,758.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,553,119.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,165,954.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	124,526.90	
	銘柄数：26	115,990,000.00	135,228,015.90	
メキシコペソ			(12,042,054,815)	
	組入時価比率：2.0%		2.1%	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,400,000.00	45,065,937.84	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	17,300,000.00	17,746,641.02	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	87,300,000.00	92,458,137.96	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	65,000,000.00	73,191,300.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	66,300,000.00	64,839,411.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	112,300,000.00	117,908,756.12	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	77,300,000.00	85,853,422.79	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,100,000.00	72,521,235.87	
小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	400,000.00	426,311.88	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	41,300,000.00	52,214,388.17	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,800,000.00	28,683,328.02	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,200,000.00	70,605,018.44	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	45,630,284.20	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	107,700,000.00	113,765,664.00	
	銘柄数：14	824,400,000.00	880,909,837.31	
			(4,732,864,282)	
	組入時価比率：0.8%		0.8%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	637,680.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,800,000.00	4,022,452.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,900,000.00	1,937,715.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,386,400.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,036,517.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,790,060.22	
	BELGIUM KINGDOM	6,700,000.00	8,301,681.90	

BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,535,164.60	
BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,134,660.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,072,069.00	
BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	7,023,562.00	
BELGIUM KINGDOM	7,000,000.00	7,659,680.00	
BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	2,410,088.30	
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	112,220.00	
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	574,390.00	
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	122,400.50	
BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	5,186,648.75	
BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	6,623,463.60	
BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,121,393.20	
BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,252,603.60	
BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,750,057.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,393,238.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	16,074,872.50	
BELGIUM KINGDOM GOVT	10,500,000.00	17,145,922.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	5,456,700.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,500,000.00	16,984,363.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,276,301.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,300,000.00	8,151,047.14	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,600,000.00	17,760,100.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,900,000.00	7,741,800.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	498,238.51	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	968,427.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,300,000.00	16,045,944.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,537,755.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,424,747.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	29,416,800.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,600,000.00	8,310,220.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,183,770.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,461,000.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,500,000.00	15,758,450.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,290,762.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	6,458,400.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,139,366.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,900,000.00	3,178,542.11	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,700,000.00	7,755,122.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,000,000.00	18,045,000.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	4,318,278.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,500,000.00	13,762,743.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	6,157,168.00	
BUNDES Obligation	250,000.00	252,210.00	
BUNDES Obligation	500,000.00	506,190.00	
BUNDES Obligation	2,000,000.00	2,043,840.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	410,064.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	307,935.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	404,114.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,800,000.00	2,917,152.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,580,000.00	2,730,826.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	25,600,000.00	30,152,448.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,810,755.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,800,000.00	11,489,472.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000.00	8,110,718.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,815,479.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,721,348.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,400,000.00	21,451,620.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,028,820.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	730,982.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	28,939,126.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	212,374.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,200,000.00	25,643,800.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	638,712.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	11,274,672.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,600,000.00	29,340,012.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000.00	13,142,472.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,400,000.00	17,099,628.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,700,000.00	17,397,707.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,800,000.00	6,686,170.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,600,000.00	3,025,756.80	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,130,000.00	1,869,856.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	8,888,076.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,600,000.00	18,125,928.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000.00	24,442,254.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	913,419.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	405,860.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000.00	1,284,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,533,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	26,660,000.00	28,800,798.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	2,819,068.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,804,340.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	102,236.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,100,000.00	5,560,584.06	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	553,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,061,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	22,785,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,100,000.00	19,259,730.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	317,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	634,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,520,940.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,948,630.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,088,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,800,000.00	23,490,779.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	844,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,178,077.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	429,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,752,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,255,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,900,000.00	14,344,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,194,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,100,000.00	24,885,690.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	222,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	220,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	22,500,000.00	31,124,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	220,520.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	8,900,000.00	11,562,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000.00	41,118,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,077,943.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,000,000.00	23,872,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	536,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	16,552,740.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,620,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	21,000,000.00	30,846,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,200,000.00	16,770,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	3,709,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	617,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	7,840,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	252,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,200,000.00	17,692,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	13,993,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	7,186,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,802,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	11,295,180.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,600,000.00	9,801,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,547,656.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	102,800.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	103,933.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	405,694.40	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	752,080.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,268,520.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,961.90	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,093,863.20	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,010,948.70	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,527,639.20	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	860,411.20	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	223,849.20	
FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	3,897,776.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	579,270.80	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	365,143.80	
FRANCE (GOVT OF)	4,200,000.00	4,244,268.00	

FRANCE (GOVT OF)	2,600,000.00	2,628,470.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,642,063.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	101,625.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	10,946,339.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,833,669.00	
FRANCE (GOVT OF)	13,000,000.00	13,510,354.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,879,875.00	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,728,220.10	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,616,992.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,900,000.00	7,351,812.00	
FRANCE (GOVT OF)	11,600,000.00	12,374,880.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,092,250.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,400,000.00	11,503,823.40	
FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	11,279,063.90	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	111,640.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	121,032.60	
FRANCE (GOVT OF)	10,400,000.00	13,333,008.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,314,452.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	474,991.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,000,000.00	13,510,666.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,100,000.00	12,979,533.03	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	25,600,000.00	28,532,480.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,237,603.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	12,253,100.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,386,100.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,800,000.00	40,265,940.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	5,368,500.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	38,985,165.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,000,000.00	14,805,752.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,400,000.00	33,243,799.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,600,000.00	31,379,090.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	475,256.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,300,000.00	9,169,657.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	25,550,000.00	39,687,326.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,250,000.00	11,791,018.75	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,700,000.00	19,091,831.00	
IRISH GOVERNMENT	4,630,000.00	5,646,655.40	
IRISH GOVERNMENT	6,500,000.00	6,970,138.50	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	653,651.40	
IRISH TSY 1.3% 2033	3,900,000.00	4,370,121.60	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,242,276.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	2,600,000.00	3,012,061.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	2,900,000.00	3,437,158.30	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,906,748.24	
IRISH TSY 2.4% 2030	6,000,000.00	7,262,580.00	
IRISH TSY 2% 2045	1,600,000.00	2,043,691.20	
IRISH TSY 2022	2,200,000.00	2,217,371.20	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,100,000.00	6,760,314.02	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	103,112.84	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	214,100.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,500,000.00	3,952,550.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	420,720.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	101,743.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,700,000.00	8,333,710.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,550,289.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	1,995,760.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,675,980.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	17,116,680.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,077,100.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,400,000.00	2,493,120.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	8,900,000.00	11,498,568.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,700,000.00	5,913,839.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	524,660.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,100,000.00	7,010,040.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,900,000.00	11,088,334.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,312,688.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	100,816.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	211,494.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	911,070.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	158,305.20	

小計	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,322,230.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	752,486.70	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,396,843.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	6,777,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,124,292.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	10,677,604.04	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	9,600,000.00	10,092,480.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	9,744,145.44	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	637,910.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	5,079,313.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,600,000.00	6,830,880.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,054,600.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	1,968,253.70	
	REPUBLIC OF IRELAND	9,850,000.00	10,621,073.76	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,120,716.80	
	SPANISH GOVERNMENT	28,200,000.00	44,116,080.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,900,000.00	8,787,058.80	
	銘柄数：234	1,393,810,000.00	1,797,192,665.56	
			(235,971,396,988)	
	組入時価比率：40.1%		40.5%	
英債券	UK TREASURY	2,100,000.00	2,100,378.00	
	UK TREASURY	17,000,000.00	17,221,850.00	
	UK TREASURY	2,300,000.00	2,407,137.68	
	UK TREASURY	1,600,000.00	1,635,862.40	
	UK TREASURY	7,450,000.00	8,047,799.92	
	UK TREASURY	14,750,000.00	17,324,435.50	
	UK TREASURY	200,000.00	202,697.28	
	UK TREASURY	200,000.00	214,182.00	
	UK TREASURY	510,000.00	538,115.53	
	UK TREASURY	400,000.00	418,144.00	
	UK TREASURY	12,730,000.00	15,747,725.42	
	UK TREASURY	200,000.00	214,823.60	
	UK TREASURY	4,800,000.00	6,677,760.00	
	UK TREASURY	8,900,000.00	12,130,162.44	
	UK TREASURY	7,800,000.00	10,536,870.24	

小計	UK TREASURY	12,300,000.00	17,639,562.84	
	UK TREASURY	2,300,000.00	3,301,977.52	
	UK TREASURY	100,000.00	157,670.64	
	UK TREASURY	600,000.00	905,726.40	
	UK TREASURY	500,000.00	767,983.60	
	UK TREASURY	570,000.00	926,226.06	
	UK TREASURY	18,440,000.00	27,080,312.78	
	UK TREASURY	5,900,000.00	9,805,179.32	
	UK TREASURY	8,200,000.00	8,699,380.00	
	UK TREASURY	16,100,000.00	18,090,784.32	
	UK TREASURY	5,350,000.00	9,264,749.08	
	UK TREASURY	6,750,000.00	11,203,358.40	
	UK TREASURY	1,300,000.00	1,450,514.00	
	UK TREASURY	700,000.00	821,065.00	
	UK TREASURY	1,950,000.00	3,693,943.50	
	UK TREASURY	100,000.00	148,299.12	
	UK TREASURY	200,000.00	377,028.60	
	UK TSY 3 1/4% 2044	21,800,000.00	30,577,020.08	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,200,000.00	11,606,028.00	
	銘柄数：34	190,300,000.00	251,934,753.27	
			(38,646,791,151)	
	組入時価比率：6.6%		6.6%	
スウェーデン ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	32,050,000.00	33,203,159.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	7,900,000.00	8,233,675.46	
	SWEDISH GOVERNMENT	36,350,000.00	40,097,685.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,651,600.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,800,000.00	17,508,288.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	18,900,000.00	19,691,437.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	3,100,000.00	3,025,950.30	
	SWEDISH GOVERNMENT	21,300,000.00	31,188,940.35	
	銘柄数：8	148,400,000.00	165,600,735.61	
			(2,137,905,496)	
ノルウェー クロネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,440,375.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	37,800,000.00	39,975,390.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	12,500,000.00	12,830,375.00	

小計	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,795,648.28	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	9,848,160.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	9,819,710.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	22,000,000.00	22,584,650.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,400,000.00	7,358,264.00	
	銘柄数：8	109,700,000.00	113,652,573.08	
	組入時価比率：0.2%		(1,459,299,038)	0.3%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	400,000.00	403,840.00	
	KINGDOM OF DENMARK	24,270,000.00	25,413,117.00	
	KINGDOM OF DENMARK	29,300,000.00	32,073,245.00	
	KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	16,406,500.00	
	KINGDOM OF DENMARK	28,450,000.00	29,798,530.00	
	KINGDOM OF DENMARK	35,800,000.00	62,785,896.80	
	銘柄数：6	133,920,000.00	166,881,128.80	
小計	組入時価比率：0.5%		(2,947,120,734)	0.5%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	49,800,000.00	51,569,344.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	34,620,300.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,817,100.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	34,800,000.00	37,618,800.00	
	銘柄数：4	120,200,000.00	126,625,544.20	
小計	組入時価比率：0.6%		(3,670,671,925)	0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,020,000.00	3,203,767.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	80,000.00	82,476.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,800,000.00	5,275,276.32	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,478,930.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	10,347,332.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	14,893,826.05	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,400,000.00	15,096,577.16	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,435,435.42	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,223,941.51	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	11,631,198.38	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	14,790,930.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	22,200,000.00	24,328,573.74	

小計	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,478,526.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,303,214.38	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,321,306.35	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,500,000.00	11,178,455.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,455,204.92	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,250,000.00	10,337,593.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	820,540.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,651,331.25	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,900,000.00	5,540,430.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,605,500.00	
	銘柄数：22	132,930,000.00	150,480,366.38	
			(12,482,346,391)	
	組入時価比率：2.1%		2.1%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,700,000.00	2,789,100.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	510,887.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,100,000.00	4,290,650.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,505,390.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,474,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,172,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	743,281.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,433,130.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	548,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	334,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,850,000.00	3,198,327.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,422,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,920,000.00	2,035,804.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,750,000.00	3,181,750.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,182,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,022,405.00	
	銘柄数：16	28,270,000.00	30,844,925.30	
			(2,528,975,425)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	422,056.88	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,817,066.46	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,700,000.00	2,707,683.93	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	437,362.96	

小計	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	508,894.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	512,119.15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,858,365.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,900,000.00	4,027,397.79	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,282,432.02	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	6,129,403.46	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	634,333.14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,600,000.00	16,823,974.44	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,854,839.54	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,235,959.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,302,986.84	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	294,060.22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,400,000.00	16,775,443.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,741,376.12	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	809,712.64	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,396,937.64	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	10,628,598.46	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,100,000.00	4,325,222.43	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	324,626.28	
	銘柄数：23	100,780,000.00	106,850,852.80	
			(2,843,814,077)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	9,800,000.00	9,879,392.74	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,084,068.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,366,178.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,158,082.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,900,000.00	6,472,138.34	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,276,781.00	
	ISRAEL FIXED BOND	6,500,000.00	8,449,091.95	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,378,760.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,471,822.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,500,000.00	5,426,993.00	
	ISRAEL FIXED BOND	1,700,000.00	1,604,623.03	
	ISRAEL FIXED BOND	6,000,000.00	9,483,016.20	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	6,349,863.00	

小計	銘柄数：13	70,400,000.00	79,400,810.26 (2,681,222,441)	0.5%
	組入時価比率：0.5%			
合計			583,284,892,024 (583,284,892,024)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(3)貸付有価証券の明細(2021年 6月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	1,445,000	
		US TREASURY N/B	33,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	3,775,000	
		US TREASURY N/B	15,000,000	
		US TREASURY N/B	14,000,000	
		US TREASURY BOND	425,000	
		US TREASURY N/B	12,000,000	
		US TREASURY N/B	7,586,000	
		US TREASURY N/B	19,000,000	
		US TREASURY N/B	29,000,000	
		US TREASURY N/B	21,000,000	
		US TREASURY N/B	12,000,000	
		US TREASURY N/B	565,000	
		US TREASURY N/B	12,155,000	
		US TREASURY N/B	2,805,000	
		US TREASURY BOND	5,000,000	
		US TREASURY BOND	18,000,000	
		US TREASURY BOND	40,000,000	
		US TREASURY N/B	18,600,000	
		US TREASURY N/B	15,000,000	
		US TREASURY N/B	12,000,000	
		US TREASURY N/B	22,000,000	
		US TREASURY BOND	40,000,000	
		US TREASURY BOND	50,000,000	
		US TREASURY BOND	12,000,000	
		US TREASURY BOND	32,000,000	
		US TREASURY N/B	2,250,000	
		US TREASURY N/B	6,000,000	
		US TREASURY N/B	304,000	
		US TREASURY N/B	546,000	
		US TREASURY N/B	14,705,000	
		US TREASURY N/B	1,190,000	
		US TREASURY N/B	85,000	

US TREASURY N/B	29,000,000	
US TREASURY N/B	10,200,000	
US TREASURY N/B	8,400,000	
US TREASURY N/B	10,000,000	
US TREASURY N/B	45,000,000	
US TREASURY N/B	1,300,000	
US TREASURY N/B	6,035,000	
US TREASURY N/B	250,000	
US TREASURY N/B	75,000	
US TREASURY N/B	25,000,000	
US TREASURY N/B	4,760,000	
US TREASURY N/B	28,000,000	
US TREASURY N/B	31,000,000	
US TREASURY N/B	1,785,000	
US TREASURY N/B	40,000,000	
US TREASURY N/B	425,000	
US TREASURY N/B	27,000,000	
US TREASURY N/B	255,000	
US TREASURY N/B	170,000	
US TREASURY N/B	950,000	
US TREASURY N/B	22,000,000	
US TREASURY N/B	15,000,000	
US TREASURY N/B	11,050,000	
US TREASURY N/B	7,000,000	
US TREASURY N/B	85,000	
US TREASURY N/B	85,000	
US TREASURY N/B	1,870,000	
US TREASURY N/B	5,000,000	
US TREASURY N/B	425,000	
US TREASURY N/B	15,045,000	
US TREASURY N/B	36,000,000	
US TREASURY N/B	1,020,000	
US TREASURY N/B	7,395,000	
US TREASURY N/B	9,605,000	
US TREASURY N/B	29,000,000	
US TREASURY N/B	3,341,000	
US TREASURY N/B	39,000,000	
US TREASURY N/B	35,000,000	
US TREASURY N/B	1,550,000	
US TREASURY N/B	2,040,000	
US TREASURY BOND	335,000	
US TREASURY BOND	30,618,000	
US TREASURY N/B	30,000,000	
US TREASURY N/B	1,339,000	
US TREASURY N/B	17,000,000	
US TREASURY N/B	765,000	
US TREASURY N/B	1,105,000	
US TREASURY N/B	1,700,000	
US TREASURY N/B	155,000	

	US TREASURY N/B	3,000,000	
	US TREASURY N/B	12,750,000	
	US TREASURY N/B	27,000,000	
	US TREASURY N/B	680,000	
	US TREASURY N/B	20,000,000	
	US TREASURY N/B	210,000	
	US TREASURY N/B	36,000,000	
	US TREASURY N/B	30,000,000	
	US TREASURY N/B	8,415,000	
	US TREASURY N/B	1,300,000	
	US TREASURY N/B	10,000,000	
	US TREASURY N/B	23,000,000	
	US TREASURY N/B	2,000,000	
	US TREASURY N/B	27,000,000	
	US TREASURY N/B	24,000,000	
	US TREASURY N/B	850,000	
	US TREASURY N/B	16,000,000	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,500,000	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	500,000	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	500,000	
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	200,000	
	ISRAEL FIXED BOND	2,000,000	
	ISRAEL FIXED BOND	2,250,000	
	ISRAEL FIXED BOND	2,500,000	
	ISRAEL FIXED BOND	4,250,000	
	ISRAEL FIXED BOND	5,100,000	
	ISRAEL FIXED BOND	4,225,000	
ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,295,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,100,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,218,708	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	595,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,400,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,160,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	360,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,900,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	960,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,900,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,020,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,900,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,100,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,300,000	
	BELGIUM KINGDOM	3,800,000	

	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,000,000	
	SPANISH GOVERNMENT	18,000,000	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,700,000	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6,400,000	

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2021年 6月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,492,094,385	-	1,496,994,420	4,900,035
米ドル	682,162,378	-	683,724,840	1,562,462
カナダドル	17,653,680	-	17,809,640	155,960
メキシコペソ	49,625,023	-	49,952,160	327,137
ユーロ	562,845,281	-	564,599,250	1,753,969
英ポンド	45,655,260	-	46,018,950	363,690
スウェーデンクローナ	37,061,770	-	37,439,000	377,230
デンマーククローネ	28,138,016	-	28,256,000	117,984
リングギ	68,952,977	-	69,194,580	241,603
合計	1,492,094,385	-	1,496,994,420	4,900,035

（注）時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2021年 6月22日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	97,213,036
コール・ローン	20,204,663
国債証券	9,181,654,503
未収利息	102,641,923
前払費用	10,182,030
流動資産合計	9,411,896,155
資産合計	9,411,896,155
負債の部	
流動負債	
未払解約金	6,807,444
未払利息	17
その他未払費用	355,100
流動負債合計	7,162,561
負債合計	7,162,561
純資産の部	
元本等	
元本	6,612,609,282
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,792,124,312
元本等合計	9,404,733,594
純資産合計	9,404,733,594
負債純資産合計	9,411,896,155

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2021年 6月22日現在
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額

1口当たり純資産額

1.4222円

(10,000口当たり純資産額)

(14,222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 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 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

2021年 6月22日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 国債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 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

2021年 6月22日現在	2020年 6月23日
期首	2020年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	4,944,159,603円
同期中における追加設定元本額	2,885,750,960円
同期中における一部解約元本額	1,217,301,281円

期末元本額	6,612,609,282円
期末元本額の内訳＊	
野村資産設計ファンド２０１５	19,082,712円
野村資産設計ファンド２０２０	19,101,187円
野村資産設計ファンド２０２５	36,417,662円
野村資産設計ファンド２０３０	37,338,275円
野村資産設計ファンド２０３５	27,855,123円
野村資産設計ファンド２０４０	47,908,440円
野村資産設計ファンド２０４５	7,012,933円
野村インデックスファンド・新興国債券	778,566,268円
ネクストコア	42,131,335円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	368,081,284円
野村資産設計ファンド２０５０	7,448,496円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	4,665,879円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	1,991,435円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	1,359,482円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	1,012,681円
世界６資産分散ファンド	110,265,604円
野村資産設計ファンド２０６０	2,695,837円
ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用）	3,656,478,375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）	852,835円
オールウェザー・ファクターアロケーションＭオープン投信（適格機関投資家専用）	86,603,437円
野村ＤＣ新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド	384,009,363円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	870,317,558円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	85,203,276円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	7,262,245円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	5,074,967円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	2,675,415円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	1,197,178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(2021年6月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年6月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,700,000.00	7,815,489.22	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,500,000.00	8,719,447.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	18,700,000.00	19,804,893.24	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,100,000.00	15,876,882.00	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	23,900,000.00	23,373,483.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,550,000.00	16,326,635.42	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,100,000.00	8,996,283.63	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,400,000.00	10,010,273.38	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,200,000.00	4,476,274.74	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	3,413,531.43	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	11,600,000.00	12,896,380.04	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,700,000.00	6,936,270.14	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,500,000.00	9,019,939.90	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	12,900,000.00	13,626,528.00	
	銘柄数：14	152,550,000.00	161,292,312.04	
	組入時価比率：9.2%		(866,575,204)	9.4%
リアル	LETRA TESOURO NACIONAL	2,500,000.00	2,340,378.75	
	LETRA TESOURO NACIONAL	3,900,000.00	3,353,190.36	
	LETRA TESOURO NACIONAL	15,300,000.00	12,589,629.48	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000.00	6,612,633.63	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	481,000.00	5,274,787.41	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000.00	3,511,316.80	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	250,000.00	2,742,136.25	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	160,000.00	1,743,631.20	
	銘柄数：8	23,521,000.00	38,167,703.88	
	組入時価比率：8.9%		(839,208,572)	9.1%
チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	100,000,000.00	105,333,050.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	420,000,000.00	420,063,168.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	30,000,000.00	32,313,354.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	295,000,000.00	310,056,003.50	
	BONOS TESORERIA PESOS	240,000,000.00	251,678,808.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	215,000,000.00	249,568,904.00	
	銘柄数：6	1,300,000,000.00	1,369,013,287.50	
	組入時価比率：2.1%		(201,958,209)	2.2%
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,210,000,000.00	2,657,149,300.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,100,000,000.00	1,140,360,210.00	
	TITULOS DE TESORERIA	950,000,000.00	1,093,634,015.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,900,000,000.00	1,956,567,940.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	869,549,940.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	871,563,240.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,750,000,000.00	1,831,319,525.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,600,000,000.00	1,566,386,080.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,850,000,000.00	1,820,739,845.00	
	銘柄数：9	13,160,000,000.00	13,807,270,095.00	
小計				

			(405,063,882)	
	組入時価比率：4.3%		4.4%	
ソル	BONOS DE TESORERIA	200,000.00	223,448.26	
	BONOS DE TESORERIA	1,000,000.00	1,065,191.10	
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	609,860.82	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	636,638.03	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	591,859.24	
	PERU BONO SOBERANO	700,000.00	852,837.44	
	PERU BONO SOBERANO	500,000.00	546,161.50	
	PERU BONO SOBERANO	1,020,000.00	1,036,794.91	
	REPUBLIC OF PERU	1,100,000.00	1,202,611.19	
小計	銘柄数：9	6,520,000.00	6,765,402.49	
			(188,710,077)	
	組入時価比率：2.0%		2.1%	
ウルグアイペソ	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	4,151,280.00	
	銘柄数：1	4,000,000.00	4,151,280.00	
小計			(10,475,339)	
	組入時価比率：0.1%		0.1%	
ドミニカペソ	DOMINICAN REPUBLIC	8,000,000.00	9,020,000.00	
	銘柄数：1	8,000,000.00	9,020,000.00	
小計			(17,443,778)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	500,000.00	480,000.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,100,000.00	1,022,506.10	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	790,000.00	714,950.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	1,859,000.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	770,000.00	654,885.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	439,233.08	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,110,000.00	887,445.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	755,616.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,513,800.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	400,000.00	309,600.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	914,400.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	700,000.00	515,550.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,452,600.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,119,000.00	
	銘柄数：14	15,210,000.00	12,638,585.18	
小計			(158,523,246)	
	組入時価比率：1.7%		1.7%	
チェココルナ	CZECH REPUBLIC	14,000,000.00	13,781,703.60	
	CZECH REPUBLIC	16,600,000.00	16,176,303.26	
	CZECH REPUBLIC	12,500,000.00	11,620,692.50	
	CZECH REPUBLIC	13,200,000.00	12,397,704.00	

小計	CZECH REPUBLIC	12,500,000.00	11,948,740.00	
	CZECH REPUBLIC	6,500,000.00	6,661,850.00	
	CZECH REPUBLIC	2,400,000.00	3,141,998.40	
	銘柄数：7	77,700,000.00	75,728,991.76	
	組入時価比率：4.1%		(389,754,401)	4.2%
フォリント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	17,000,000.00	18,036,150.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	62,000,000.00	62,196,397.40	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	77,000,000.00	85,331,400.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	68,000,000.00	70,713,200.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	75,000,000.00	76,780,792.50	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	71,582,805.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	82,000,000.00	80,008,359.40	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	86,000,000.00	88,317,700.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	82,000,000.00	85,575,323.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	57,000,000.00	73,555,650.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	60,000,000.00	62,258,256.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	130,000,000.00	137,011,927.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	40,000,000.00	38,188,000.00	
	銘柄数：13	899,000,000.00	949,555,960.30	
	組入時価比率：3.8%		(352,773,333)	3.8%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	6,500,000.00	6,730,938.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,357,120.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,100,000.00	6,070,443.06	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,800,000.00	7,367,800.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	600,000.00	648,600.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,400,000.00	1,340,033.52	
	銘柄数：6	24,600,000.00	25,514,935.08	
ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	13,500,000.00	13,678,200.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	12,174,463.20	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	29,000,000.00	29,226,200.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	28,000,000.00	27,957,160.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	28,300,000.00	28,840,730.93	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,000,000.00	27,395,525.70	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,000,000.00	28,135,350.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	47,700,000.00	50,110,944.03	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	29,000,000.00	30,785,959.20	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	11,501,494.80	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,700,000.00	18,883,260.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	40,000,000.00	37,561,200.00	

小計	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	10,005,450.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,200,000.00	21,139,502.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	26,500,000.00	29,338,415.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,500,000.00	29,033,125.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	10,180,000.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	39,000,000.00	41,481,960.00	
	銘柄数：18	445,400,000.00	457,428,939.86	
	組入時価比率：7.3%		(690,717,699)	7.5%
レイ	ROMANIA	300,000.00	303,333.00	
	ROMANIA	1,000,000.00	1,021,280.00	
	ROMANIA	550,000.00	586,203.75	
	ROMANIA	400,000.00	419,415.68	
	ROMANIA	500,000.00	520,594.20	
	ROMANIA	500,000.00	512,655.00	
	ROMANIA	1,000,000.00	1,060,660.00	
	ROMANIA	800,000.00	833,558.08	
	ROMANIA	920,000.00	991,024.00	
	ROMANIA	500,000.00	517,175.00	
	ROMANIA	500,000.00	548,032.50	
	ROMANIA	760,000.00	888,724.62	
	ROMANIA	800,000.00	899,584.00	
	ROMANIA	1,100,000.00	1,118,639.50	
	銘柄数：14	9,630,000.00	10,220,879.33	
	組入時価比率：2.9%		(272,256,628)	3.0%
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	844,113.76	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,000,000.00	2,113,448.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	802,276.72	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,000,000.00	1,093,407.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,437,163.84	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,032,666.10	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,241,510.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,747,663.62	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,325,888.18	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	634,005.84	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,478,770.44	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	3,035,755.38	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,780,774.36	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	700,000.00	662,744.32	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	755,536.48	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	969,329.80	
	銘柄数：16	24,000,000.00	24,955,055.04	
小計				

			(664,173,798)	
	組入時価比率：7.1%		7.2%	
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,209,299.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,112,520.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	16,700,000.00	17,719,760.45	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,200,000.00	12,755,408.66	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,900,000.00	24,567,493.54	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	12,624,295.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,540,772.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,700,000.00	11,334,643.75	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,900,000.00	14,180,899.05	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	12,694,263.12	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	17,300,000.00	17,290,441.75	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,800,000.00	14,974,630.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,200,000.00	9,692,352.44	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,000,000.00	12,185,730.70	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	13,017,361.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	14,191,291.25	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,900,000.00	6,641,447.10	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,300,000.00	13,831,311.06	
小計	銘柄数：18	220,100,000.00	232,563,920.77	
			(809,322,444)	
	組入時価比率：8.6%		8.8%	
フィリピンペソ	REPUBLIC OF PHILIPPINES	10,000,000.00	11,964,193.00	
	銘柄数：1	10,000,000.00	11,964,193.00	
			(27,095,307)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ルピア	INDONESIA GOVERNMENT	2,180,000,000.00	2,249,084,200.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,700,000,000.00	2,767,527,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	7,730,000,000.00	8,460,794,200.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	8,800,000,000.00	9,628,960,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,900,000,000.00	7,238,859,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,580,000,000.00	1,907,897,400.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,700,000,000.00	4,728,200,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,250,000,000.00	6,648,187,500.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,027,500,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	7,230,000,000.00	8,401,838,400.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,400,000,000.00	7,161,984,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,416,038,100.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	11,100,000,000.00	11,534,676,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,895,432,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,600,000,000.00	1,786,960,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,200,000,000.00	3,382,400,000.00	

	小計	INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	4,898,383,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	7,180,000,000.00	8,028,604,200.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,228,200,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,555,350,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	3,400,000,000.00	3,495,200,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	4,600,000,000.00	5,156,600,000.00	
		銘柄数：22	108,960,000,000.00	117,598,675,000.00	
				(905,509,797)	
		組入時価比率：9.6%		9.9%	
	ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,000,000.00	6,236,970.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,900,000.00	16,910,579.18	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	21,100,000.00	19,773,839.68	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,460,000.00	3,790,554.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,000,000.00	1,808,254.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,000,000.00	3,588,668.80	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000.00	3,366,398.40	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,200,000.00	9,485,280.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000.00	6,165,470.31	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,450,000.00	2,953,824.56	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000.00	9,863,188.12	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,500,000.00	9,614,801.55	
		銘柄数：12	103,310,000.00	93,557,828.60	
				(726,008,749)	
		組入時価比率：7.7%		7.9%	
	小計	銘柄数：12	103,310,000.00	93,557,828.60	
				(726,008,749)	
		組入時価比率：7.7%		7.9%	
	オフショア人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,073,873.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,500,000.00	10,357,620.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,547,530.95	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,471,602.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	8,000,000.00	8,720,960.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	2,500,000.00	2,651,692.75	
		CHINA GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	14,946,194.20	
		銘柄数：7	51,500,000.00	53,769,472.90	
				(916,446,896)	
		組入時価比率：9.7%		10.1%	
	合計			9,181,654,503	
				(9,181,654,503)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2021年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,289,766,661
株式	387,628,573,890
派生商品評価勘定	20,157,415
未収配当金	2,161,356,803
未収利息	299,976
その他未収収益	23,470,197
差入委託証拠金	411,426,600
流動資産合計	398,535,051,542
資産合計	398,535,051,542
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,038,800
未払金	49,580
未払解約金	277,130,514
未払利息	7,272
有価証券貸借取引受入金	4,289,231,011
流動負債合計	4,573,457,177
負債合計	4,573,457,177
純資産の部	
元本等	
元本	192,305,473,973
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	201,656,120,392
元本等合計	393,961,594,365
純資産合計	393,961,594,365
負債純資産合計	398,535,051,542

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。

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2021年 6月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.0486円
(10,000口当たり純資産額)	(20,486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	
	4,110,495,180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 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日	
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 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

2021年 6月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	
株式	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 6月22日現在	
期首	2020年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	272,092,969,076円
同期中における追加設定元本額	26,528,517,151円
同期中における一部解約元本額	106,316,012,254円
期末元本額	192,305,473,973円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	138,319,601円
バランスセレクト50	317,666,469円
バランスセレクト70	445,477,288円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,310,437,121円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,985,826,631円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	7,589,072,183円
野村資産設計ファンド2015	38,871,816円
野村資産設計ファンド2020	38,913,134円
野村資産設計ファンド2025	73,494,801円
野村資産設計ファンド2030	100,480,582円
野村資産設計ファンド2035	84,325,458円
野村資産設計ファンド2040	161,180,409円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	14,958,732,059円
のむラップ・ファンド（保守型）	2,315,941,100円
のむラップ・ファンド（普通型）	9,283,120,434円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,807,237,730円
野村資産設計ファンド2045	28,302,798円
野村インデックスファンド・T O P I X	1,742,776,424円
マイ・ロード	3,242,367,142円
ネクストコア	35,817,117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	1,352,485,672円
野村T O P I Xインデックス（野村S M A ・E W向け）	2,362,951,250円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,386,324,750円

野村資産設計ファンド2050	39,234,934円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	12,952,382円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	6,616,837円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	5,138,862円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	4,169,093円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	323,832,034円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	388,286,237円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,181,816円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,780,527円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	17,167,713円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	5,528,306円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	23,468,403円
野村6資産均等バランス	2,027,211,364円
世界6資産分散ファンド	78,634,541円
野村資産設計ファンド2060	19,225,027円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	886,212,355円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	314,431,919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）	149,794,123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）	501,904,544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）	526,595,956円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	3,401,770円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	7,764,608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）	1,678,670円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	2,421,765,513円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	7,864,455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）	67,325,091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）	66,601,438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）	23,149,193円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	96,135,813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）	206,140,306円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	4,280,639,982円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	56,794,207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）	391,810,982円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX（適格機関投資家専用）	1,620,513,781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）	176,681,163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）	649,444,619円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	2,430,337円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	5,736,032円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	27,076,027円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	33,849,601円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	119,780,245円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	8,941,008,200円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	24,303,407,100円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	27,626,306,857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）	32,917,831,162円
マイバランスDC30	3,160,356,627円
マイバランスDC50	5,306,255,018円

マイバランスＤＣ７０	5,322,056,055円
野村ＤＣ国内株式インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ	10,116,156,621円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	747,971,653円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	65,580,797円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	1,190,837,113円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	945,567,152円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	821,554,638円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	9,400,631円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	4,355,150円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	69,845,884円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	19,539,669円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	17,071,401円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	14,090,814円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	424,386,467円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	343,081,091円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	212,732,286円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	274,167,989円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	8,538,494円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	39,241,681円
多資産分散投資ファンド（バランス１０）（確定拠出年金向け）	60,648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(2021年6月22日現在)

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	6,400	2,901.00	18,566,400	
		日本水産	181,800	539.00	97,990,200	
		マルハニチロ	30,600	2,427.00	74,266,200	
		雪国まいたけ	16,100	1,690.00	27,209,000	
		カネコ種苗	5,900	1,454.00	8,578,600	
		サカタのタネ	23,300	3,755.00	87,491,500	貸付有価証券 100株
		ホクト	16,400	1,918.00	31,455,200	貸付有価証券 1,600株（300株）
		ホクリヨウ	3,000	789.00	2,367,000	
		住石ホールディングス	34,300	125.00	4,287,500	貸付有価証券 200株

日鉄鉱業	4,500	5,950.00	26,775,000	
三井松島ホールディングス	8,200	979.00	8,027,800	
I N P E X	719,800	833.00	599,593,400	
石油資源開発	25,600	1,995.00	51,072,000	
K & O エナジーグループ	9,500	1,349.00	12,815,500	
ヒノキヤグループ	4,900	2,540.00	12,446,000	
ショーボンドホールディングス	27,900	4,805.00	134,059,500	
ミライト・ホールディングス	67,900	1,941.00	131,793,900	
タマホーム	11,900	2,318.00	27,584,200	貸付有価証券 3,000株
サンヨーホームズ	2,300	730.00	1,679,000	
日本アクア	7,800	563.00	4,391,400	貸付有価証券 1,100株（1,000株）
ファーストコーポレーション	6,000	759.00	4,554,000	
ベステラ	3,700	1,621.00	5,997,700	
R o b o t H o m e	36,700	270.00	9,909,000	貸付有価証券 300株
キャンディル	3,400	556.00	1,890,400	
スペースバリューホールディングス	23,900	684.00	16,347,600	
ダイセキ環境ソリューション	3,800	1,011.00	3,841,800	
第一カッター興業	4,800	1,378.00	6,614,400	
安藤・間	125,500	827.00	103,788,500	貸付有価証券 52,200株
東急建設	57,300	781.00	44,751,300	貸付有価証券 100株
コムシスホールディングス	69,400	3,140.00	217,916,000	
ピーアールホールディングス	26,200	487.00	12,759,400	貸付有価証券 100株
高松コンストラクショングループ	12,200	2,033.00	24,802,600	
東建コーポレーション	6,000	10,240.00	61,440,000	
ソネック	2,000	973.00	1,946,000	
ヤマウラ	8,500	906.00	7,701,000	貸付有価証券 1,900株

オリエンタル白石	65,800	283.00	18,621,400	
大成建設	140,700	3,610.00	507,927,000	
大林組	452,000	906.00	409,512,000	貸付有価証券 800株
清水建設	423,400	868.00	367,511,200	貸付有価証券 500株
飛島建設	13,000	1,051.00	13,663,000	
長谷工コーポレーション	148,100	1,505.00	222,890,500	
松井建設	17,800	730.00	12,994,000	
銭高組	2,000	4,085.00	8,170,000	
鹿島建設	331,200	1,449.00	479,908,800	
不動テトラ	11,100	1,856.00	20,601,600	
大末建設	5,700	996.00	5,677,200	
鉄建建設	9,100	1,873.00	17,044,300	
西松建設	32,300	3,490.00	112,727,000	貸付有価証券 2,200株
三井住友建設	109,200	483.00	52,743,600	
大豊建設	9,900	4,185.00	41,431,500	貸付有価証券 1,800株
前田建設工業	113,200	972.00	110,030,400	貸付有価証券 12,900株
佐田建設	10,400	492.00	5,116,800	
ナカノフドー建設	10,800	411.00	4,438,800	
奥村組	24,800	2,932.00	72,713,600	
東鉄工業	19,400	2,331.00	45,221,400	
イチケン	3,300	1,819.00	6,002,700	
富士ピー・エス	5,800	569.00	3,300,200	
浅沼組	5,400	4,510.00	24,354,000	
戸田建設	187,700	770.00	144,529,000	貸付有価証券 2,200株
熊谷組	20,900	2,814.00	58,812,600	貸付有価証券 100株
北野建設	2,800	2,339.00	6,549,200	
植木組	4,000	1,469.00	5,876,000	貸付有価証券 400株
矢作建設工業	20,000	713.00	14,260,000	
ピーエス三菱	14,900	629.00	9,372,100	
日本ハウスホールディングス	30,900	353.00	10,907,700	

大東建託	49,300	12,210.00	601,953,000	
新日本建設	19,200	858.00	16,473,600	貸付有価証券 600株
N I P P O	37,400	3,240.00	121,176,000	
東亜道路工業	2,800	4,610.00	12,908,000	
前田道路	27,900	2,196.00	61,268,400	貸付有価証券 1,200株
日本道路	4,400	8,050.00	35,420,000	
東亜建設工業	12,100	2,496.00	30,201,600	貸付有価証券 5,900株（5,300株）
日本国土開発	44,000	589.00	25,916,000	貸付有価証券 600株
若築建設	8,100	1,463.00	11,850,300	貸付有価証券 200株
東洋建設	50,700	576.00	29,203,200	
五洋建設	192,000	790.00	151,680,000	
世紀東急工業	21,700	871.00	18,900,700	
福田組	5,200	4,960.00	25,792,000	
住友林業	106,300	2,134.00	226,844,200	貸付有価証券 1,700株
日本基礎技術	13,800	524.00	7,231,200	
巴コーポレーション	20,100	370.00	7,437,000	
大和ハウス工業	417,400	3,329.00	1,389,524,600	貸付有価証券 900株（900株）
ライト工業	25,900	1,833.00	47,474,700	
積水ハウス	490,200	2,289.50	1,122,312,900	
日特建設	11,800	764.00	9,015,200	
北陸電気工事	7,800	1,274.00	9,937,200	
ユアテック	25,900	731.00	18,932,900	
日本リーテック	9,500	1,696.00	16,112,000	
四電工	2,500	3,240.00	8,100,000	
中電工	20,800	2,338.00	48,630,400	
関電工	73,500	880.00	64,680,000	
きんでん	91,800	1,841.00	169,003,800	
東京エネシス	15,000	996.00	14,940,000	
トーエネック	4,500	3,690.00	16,605,000	
住友電設	12,800	2,293.00	29,350,400	
日本電設工業	24,800	1,886.00	46,772,800	

協和エクシオ	68,500	2,743.00	187,895,500	
新日本空調	12,000	2,039.00	24,468,000	
九電工	31,700	3,555.00	112,693,500	
三機工業	32,000	1,421.00	45,472,000	貸付有価証券 100株
日揮ホールディングス	150,800	1,055.00	159,094,000	貸付有価証券 200株
中外炉工業	4,900	2,021.00	9,902,900	
ヤマト	14,500	804.00	11,658,000	
太平電業	10,000	2,685.00	26,850,000	
高砂熱学工業	40,900	1,905.00	77,914,500	
三晃金属工業	1,800	2,402.00	4,323,600	
朝日工業社	3,300	2,965.00	9,784,500	
明星工業	29,200	744.00	21,724,800	
大気社	22,000	3,510.00	77,220,000	
ダイダン	10,000	2,640.00	26,400,000	
日比谷総合設備	14,500	1,868.00	27,086,000	
フィル・カンパニー	2,600	3,010.00	7,826,000	
テスホールディングス	8,200	1,707.00	13,997,400	貸付有価証券 100株（100株）
レイズネクスト	24,200	1,143.00	27,660,600	
ニッポン	42,300	1,589.00	67,214,700	
日清製粉グループ本社	163,400	1,663.00	271,734,200	貸付有価証券 800株
日東富士製粉	1,000	7,030.00	7,030,000	
昭和産業	12,200	2,979.00	36,343,800	
鳥越製粉	12,800	788.00	10,086,400	
中部飼料	17,700	1,157.00	20,478,900	
フィード・ワン	19,400	745.00	14,453,000	
東洋精糖	2,400	1,194.00	2,865,600	
日本甜菜製糖	7,500	1,639.00	12,292,500	
D M三井製糖ホールディ ングス	11,400	1,859.00	21,192,600	貸付有価証券 100株
塩水港精糖	17,200	221.00	3,801,200	
日新製糖	6,800	1,706.00	11,600,800	
森永製菓	33,900	3,505.00	118,819,500	貸付有価証券 300株
中村屋	3,500	3,780.00	13,230,000	

江崎グリコ	39,800	4,280.00	170,344,000	
名糖産業	6,400	1,565.00	10,016,000	
井村屋グループ	8,200	2,311.00	18,950,200	
不二家	9,200	2,197.00	20,212,400	
山崎製パン	108,400	1,579.00	171,163,600	貸付有価証券 5,900株
第一屋製パン	2,800	948.00	2,654,400	
モロゾフ	2,300	5,400.00	12,420,000	貸付有価証券 1,000株
亀田製菓	8,200	4,465.00	36,613,000	
寿スピリッツ	13,900	7,580.00	105,362,000	貸付有価証券 300株
カルビー	65,900	2,597.00	171,142,300	貸付有価証券 1,800株
森永乳業	26,800	5,870.00	157,316,000	
六甲バター	9,600	1,593.00	15,292,800	
ヤクルト本社	99,500	6,570.00	653,715,000	
明治ホールディングス	95,700	6,840.00	654,588,000	
雪印メグミルク	34,800	2,154.00	74,959,200	
プリマハム	20,300	2,930.00	59,479,000	
日本ハム	55,300	4,400.00	243,320,000	
林兼産業	4,800	608.00	2,918,400	
丸大食品	14,200	1,681.00	23,870,200	貸付有価証券 400株
S F o o d s	13,000	3,340.00	43,420,000	
柿安本店	5,000	2,576.00	12,880,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	93,100	703.00	65,449,300	貸付有価証券 800株
サッポロホールディングス	49,400	2,341.00	115,645,400	貸付有価証券 100株
アサヒグループホールディングス	316,000	5,478.00	1,731,048,000	貸付有価証券 100株
キリンホールディングス	613,500	2,231.00	1,368,718,500	貸付有価証券 400株
宝ホールディングス	107,200	1,402.00	150,294,400	
オエノンホールディングス	41,100	379.00	15,576,900	
養命酒製造	4,400	1,840.00	8,096,000	
コカ・コーラ ボトラー	110,800	1,780.00	197,224,000	

ズジャパンホールデ				
サントリー食品インター ナショナル	96,800	4,190.00	405,592,000	
ダイドーグループホール ディングス	8,200	5,050.00	41,410,000	貸付有価証券 800株
伊藤園	43,900	6,690.00	293,691,000	貸付有価証券 400株
キーコーヒー	14,200	2,124.00	30,160,800	
ユニカフェ	4,300	1,000.00	4,300,000	
ジャパンフーズ	2,100	1,212.00	2,545,200	
日清オイリオグループ	18,100	3,090.00	55,929,000	
不二製油グループ本社	35,300	2,700.00	95,310,000	
かどや製油	1,600	4,020.00	6,432,000	
J - オイルミルズ	13,500	1,904.00	25,704,000	
キッコーマン	104,100	7,360.00	766,176,000	貸付有価証券 300株
味の素	344,000	2,795.50	961,652,000	
ブルドックソース	6,600	2,298.00	15,166,800	貸付有価証券 3,000株
キュービー	80,500	2,503.00	201,491,500	
ハウス食品グループ本社	54,100	3,350.00	181,235,000	
カゴメ	59,100	2,981.00	176,177,100	貸付有価証券 300株
焼津水産化学工業	7,000	980.00	6,860,000	
アリアケジャパン	13,200	6,700.00	88,440,000	
ピエトロ	1,900	1,733.00	3,292,700	
エバラ食品工業	3,200	2,680.00	8,576,000	
やまみ	1,600	1,935.00	3,096,000	
ニチレイ	68,900	2,934.00	202,152,600	
東洋水産	74,400	4,380.00	325,872,000	貸付有価証券 800株
イートアンドホールディ ングス	5,000	1,899.00	9,495,000	貸付有価証券 1,500株
大冷	1,600	1,985.00	3,176,000	
ヨシムラ・フード・ホー ルディングス	8,100	766.00	6,204,600	貸付有価証券 200株
日清食品ホールディング ス	56,800	8,130.00	461,784,000	貸付有価証券 1,000株
永谷園ホールディングス	7,100	2,151.00	15,272,100	

一正簿録	5,600	942.00	5,275,200	貸付有価証券 2,600株
フジッコ	15,700	1,933.00	30,348,100	
ロック・フィールド	15,600	1,534.00	23,930,400	貸付有価証券 400株
日本たばこ産業	775,700	2,202.50	1,708,479,250	貸付有価証券 163,700株
ケンコーマヨネーズ	8,800	1,582.00	13,921,600	
わらべや日洋ホールディングス	9,500	2,121.00	20,149,500	
なとり	8,100	1,902.00	15,406,200	
イフジ産業	2,200	920.00	2,024,000	
ピクルスコーポレーション	3,500	3,210.00	11,235,000	
ファーマフーズ	13,700	2,699.00	36,976,300	貸付有価証券 6,400株（1,900株）
北の達人コーポレーション	50,500	500.00	25,250,000	貸付有価証券 21,300株（6,500株）
ユーグレナ	73,700	896.00	66,035,200	貸付有価証券 15,500株（2,300株）
紀文食品	8,400	1,411.00	11,852,400	貸付有価証券 700株（200株）
ミヨシ油脂	5,100	1,262.00	6,436,200	
理研ビタミン	13,700	1,529.00	20,947,300	
片倉工業	18,900	1,472.00	27,820,800	貸付有価証券 9,300株（7,400株）
グンゼ	10,400	4,570.00	47,528,000	
東洋紡	55,800	1,339.00	74,716,200	
ユニチカ	41,300	356.00	14,702,800	
富士紡ホールディングス	6,800	4,090.00	27,812,000	
倉敷紡績	13,000	1,954.00	25,402,000	
シキボウ	7,900	933.00	7,370,700	
日本毛織	46,400	988.00	45,843,200	貸付有価証券 5,000株（1,400株）
ダイトウボウ	22,800	104.00	2,371,200	貸付有価証券 100株
トーア紡コーポレーション	5,600	457.00	2,559,200	
ダイドーリミテッド	18,600	178.00	3,310,800	貸付有価証券 9,200株

帝国繊維	15,900	2,213.00	35,186,700	
帝人	132,900	1,732.00	230,182,800	貸付有価証券 2,700株
東レ	1,022,100	759.20	775,978,320	
サカイオーベックス	3,700	3,005.00	11,118,500	
住江織物	3,100	1,816.00	5,629,600	
日本フェルト	8,000	446.00	3,568,000	
イチカワ	1,800	1,366.00	2,458,800	
日東製網	1,500	1,516.00	2,274,000	
アツギ	10,900	622.00	6,779,800	
ダイニック	5,300	760.00	4,028,000	
セーレン	34,700	2,161.00	74,986,700	
ソトー	5,600	803.00	4,496,800	
東海染工	1,800	1,140.00	2,052,000	
小松マテーレ	23,200	960.00	22,272,000	
ワコールホールディングス	35,200	2,530.00	89,056,000	
ホギメディカル	19,000	3,435.00	65,265,000	
クラウドシアホールディングス	3,500	305.00	1,067,500	
T S Iホールディングス	42,900	328.00	14,071,200	
マツオカコーポレーション	4,500	1,634.00	7,353,000	
ワールド	18,500	1,464.00	27,084,000	貸付有価証券 100株
三陽商会	7,300	958.00	6,993,400	貸付有価証券 500株
ナイガイ	5,100	353.00	1,800,300	
オンワードホールディングス	84,800	355.00	30,104,000	貸付有価証券 22,500株
ルックホールディングス	4,800	1,495.00	7,176,000	
ゴールドウイン	23,400	6,540.00	153,036,000	
デサント	24,100	2,787.00	67,166,700	貸付有価証券 2,100株
キング	7,500	518.00	3,885,000	
ヤマトインターナショナル	12,400	342.00	4,240,800	
特種東海製紙	8,700	4,465.00	38,845,500	
王子ホールディングス	635,500	647.00	411,168,500	

日本製紙	62,400	1,250.00	78,000,000	貸付有価証券 900株
三菱製紙	20,000	357.00	7,140,000	貸付有価証券 1,000株
北越コーポレーション	101,000	589.00	59,489,000	貸付有価証券 27,200株（400株）
中越パルプ工業	5,400	1,232.00	6,652,800	
巴川製紙所	4,600	802.00	3,689,200	
大王製紙	68,100	1,851.00	126,053,100	
阿波製紙	3,600	419.00	1,508,400	
レンゴー	145,600	935.00	136,136,000	貸付有価証券 200株
トーモク	8,700	1,969.00	17,130,300	
ザ・パックス	10,700	2,769.00	29,628,300	
クラレ	222,300	1,076.00	239,194,800	
旭化成	935,700	1,234.00	1,154,653,800	
共和レザー	7,700	717.00	5,520,900	
昭和電工	107,200	3,370.00	361,264,000	貸付有価証券 2,400株
住友化学	1,111,200	591.00	656,719,200	
住友精化	6,900	3,575.00	24,667,500	
日産化学	77,900	5,390.00	419,881,000	
ラサ工業	4,600	1,851.00	8,514,600	
クレハ	12,100	6,280.00	75,988,000	
多木化学	5,500	5,350.00	29,425,000	貸付有価証券 2,100株（900株）
テイカ	10,400	1,350.00	14,040,000	
石原産業	25,300	1,161.00	29,373,300	
片倉コープアグリ	3,600	1,221.00	4,395,600	
日本曹達	19,700	3,360.00	66,192,000	
東ソー	218,200	1,924.00	419,816,800	
トクヤマ	41,900	2,255.00	94,484,500	
セントラル硝子	26,900	2,155.00	57,969,500	
東亜合成	86,100	1,142.00	98,326,200	
大阪ソーダ	14,400	2,504.00	36,057,600	
関東電化工業	33,500	1,021.00	34,203,500	貸付有価証券 200株
デンカ	51,500	3,725.00	191,837,500	貸付有価証券

				100株
信越化学工業	261,000	18,285.00	4,772,385,000	貸付有価証券 700株
日本カーバイド工業	5,100	1,284.00	6,548,400	
堺化学工業	9,900	1,864.00	18,453,600	貸付有価証券 200株
第一稀元素化学工業	14,200	1,926.00	27,349,200	
エア・ウォーター	143,900	1,718.00	247,220,200	
日本酸素ホールディングス	116,300	2,158.00	250,975,400	
日本化学工業	4,000	2,920.00	11,680,000	
東邦アセチレン	2,100	1,177.00	2,471,700	
日本パーカライジング	71,200	1,123.00	79,957,600	貸付有価証券 300株
高圧ガス工業	22,400	644.00	14,425,600	
チタン工業	1,800	1,871.00	3,367,800	
四国化成工業	18,800	1,336.00	25,116,800	
戸田工業	3,000	2,386.00	7,158,000	
ステラ ケミファ	7,700	3,020.00	23,254,000	
保土谷化学工業	4,100	3,995.00	16,379,500	
日本触媒	25,600	5,460.00	139,776,000	貸付有価証券 100株
大日精化工業	11,700	2,358.00	27,588,600	
カネカ	36,500	4,400.00	160,600,000	
三菱瓦斯化学	141,400	2,399.00	339,218,600	
三井化学	121,800	3,770.00	459,186,000	
J S R	141,700	3,350.00	474,695,000	
東京応化工業	24,200	7,000.00	169,400,000	
大阪有機化学工業	13,000	4,445.00	57,785,000	
三菱ケミカルホールディングス	943,700	933.40	880,849,580	
K Hネオケム	23,300	2,601.00	60,603,300	貸付有価証券 400株
ダイセル	189,800	910.00	172,718,000	
住友ベークライト	22,200	4,785.00	106,227,000	貸付有価証券 200株
積水化学工業	298,500	1,888.00	563,568,000	
日本ゼオン	127,300	1,530.00	194,769,000	
アイカ工業	39,300	4,060.00	159,558,000	貸付有価証券

				100株
宇部興産	71,300	2,290.00	163,277,000	
積水樹脂	23,300	2,156.00	50,234,800	
タキロンシーアイ	30,500	586.00	17,873,000	
旭有機材	8,000	1,346.00	10,768,000	
ニチバン	7,400	1,774.00	13,127,600	
リケンテクノス	34,400	621.00	21,362,400	
大倉工業	6,700	2,480.00	16,616,000	
積水化成成品工業	18,900	592.00	11,188,800	
群栄化学工業	3,200	2,456.00	7,859,200	貸付有価証券 100株
タイガースポリマー	7,400	442.00	3,270,800	
ミライアル	4,500	1,385.00	6,232,500	
ダイキアクシス	5,400	859.00	4,638,600	
ダイキョーニシカワ	29,800	683.00	20,353,400	
竹本容器	5,000	1,001.00	5,005,000	貸付有価証券 100株
森六ホールディングス	7,600	2,233.00	16,970,800	
恵和	2,800	3,315.00	9,282,000	
日本化薬	87,400	1,100.00	96,140,000	
カーリットホールディングス	14,000	741.00	10,374,000	
日本精化	10,200	1,514.00	15,442,800	
扶桑化学工業	11,100	4,055.00	45,010,500	
トリケミカル研究所	13,100	3,410.00	44,671,000	貸付有価証券 200株
A D E K A	65,000	2,012.00	130,780,000	貸付有価証券 800株
日油	53,200	5,830.00	310,156,000	
新日本理化	23,400	274.00	6,411,600	貸付有価証券 2,200株
ハリマ化成グループ	10,500	888.00	9,324,000	
花王	345,100	6,715.00	2,317,346,500	
第一工業製薬	4,800	3,275.00	15,720,000	
石原ケミカル	3,600	2,091.00	7,527,600	
日華化学	4,800	1,238.00	5,942,400	貸付有価証券 500株（500株）
ニイタカ	2,900	2,340.00	6,786,000	

三洋化成工業	8,400	5,480.00	46,032,000	
有機合成薬品工業	10,800	345.00	3,726,000	貸付有価証券 800株
大日本塗料	16,000	839.00	13,424,000	
日本ペイントホールディングス	582,400	1,650.00	960,960,000	貸付有価証券 100株
関西ペイント	158,600	2,934.00	465,332,400	貸付有価証券 1,200株
神東塗料	11,100	195.00	2,164,500	
中国塗料	34,000	867.00	29,478,000	
日本特殊塗料	10,600	1,070.00	11,342,000	
藤倉化成	19,000	527.00	10,013,000	
太陽ホールディングス	10,400	5,360.00	55,744,000	
D I C	59,600	2,858.00	170,336,800	
サカタインクス	30,800	1,055.00	32,494,000	
東洋インキＳＣホールディングス	29,800	2,080.00	61,984,000	貸付有価証券 9,700株
T & K T O K A	9,800	816.00	7,996,800	
富士フイルムホールディングス	253,300	7,957.00	2,015,508,100	貸付有価証券 600株
資生堂	286,400	7,951.00	2,277,166,400	
ライオン	187,400	1,944.00	364,305,600	貸付有価証券 400株
高砂香料工業	9,000	2,764.00	24,876,000	
マンダム	30,200	2,120.00	64,024,000	
ミルボン	19,300	6,140.00	118,502,000	貸付有価証券 100株
ファンケル	52,500	3,585.00	188,212,500	貸付有価証券 300株
コーセー	27,100	17,810.00	482,651,000	
コタ	9,100	1,434.00	13,049,400	
シーボン	1,900	1,998.00	3,796,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	61,500	2,993.00	184,069,500	
ノエビアホールディングス	12,200	5,600.00	68,320,000	
アジュバンコスメジャパン	3,200	1,044.00	3,340,800	
新日本製薬	3,900	2,201.00	8,583,900	貸付有価証券 400株

エステー	9,300	1,777.00	16,526,100	
アグロ カネショウ	5,400	1,451.00	7,835,400	
コニシ	23,700	1,621.00	38,417,700	
長谷川香料	24,800	2,412.00	59,817,600	
星光P M C	8,300	844.00	7,005,200	
小林製薬	40,400	9,690.00	391,476,000	
荒川化学工業	12,000	1,200.00	14,400,000	
メック	9,900	3,340.00	33,066,000	貸付有価証券 300株（300株）
日本高純度化学	4,000	2,928.00	11,712,000	
タカラバイオ	37,700	2,918.00	110,008,600	
J C U	16,200	3,635.00	58,887,000	
新田ゼラチン	9,000	639.00	5,751,000	
O A T アグリオ	2,700	1,442.00	3,893,400	
デクセリアルズ	40,300	2,246.00	90,513,800	貸付有価証券 400株
アース製薬	10,900	6,640.00	72,376,000	
北興化学工業	13,400	975.00	13,065,000	
大成ラミック	4,400	2,706.00	11,906,400	
クミアイ化学工業	59,600	865.00	51,554,000	
日本農薬	25,700	514.00	13,209,800	
アキレス	9,900	1,379.00	13,652,100	
有沢製作所	20,100	876.00	17,607,600	
日東電工	87,100	8,480.00	738,608,000	
レック	17,100	1,171.00	20,024,100	
三光合成	15,100	444.00	6,704,400	貸付有価証券 200株
きもと	22,100	265.00	5,856,500	
藤森工業	12,900	4,045.00	52,180,500	
前澤化成工業	9,200	1,263.00	11,619,600	貸付有価証券 4,500株
未来工業	5,200	1,734.00	9,016,800	
ウェーブロックホールディングス	5,000	695.00	3,475,000	
J S P	8,400	1,591.00	13,364,400	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	26,500	4,150.00	109,975,000	
天馬	10,800	2,589.00	27,961,200	

信越ポリマー	22,200	1,019.00	22,621,800	
東リ	35,900	243.00	8,723,700	
ニフコ	52,900	4,050.00	214,245,000	
バルカー	11,700	2,130.00	24,921,000	
ユニ・チャーム	305,600	4,410.00	1,347,696,000	
ショーエイコーポレーション	3,200	1,009.00	3,228,800	貸付有価証券 100株
協和キリン	145,000	3,865.00	560,425,000	
武田薬品工業	1,199,200	3,752.00	4,499,398,400	貸付有価証券 6,400株
アステラス製薬	1,249,700	1,991.00	2,488,152,700	貸付有価証券 2,000株
大日本住友製薬	106,800	2,246.00	239,872,800	
塩野義製薬	181,300	5,677.00	1,029,240,100	
わかもと製薬	17,100	320.00	5,472,000	貸付有価証券 300株
日本新薬	40,900	9,160.00	374,644,000	
ビオフェルミン製薬	2,400	3,040.00	7,296,000	
中外製薬	450,800	4,370.00	1,969,996,000	
科研製薬	24,700	4,760.00	117,572,000	貸付有価証券 100株
エーザイ	159,300	12,710.00	2,024,703,000	
ロート製薬	68,700	2,894.00	198,817,800	
小野薬品工業	331,000	2,512.50	831,637,500	
久光製薬	41,900	5,650.00	236,735,000	
持田製薬	20,000	3,705.00	74,100,000	
参天製薬	250,800	1,551.00	388,990,800	貸付有価証券 1,200株
扶桑薬品工業	4,700	2,296.00	10,791,200	
日本ケミファ	1,700	2,390.00	4,063,000	
ツムラ	48,100	3,555.00	170,995,500	貸付有価証券 300株
日医工	40,800	914.00	37,291,200	貸付有価証券 2,300株（2,300株）
キッセイ薬品工業	25,500	2,182.00	55,641,000	
生化学工業	25,400	1,095.00	27,813,000	
栄研化学	25,300	2,163.00	54,723,900	
日水製薬	5,300	969.00	5,135,700	

鳥居薬品	9,000	2,434.00	21,906,000	
J C R ファーマ	40,600	3,550.00	144,130,000	
東和薬品	20,700	2,673.00	55,331,100	
富士製薬工業	8,900	1,155.00	10,279,500	貸付有価証券 100株
ゼリア新薬工業	26,100	2,109.00	55,044,900	貸付有価証券 900株
第一三共	1,132,700	2,531.00	2,866,863,700	
キョーリン製薬ホールディングス	31,800	1,748.00	55,586,400	
大幸薬品	17,700	1,049.00	18,567,300	貸付有価証券 9,400株
ダイト	9,200	3,355.00	30,866,000	貸付有価証券 300株
大塚ホールディングス	299,600	4,748.00	1,422,500,800	
大正製薬ホールディングス	34,300	6,120.00	209,916,000	貸付有価証券 400株
ペプチドリーム	74,300	5,520.00	410,136,000	貸付有価証券 400株
あすか製薬ホールディングス	16,400	994.00	16,301,600	
サワイグループホールディングス	31,600	4,930.00	155,788,000	
日本コークス工業	121,800	102.00	12,423,600	貸付有価証券 200株
ニチレキ	17,000	1,312.00	22,304,000	
ユシロ化学工業	8,100	1,194.00	9,671,400	
ビーピー・カストロール	5,100	1,412.00	7,201,200	
富士石油	35,000	274.00	9,590,000	貸付有価証券 16,100株
MORESCO	5,200	1,098.00	5,709,600	
出光興産	160,000	2,650.00	424,000,000	
ENEOSホールディングス	2,168,300	466.00	1,010,427,800	
コスモエネルギーホールディングス	45,500	2,445.00	111,247,500	貸付有価証券 1,300株
横浜ゴム	83,500	2,404.00	200,734,000	
TOYO TIRE	75,900	2,337.00	177,378,300	
ブリヂストン	383,200	5,125.00	1,963,900,000	貸付有価証券 600株

住友ゴム工業	129,500	1,529.00	198,005,500	
藤倉コンポジット	12,600	486.00	6,123,600	貸付有価証券 400株
オカモト	8,800	4,330.00	38,104,000	
フコク	6,300	977.00	6,155,100	
ニッタ	14,900	2,737.00	40,781,300	
住友理工	27,900	724.00	20,199,600	
三ツ星ベルト	17,500	1,834.00	32,095,000	
バンドー化学	25,400	903.00	22,936,200	
日東紡績	21,400	3,620.00	77,468,000	
A G C	132,300	4,800.00	635,040,000	貸付有価証券 100株
日本板硝子	73,200	624.00	45,676,800	
石塚硝子	2,500	1,918.00	4,795,000	
日本山村硝子	6,000	937.00	5,622,000	
日本電気硝子	53,400	2,623.00	140,068,200	
オハラ	5,700	1,429.00	8,145,300	貸付有価証券 300株（300株）
住友大阪セメント	25,900	3,065.00	79,383,500	貸付有価証券 200株
太平洋セメント	85,300	2,425.00	206,852,500	貸付有価証券 100株
日本ヒューム	13,100	710.00	9,301,000	
日本コンクリート工業	31,000	329.00	10,199,000	
三谷セキサン	6,700	4,085.00	27,369,500	
アジアパイルホールディングス	22,200	479.00	10,633,800	
東海カーボン	140,900	1,588.00	223,749,200	
日本カーボン	7,900	4,345.00	34,325,500	
東洋炭素	8,500	2,764.00	23,494,000	
ノリタケカンパニーリミテド	8,000	4,185.00	33,480,000	
T O T O	103,000	6,000.00	618,000,000	貸付有価証券 100株
日本碍子	158,600	1,928.00	305,780,800	貸付有価証券 200株
日本特殊陶業	109,600	1,652.00	181,059,200	
ダントーホールディングス	10,700	254.00	2,717,800	貸付有価証券 6,700株

MARUWA	5,000	11,040.00	55,200,000	
品川リフラクトリーズ	3,400	3,720.00	12,648,000	
黒崎播磨	2,400	4,395.00	10,548,000	
ヨータイ	10,300	1,350.00	13,905,000	
イソライト工業	6,300	645.00	4,063,500	
東京窯業	18,300	322.00	5,892,600	
ニッカトー	6,500	715.00	4,647,500	
フジミインコーポレー テッド	11,600	5,170.00	59,972,000	
クニミネ工業	4,500	1,140.00	5,130,000	
エーアンドエーマテリア ル	2,800	1,017.00	2,847,600	
ニチアス	36,400	2,793.00	101,665,200	
ニチハ	20,000	2,960.00	59,200,000	
日本製鉄	680,400	1,838.00	1,250,575,200	貸付有価証券 200株
神戸製鋼所	260,900	694.00	181,064,600	貸付有価証券 1,800株
中山製鋼所	19,800	404.00	7,999,200	貸付有価証券 200株
合同製鐵	7,700	1,639.00	12,620,300	貸付有価証券 400株
ジェイ エフ イー ホールディングス	412,400	1,276.00	526,222,400	貸付有価証券 19,900株
東京製鐵	55,500	1,084.00	60,162,000	貸付有価証券 600株
共英製鋼	16,100	1,455.00	23,425,500	貸付有価証券 100株
大和工業	30,300	3,630.00	109,989,000	貸付有価証券 100株
東京鐵鋼	5,400	1,571.00	8,483,400	
大阪製鐵	7,600	1,102.00	8,375,200	
淀川製鋼所	18,700	2,233.00	41,757,100	
丸一鋼管	46,300	2,699.00	124,963,700	
モリ工業	4,200	2,423.00	10,176,600	
大同特殊鋼	23,300	5,460.00	127,218,000	貸付有価証券 200株
日本高周波鋼業	5,300	403.00	2,135,900	
日本冶金工業	11,100	2,222.00	24,664,200	

山陽特殊製鋼	17,100	1,598.00	27,325,800	
愛知製鋼	8,000	3,115.00	24,920,000	
日立金属	134,400	2,122.00	285,196,800	
日本金属	3,600	956.00	3,441,600	貸付有価証券 800株
大平洋金属	9,600	1,669.00	16,022,400	
新日本電工	91,900	299.00	27,478,100	貸付有価証券 9,200株
栗本鐵工所	6,400	1,662.00	10,636,800	
虹技	2,000	1,145.00	2,290,000	
日本鑄鉄管	1,600	1,243.00	1,988,800	
三菱製鋼	10,500	876.00	9,198,000	貸付有価証券 200株
日亜鋼業	20,800	293.00	6,094,400	
日本精線	2,000	4,770.00	9,540,000	
エンビプロ・ホールディングス	6,100	1,233.00	7,521,300	貸付有価証券 2,800株（500株）
シンニッタン	17,200	253.00	4,351,600	
新家工業	3,500	1,631.00	5,708,500	
大紀アルミニウム工業所	21,500	1,153.00	24,789,500	貸付有価証券 200株
日本軽金属ホールディングス	38,800	1,851.00	71,818,800	貸付有価証券 200株
三井金属鉱業	38,500	3,010.00	115,885,000	
東邦亜鉛	7,900	1,836.00	14,504,400	
三菱マテリアル	94,100	2,199.00	206,925,900	
住友金属鉱山	182,200	4,461.00	812,794,200	
DOWAホールディングス	36,100	4,310.00	155,591,000	
古河機械金属	23,500	1,232.00	28,952,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,800	776.00	11,484,800	貸付有価証券 2,300株（300株）
東邦チタニウム	25,500	1,039.00	26,494,500	貸付有価証券 700株
UACJ	21,600	2,835.00	61,236,000	
CKサンエツ	3,000	3,085.00	9,255,000	
古河電気工業	44,300	2,773.00	122,843,900	
住友電気工業	497,400	1,653.50	822,450,900	
フジクラ	172,100	470.00	80,887,000	

昭和電線ホールディングス	13,800	1,686.00	23,266,800	
東京特殊電線	1,800	2,530.00	4,554,000	
タツタ電線	25,100	555.00	13,930,500	
カナレ電気	2,400	1,810.00	4,344,000	貸付有価証券 1,100株
平河ヒューテック	7,900	1,205.00	9,519,500	
リョービ	17,500	1,588.00	27,790,000	
アーレスティ	17,500	482.00	8,435,000	
アサヒホールディングス	53,500	2,181.00	116,683,500	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
稲葉製作所	8,000	1,493.00	11,944,000	貸付有価証券 3,700株
宮地エンジニアリンググループ	4,600	2,305.00	10,603,000	
トーカロ	36,800	1,416.00	52,108,800	
アルファＣｏ	5,000	1,140.00	5,700,000	
SUMCO	181,800	2,632.00	478,497,600	
川田テクノロジーズ	2,900	3,415.00	9,903,500	
RS Technologies	4,600	6,400.00	29,440,000	
ジェイテックコーポレーション	1,600	3,030.00	4,848,000	
信和	7,600	705.00	5,358,000	
東洋製罐グループホールディングス	90,800	1,585.00	143,918,000	
ホッカンホールディングス	7,200	1,411.00	10,159,200	
コロナ	7,900	916.00	7,236,400	
横河ブリッジホールディングス	24,500	2,079.00	50,935,500	
駒井ハルテック	2,900	1,738.00	5,040,200	
高田機工	1,300	2,697.00	3,506,100	貸付有価証券 600株
三和ホールディングス	134,400	1,386.00	186,278,400	
文化シャッター	42,000	1,097.00	46,074,000	
三協立山	18,400	804.00	14,793,600	
アルインコ	9,400	1,014.00	9,531,600	
東洋シャッター	3,100	652.00	2,021,200	
LIXIL	196,300	3,020.00	592,826,000	

				貸付有価証券 2,300株
日本フィルコン	9,900	500.00	4,950,000	
ノーリツ	29,600	1,898.00	56,180,800	
長府製作所	14,500	2,018.00	29,261,000	
リンナイ	27,700	10,630.00	294,451,000	
ダイニチ工業	6,800	783.00	5,324,400	
日東精工	17,900	570.00	10,203,000	
三洋工業	1,700	1,865.00	3,170,500	
岡部	28,900	665.00	19,218,500	
ジーテクト	17,700	1,564.00	27,682,800	貸付有価証券 100株
東ブレ	26,600	1,585.00	42,161,000	
高周波熱錬	27,400	572.00	15,672,800	
東京製綱	10,200	1,166.00	11,893,200	
サンコール	12,200	456.00	5,563,200	
モリテック スチール	11,100	507.00	5,627,700	貸付有価証券 3,100株
パイオラックス	21,100	1,505.00	31,755,500	
エイチワン	14,000	757.00	10,598,000	
日本発條	142,000	906.00	128,652,000	
中央発條	6,900	1,276.00	8,804,400	
アドバネクス	2,000	1,260.00	2,520,000	
立川ブラインド工業	6,300	1,343.00	8,460,900	
三益半導体工業	11,100	2,807.00	31,157,700	
日本ドライケミカル	3,500	1,744.00	6,104,000	
日本製鋼所	43,300	2,883.00	124,833,900	
三浦工業	61,700	4,925.00	303,872,500	
タクマ	48,300	1,728.00	83,462,400	貸付有価証券 300株
ツガミ	29,500	1,668.00	49,206,000	
オークマ	16,600	5,400.00	89,640,000	
芝浦機械	14,800	2,569.00	38,021,200	
アマダ	208,900	1,123.00	234,594,700	
アイダエンジニアリング	37,300	903.00	33,681,900	
滝澤鉄工所	4,100	1,134.00	4,649,400	
F U J I	56,900	2,564.00	145,891,600	

牧野フライス製作所	16,700	4,420.00	73,814,000	
オーエスジー	70,300	1,843.00	129,562,900	貸付有価証券 2,500株
ダイジェット工業	1,600	1,285.00	2,056,000	
旭ダイヤモンド工業	37,400	528.00	19,747,200	
D M G 森精機	90,200	1,997.00	180,129,400	貸付有価証券 200株
ソディック	34,200	1,087.00	37,175,400	
ディスコ	19,400	34,750.00	674,150,000	
日東工器	6,800	1,863.00	12,668,400	
日進工具	11,200	1,501.00	16,811,200	貸付有価証券 200株（200株）
パンチ工業	11,900	640.00	7,616,000	
富士ダイス	7,200	643.00	4,629,600	
豊和工業	7,900	815.00	6,438,500	
O K K	5,500	405.00	2,227,500	
東洋機械金属	10,200	536.00	5,467,200	
津田駒工業	2,700	901.00	2,432,700	
エンシュウ	3,400	858.00	2,917,200	
島精機製作所	20,800	1,971.00	40,996,800	
オプトラン	17,900	2,438.00	43,640,200	
N C ホールディングス	4,300	1,052.00	4,523,600	
イワキポンプ	9,100	980.00	8,918,000	
フリーー	13,900	1,253.00	17,416,700	貸付有価証券 300株
ヤマシンフィルタ	28,700	729.00	20,922,300	貸付有価証券 12,700株（100株）
日阪製作所	17,600	818.00	14,396,800	
やまびこ	27,600	1,232.00	34,003,200	
平田機工	6,700	6,570.00	44,019,000	
ペガサスミシン製造	14,400	485.00	6,984,000	
マルマエ	5,800	2,436.00	14,128,800	
タツモ	6,000	1,792.00	10,752,000	
ナブテスコ	84,000	4,285.00	359,940,000	
三井海洋開発	15,100	2,132.00	32,193,200	
レオン自動機	14,000	1,448.00	20,272,000	
S M C	42,200	64,480.00	2,721,056,000	
ホソカワミクロン	5,000	6,010.00	30,050,000	

ユニオンツール	5,300	3,910.00	20,723,000	
オイレス工業	20,000	1,604.00	32,080,000	貸付有価証券 1,800株
日精エー・エス・ピー機 械	4,800	5,000.00	24,000,000	
サトーホールディングス	18,800	2,691.00	50,590,800	
技研製作所	12,600	4,475.00	56,385,000	
日本エアーテック	4,700	1,319.00	6,199,300	貸付有価証券 300株
カワタ	3,900	867.00	3,381,300	貸付有価証券 300株
日精樹脂工業	11,000	1,353.00	14,883,000	
オカダアイヨン	4,500	1,310.00	5,895,000	
ワイエイシイホールディ ングス	5,700	1,197.00	6,822,900	
小松製作所	653,000	2,853.00	1,863,009,000	
住友重機械工業	82,500	3,135.00	258,637,500	貸付有価証券 100株
日立建機	67,400	3,355.00	226,127,000	
日工	21,500	681.00	14,641,500	
巴工業	5,700	2,306.00	13,144,200	
井関農機	14,400	1,517.00	21,844,800	貸付有価証券 300株
T O W A	13,400	2,283.00	30,592,200	
丸山製作所	2,900	1,803.00	5,228,700	
北川鉄工所	6,500	1,679.00	10,913,500	貸付有価証券 100株
ローツェ	6,300	9,870.00	62,181,000	
タカキタ	5,000	628.00	3,140,000	
クボタ	757,200	2,306.00	1,746,103,200	
荏原実業	3,600	6,680.00	24,048,000	
三菱化工機	4,600	2,687.00	12,360,200	貸付有価証券 400株
月島機械	26,500	1,202.00	31,853,000	
帝国電機製作所	10,100	1,290.00	13,029,000	
東京機械製作所	5,900	755.00	4,454,500	貸付有価証券 2,600株
新東工業	34,200	787.00	26,915,400	貸付有価証券 100株

澁谷工業	12,600	3,300.00	41,580,000	
アイチ コーポレーション	24,500	844.00	20,678,000	
小森コーポレーション	36,500	817.00	29,820,500	
鶴見製作所	11,100	1,787.00	19,835,700	
住友精密工業	2,100	2,579.00	5,415,900	
日本ギア工業	5,800	324.00	1,879,200	
酒井重工業	2,500	2,557.00	6,392,500	
荏原製作所	59,800	5,570.00	333,086,000	
石井鐵工所	2,000	3,035.00	6,070,000	
西島製作所	14,500	865.00	12,542,500	
北越工業	14,800	1,129.00	16,709,200	
ダイキン工業	183,600	21,230.00	3,897,828,000	貸付有価証券 500株
オルガノ	4,700	6,280.00	29,516,000	
トーヨーカネツ	5,400	2,516.00	13,586,400	
栗田工業	78,000	5,290.00	412,620,000	
椿本チエイン	20,600	3,170.00	65,302,000	
大同工業	6,800	1,200.00	8,160,000	
木村化工機	12,000	925.00	11,100,000	貸付有価証券 700株
アネスト岩田	24,300	1,032.00	25,077,600	
ダイフク	79,300	9,770.00	774,761,000	
サムコ	3,600	3,410.00	12,276,000	貸付有価証券 1,100株（800株）
加藤製作所	7,900	984.00	7,773,600	
油研工業	2,400	1,730.00	4,152,000	
タダノ	69,500	1,116.00	77,562,000	貸付有価証券 100株
フジテック	49,600	2,519.00	124,942,400	
C K D	33,400	2,365.00	78,991,000	
キトー	12,100	1,701.00	20,582,100	
平和	40,200	1,950.00	78,390,000	
理想科学工業	10,600	1,748.00	18,528,800	
S A N K Y O	34,300	2,825.00	96,897,500	貸付有価証券 100株
日本金銭機械	15,900	567.00	9,015,300	
マースグループホール	9,200	1,635.00	15,042,000	

ディングス				
フクシマガリレイ	9,900	4,815.00	47,668,500	
オーイズミ	6,000	380.00	2,280,000	貸付有価証券 200株
ダイコク電機	6,600	902.00	5,953,200	
竹内製作所	24,100	2,740.00	66,034,000	
アマノ	37,700	2,828.00	106,615,600	
J U K I	20,100	812.00	16,321,200	
蛇の目ミシン工業	13,100	753.00	9,864,300	貸付有価証券 1,200株
マックス	19,300	1,792.00	34,585,600	
グローリー	37,000	2,323.00	85,951,000	
新晃工業	13,400	1,910.00	25,594,000	
大和冷機工業	23,100	1,065.00	24,601,500	
セガサミーホールディングス	131,000	1,467.00	192,177,000	貸付有価証券 4,200株
日本ピストンリング	5,200	1,271.00	6,609,200	
リケン	6,700	2,536.00	16,991,200	
T P R	19,400	1,496.00	29,022,400	
ツバキ・ナカシマ	27,700	1,782.00	49,361,400	
ホシザキ	45,400	9,770.00	443,558,000	
大豊工業	11,700	1,010.00	11,817,000	貸付有価証券 100株
日本精工	296,000	989.00	292,744,000	貸付有価証券 1,000株
N T N	333,600	297.00	99,079,200	
ジェイテクト	138,300	1,169.00	161,672,700	
不二越	13,400	4,185.00	56,079,000	
日本トムソン	39,500	599.00	23,660,500	
T H K	89,800	3,305.00	296,789,000	
ユーシン精機	9,600	807.00	7,747,200	
前澤給装工業	10,000	1,063.00	10,630,000	
イーグル工業	17,800	1,109.00	19,740,200	
前澤工業	8,600	608.00	5,228,800	
日本ピラー工業	14,600	2,190.00	31,974,000	貸付有価証券 100株
キッツ	44,500	789.00	35,110,500	
マキタ	188,000	5,130.00	964,440,000	貸付有価証券

				2,300株
日立造船	114,300	704.00	80,467,200	貸付有価証券 5,000株
三菱重工業	226,500	3,357.00	760,360,500	
I H I	96,900	2,681.00	259,788,900	貸付有価証券 100株
スター精密	22,200	1,775.00	39,405,000	貸付有価証券 300株
日清紡ホールディングス	88,100	945.00	83,254,500	
イビデン	69,300	6,070.00	420,651,000	貸付有価証券 1,600株
コニカミノルタ	292,400	637.00	186,258,800	
ブラザー工業	176,000	2,307.00	406,032,000	貸付有価証券 7,300株
ミネベアミツミ	248,400	2,849.00	707,691,600	貸付有価証券 700株
日立製作所	693,000	6,258.00	4,336,794,000	貸付有価証券 5,200株
東芝	285,200	4,815.00	1,373,238,000	貸付有価証券 1,000株
三菱電機	1,441,300	1,720.00	2,479,036,000	貸付有価証券 1,100株
富士電機	86,900	5,260.00	457,094,000	
東洋電機製造	5,700	1,179.00	6,720,300	
安川電機	155,100	5,280.00	818,928,000	貸付有価証券 5,100株
シンフォニアテクノロジー	18,700	1,289.00	24,104,300	
明電舎	24,400	2,258.00	55,095,200	
オリジン	3,900	1,331.00	5,190,900	
山洋電気	7,000	7,600.00	53,200,000	
デンヨー	12,300	2,027.00	24,932,100	
東芝テック	15,500	4,720.00	73,160,000	
芝浦メカトロニクス	2,600	8,110.00	21,086,000	
マブチモーター	39,900	4,230.00	168,777,000	貸付有価証券 400株
日本電産	346,900	12,765.00	4,428,178,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,500	737.00	5,527,500	貸付有価証券 600株（600株）
トレックス・セミコンダ	7,800	3,100.00	24,180,000	貸付有価証券

クター				300株
東光高岳	7,300	1,387.00	10,125,100	
ダブル・スコープ	34,100	637.00	21,721,700	貸付有価証券 900株
ダイヘン	15,800	4,710.00	74,418,000	
ヤーマン	23,500	1,369.00	32,171,500	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
JVCケンウッド	124,800	242.00	30,201,600	
ミマキエンジニアリング	12,900	730.00	9,417,000	
I - P E X	6,700	2,444.00	16,374,800	貸付有価証券 300株
日新電機	33,800	1,361.00	46,001,800	
大崎電気工業	28,700	612.00	17,564,400	
オムロン	120,000	8,660.00	1,039,200,000	
日東工業	21,200	1,828.00	38,753,600	
I D E C	19,300	2,110.00	40,723,000	
正興電機製作所	4,500	1,629.00	7,330,500	貸付有価証券 600株
不二電機工業	2,400	1,280.00	3,072,000	貸付有価証券 1,100株
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	51,800	2,787.00	144,366,600	
サクサホールディングス	3,400	1,331.00	4,525,400	
メルコホールディングス	5,000	5,480.00	27,400,000	
テクノメディカ	3,200	1,622.00	5,190,400	
ダイヤモンドエレクト リックホールディング	4,200	2,730.00	11,466,000	貸付有価証券 1,800株
日本電気	183,100	5,510.00	1,008,881,000	貸付有価証券 1,500株
富士通	129,700	20,005.00	2,594,648,500	
沖電気工業	58,500	1,018.00	59,553,000	貸付有価証券 100株
岩崎通信機	6,300	950.00	5,985,000	
電気興業	6,900	2,250.00	15,525,000	
サンケン電気	16,800	4,940.00	82,992,000	貸付有価証券 700株（500株）
ナカヨ	2,800	1,452.00	4,065,600	
アイホン	8,200	2,103.00	17,244,600	
ルネサスエレクトロニク ス	689,300	1,175.00	809,927,500	貸付有価証券 183,700株（49,500

				株)
セイコーエプソン	178,800	1,981.00	354,202,800	貸付有価証券 5,200株
ワコム	104,300	694.00	72,384,200	貸付有価証券 49,000株
アルバック	26,500	5,570.00	147,605,000	
アクセル	6,000	889.00	5,334,000	
E I Z O	12,200	4,890.00	59,658,000	
日本信号	33,600	921.00	30,945,600	貸付有価証券 300株
京三製作所	30,900	434.00	13,410,600	貸付有価証券 2,200株
能美防災	19,100	2,082.00	39,766,200	
ホーチキ	10,400	1,175.00	12,220,000	
星和電機	7,100	522.00	3,706,200	
エレコム	33,000	2,036.00	67,188,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
パナソニック	1,537,100	1,255.00	1,929,060,500	
シャープ	191,700	1,863.00	357,137,100	貸付有価証券 11,200株(3,400株)
アンリツ	86,600	2,040.00	176,664,000	貸付有価証券 40,500株(1,000株)
富士通ゼネラル	44,000	2,901.00	127,644,000	貸付有価証券 100株
ソニーグループ	902,900	10,870.00	9,814,523,000	貸付有価証券 2,100株
T D K	69,600	13,280.00	924,288,000	
帝国通信工業	6,400	1,123.00	7,187,200	
タムラ製作所	51,900	1,032.00	53,560,800	貸付有価証券 24,300株(4,900株)
アルプスアルパイン	117,800	1,169.00	137,708,200	貸付有価証券 100株
池上通信機	4,600	843.00	3,877,800	
日本電波工業	13,900	1,055.00	14,664,500	
鈴木	6,400	1,005.00	6,432,000	
日本トリム	3,100	3,870.00	11,997,000	
ローランド ディー・ ジー	8,500	2,649.00	22,516,500	
フォスター電機	14,500	984.00	14,268,000	
S M K	3,700	2,507.00	9,275,900	

ヨコオ	11,200	2,344.00	26,252,800	
ティアック	9,100	124.00	1,128,400	貸付有価証券 800株
ホシデン	39,400	1,000.00	39,400,000	
ヒロセ電機	22,200	16,070.00	356,754,000	
日本航空電子工業	33,000	1,914.00	63,162,000	
ＴＯＡ	17,000	903.00	15,351,000	
マクセルホールディングス	28,600	1,227.00	35,092,200	貸付有価証券 100株
古野電気	18,600	1,030.00	19,158,000	
ユニデンホールディングス	3,700	2,660.00	9,842,000	
スミダコーポレーション	12,300	1,177.00	14,477,100	
アイコム	6,000	2,419.00	14,514,000	
リオン	6,100	2,752.00	16,787,200	
本多通信工業	11,200	488.00	5,465,600	
船井電機	6,500	916.00	5,954,000	貸付有価証券 1,300株
横河電機	144,200	1,687.00	243,265,400	
新電元工業	5,600	4,995.00	27,972,000	
アズビル	97,500	4,670.00	455,325,000	
東亜ディーケーケー	7,100	825.00	5,857,500	貸付有価証券 200株
日本光電工業	59,600	3,165.00	188,634,000	
チノー	4,600	1,463.00	6,729,800	
共和電業	15,100	382.00	5,768,200	
日本電子材料	5,900	1,948.00	11,493,200	貸付有価証券 2,300株（1,800株）
堀場製作所	28,500	7,230.00	206,055,000	
アドバンテスト	107,200	10,000.00	1,072,000,000	貸付有価証券 400株
小野測器	6,000	549.00	3,294,000	
エスベック	12,800	2,214.00	28,339,200	貸付有価証券 100株
キーエンス	141,500	56,900.00	8,051,350,000	貸付有価証券 100株
日置電機	6,900	5,890.00	40,641,000	
シスメックス	112,500	12,405.00	1,395,562,500	
日本マイクロニクス	25,100	1,578.00	39,607,800	

メガチップス	14,400	3,400.00	48,960,000	
O B A R A G R O U P	6,500	3,830.00	24,895,000	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
澤藤電機	1,500	2,034.00	3,051,000	貸付有価証券 200株
原田工業	5,800	921.00	5,341,800	
コーセル	17,600	1,128.00	19,852,800	
イリソ電子工業	12,100	5,260.00	63,646,000	
オブテックスグループ	23,600	1,943.00	45,854,800	
千代田インテグレ	6,100	1,768.00	10,784,800	
アイ・オー・データ機器	5,300	1,048.00	5,554,400	
レーザーテック	63,300	21,790.00	1,379,307,000	
スタンレー電気	100,900	3,285.00	331,456,500	貸付有価証券 100株
岩崎電気	5,300	1,942.00	10,292,600	
ウシオ電機	73,900	1,801.00	133,093,900	
岡谷電機産業	10,300	351.00	3,615,300	
ヘリオス テクノ ホー ルディング	13,300	341.00	4,535,300	
エノモト	4,000	1,756.00	7,024,000	
日本セラミック	14,600	2,896.00	42,281,600	
遠藤照明	7,300	767.00	5,599,100	
古河電池	10,300	1,580.00	16,274,000	貸付有価証券 4,500株
双信電機	7,000	577.00	4,039,000	貸付有価証券 200株
山一電機	9,400	1,684.00	15,829,600	
図研	9,400	3,220.00	30,268,000	
日本電子	26,200	6,690.00	175,278,000	貸付有価証券 200株
カシオ計算機	115,900	1,913.00	221,716,700	貸付有価証券 800株
ファナック	126,500	26,575.00	3,361,737,500	貸付有価証券 300株
日本シイエムケイ	31,000	443.00	13,733,000	貸付有価証券 500株
エンプラス	6,500	3,800.00	24,700,000	
大真空	4,900	4,280.00	20,972,000	
ローム	59,900	10,260.00	614,574,000	

浜松ホトニクス	103,400	6,840.00	707,256,000	貸付有価証券 500株
三井ハイテック	14,100	6,500.00	91,650,000	
新光電気工業	48,400	3,965.00	191,906,000	
京セラ	219,700	6,819.00	1,498,134,300	貸付有価証券 1,200株
太陽誘電	64,100	5,340.00	342,294,000	
村田製作所	423,400	8,409.00	3,560,370,600	
双葉電子工業	24,700	789.00	19,488,300	
北陸電気工業	5,400	1,018.00	5,497,200	
ニチコン	45,400	1,160.00	52,664,000	
日本ケミコン	14,500	2,479.00	35,945,500	
K O A	19,900	1,607.00	31,979,300	
市光工業	21,500	727.00	15,630,500	
小糸製作所	86,300	6,860.00	592,018,000	
ミツバ	26,500	848.00	22,472,000	
S C R E E Nホールディングス	25,000	10,770.00	269,250,000	
キャノン電子	13,200	1,740.00	22,968,000	
キャノン	716,200	2,594.50	1,858,180,900	貸付有価証券 300株
リコー	366,700	1,336.00	489,911,200	貸付有価証券 1,800株
象印マホービン	39,000	1,740.00	67,860,000	
M U T O Hホールディングス	1,800	1,570.00	2,826,000	貸付有価証券 200株
東京エレクトロン	84,400	48,320.00	4,078,208,000	貸付有価証券 100株
トヨタ紡織	42,000	2,280.00	95,760,000	
芦森工業	2,700	1,042.00	2,813,400	
ユニプレス	23,600	910.00	21,476,000	貸付有価証券 100株
豊田自動織機	116,600	9,690.00	1,129,854,000	
モリタホールディングス	23,100	1,600.00	36,960,000	
三櫻工業	19,900	1,204.00	23,959,600	貸付有価証券 1,100株（700株）
デンソー	317,300	7,576.00	2,403,864,800	貸付有価証券 1,400株
東海理化電機製作所	38,000	1,736.00	65,968,000	

三井E & Sホールディングス	55,800	505.00	28,179,000	
川崎重工業	112,200	2,323.00	260,640,600	貸付有価証券 200株
名村造船所	43,300	182.00	7,880,600	貸付有価証券 2,000株（800株）
サノヤスホールディングス	17,700	148.00	2,619,600	
日本車輛製造	5,300	2,129.00	11,283,700	
三菱ロジスネクスト	19,100	1,019.00	19,462,900	貸付有価証券 6,200株
近畿車輛	2,500	1,201.00	3,002,500	
日産自動車	1,699,900	542.70	922,535,730	
いすゞ自動車	382,700	1,511.00	578,259,700	
トヨタ自動車	1,460,200	9,960.00	14,543,592,000	貸付有価証券 8,200株
日野自動車	180,000	956.00	172,080,000	
三菱自動車工業	533,500	300.00	160,050,000	貸付有価証券 51,900株
エフテック	10,000	875.00	8,750,000	
レシップホールディングス	5,700	563.00	3,209,100	
G M B	2,600	1,021.00	2,654,600	
ファルテック	2,500	765.00	1,912,500	
武蔵精密工業	32,100	2,378.00	76,333,800	貸付有価証券 200株
日産車体	21,100	741.00	15,635,100	
新明和工業	40,700	957.00	38,949,900	
極東開発工業	24,900	1,651.00	41,109,900	
トピー工業	11,900	1,296.00	15,422,400	
ティラド	4,500	2,795.00	12,577,500	
タチエス	22,100	1,453.00	32,111,300	貸付有価証券 100株
N O K	69,700	1,308.00	91,167,600	
フタバ産業	36,100	511.00	18,447,100	
K Y B	16,100	3,785.00	60,938,500	
大同メタル工業	29,800	617.00	18,386,600	
プレス工業	71,400	343.00	24,490,200	貸付有価証券 600株

ミクニ	18,300	307.00	5,618,100	
太平洋工業	30,200	1,138.00	34,367,600	
河西工業	19,400	402.00	7,798,800	貸付有価証券 200株
アイシン	105,500	4,730.00	499,015,000	
マツダ	452,400	977.00	441,994,800	貸付有価証券 900株
今仙電機製作所	12,600	715.00	9,009,000	
本田技研工業	1,134,800	3,519.00	3,993,361,200	貸付有価証券 100株
スズキ	285,700	4,663.00	1,332,219,100	
S U B A R U	413,000	2,207.50	911,697,500	貸付有価証券 300株
安永	6,900	1,201.00	8,286,900	
ヤマハ発動機	203,700	3,235.00	658,969,500	
T B K	17,100	414.00	7,079,400	
エクセディ	19,600	1,642.00	32,183,200	貸付有価証券 500株
豊田合成	46,600	2,707.00	126,146,200	貸付有価証券 100株
愛三工業	22,600	882.00	19,933,200	
盟和産業	2,200	981.00	2,158,200	
日本プラスト	12,200	731.00	8,918,200	
ヨロズ	12,300	1,221.00	15,018,300	
エフ・シー・シー	23,600	1,599.00	37,736,400	
シマノ	53,900	26,000.00	1,401,400,000	
テイ・エス テック	66,900	1,661.00	111,120,900	
ジャムコ	8,400	1,125.00	9,450,000	貸付有価証券 400株（300株）
テルモ	441,800	4,479.00	1,978,822,200	貸付有価証券 1,900株
クリエートメディック	4,800	1,014.00	4,867,200	
日機装	46,500	1,155.00	53,707,500	
日本エム・ディ・エム	8,300	2,182.00	18,110,600	
島津製作所	185,500	4,165.00	772,607,500	貸付有価証券 1,700株
J M S	12,200	829.00	10,113,800	
クボテック	3,700	328.00	1,213,600	貸付有価証券 100株（100株）

長野計器	10,400	1,112.00	11,564,800	
ブイ・テクノロジー	6,800	5,500.00	37,400,000	
東京計器	9,200	1,078.00	9,917,600	
愛知時計電機	1,900	4,195.00	7,970,500	
インターアクション	7,200	2,444.00	17,596,800	
オーバル	12,900	275.00	3,547,500	
東京精密	24,300	5,070.00	123,201,000	
マニー	57,400	2,476.00	142,122,400	
ニコン	220,100	1,196.00	263,239,600	
トプコン	72,600	1,688.00	122,548,800	
オリンパス	797,500	2,299.00	1,833,452,500	
理研計器	12,700	2,775.00	35,242,500	
タムロン	11,600	2,461.00	28,547,600	
H O Y A	283,600	14,720.00	4,174,592,000	
シード	5,600	829.00	4,642,400	
ノーリツ鋼機	13,000	2,321.00	30,173,000	
エー・アンド・デイ	12,100	1,031.00	12,475,100	
朝日インテック	151,700	2,623.00	397,909,100	貸付有価証券 700株
シチズン時計	182,900	424.00	77,549,600	
リズム	4,500	793.00	3,568,500	
大研医器	11,400	555.00	6,327,000	
メニコン	22,200	7,620.00	169,164,000	貸付有価証券 700株
シンシア	1,500	641.00	961,500	
松風	6,600	2,022.00	13,345,200	
セイコーホールディングス	20,400	2,276.00	46,430,400	
ニプロ	107,400	1,334.00	143,271,600	
中本パックス	3,700	1,583.00	5,857,100	
スノーピーク	8,500	3,250.00	27,625,000	貸付有価証券 3,100株
パラマウントベッドホールディングス	27,600	2,003.00	55,282,800	
トランザクション	7,900	1,406.00	11,107,400	貸付有価証券 200株
粧美堂	4,200	423.00	1,776,600	貸付有価証券 100株

ニホンフラッシュ	12,300	1,263.00	15,534,900	
前田工織	15,900	3,410.00	54,219,000	貸付有価証券 200株
永大産業	18,800	305.00	5,734,000	
アートネイチャー	13,900	695.00	9,660,500	
バンダイナムコホールディングス	119,200	7,687.00	916,290,400	
アイフィスジャパン	3,700	697.00	2,578,900	
共立印刷	24,100	138.00	3,325,800	
S H O E I	13,500	4,095.00	55,282,500	
フランスベッドホールディングス	18,500	926.00	17,131,000	
パイロットコーポレーション	24,300	3,790.00	92,097,000	
萩原工業	8,000	1,430.00	11,440,000	
トッパン・フォームズ	25,700	1,089.00	27,987,300	
フジシールインターナショナル	29,600	2,387.00	70,655,200	
タカラトミー	64,600	948.00	61,240,800	
廣済堂	10,000	788.00	7,880,000	
エステールホールディングス	3,800	649.00	2,466,200	
タカノ	4,900	640.00	3,136,000	貸付有価証券 1,100株
プロネクサス	11,600	1,031.00	11,959,600	
ホクシン	8,900	158.00	1,406,200	貸付有価証券 4,300株
ウッドワン	4,800	1,237.00	5,937,600	貸付有価証券 100株
大建工業	9,700	2,071.00	20,088,700	
凸版印刷	219,100	1,837.00	402,486,700	
大日本印刷	174,100	2,418.00	420,973,800	
共同印刷	4,400	2,710.00	11,924,000	
N I S S H A	29,600	1,669.00	49,402,400	
光村印刷	1,200	1,604.00	1,924,800	
T A K A R A & C O M P A N Y	7,100	1,709.00	12,133,900	貸付有価証券 2,200株
アシックス	127,400	2,569.00	327,290,600	
ツツミ	3,600	2,383.00	8,578,800	

ローランド	11,200	5,770.00	64,624,000	貸付有価証券 200株（200株）
小松ウオール工業	4,400	1,983.00	8,725,200	
ヤマハ	85,700	6,270.00	537,339,000	貸付有価証券 100株
河合楽器製作所	4,000	3,850.00	15,400,000	
クリナップ	13,400	514.00	6,887,600	貸付有価証券 100株
ビジョン	92,500	3,205.00	296,462,500	貸付有価証券 8,800株
オリバー	3,000	2,720.00	8,160,000	貸付有価証券 400株
兼松サステック	900	1,817.00	1,635,300	
キングジム	11,600	896.00	10,393,600	
リンテック	30,900	2,440.00	75,396,000	
イトーキ	28,600	370.00	10,582,000	
任天堂	82,500	65,190.00	5,378,175,000	
三菱鉛筆	23,700	1,448.00	34,317,600	
タカラスタANDARD	29,800	1,550.00	46,190,000	貸付有価証券 100株
コクヨ	69,100	1,813.00	125,278,300	
ナカバヤシ	14,200	595.00	8,449,000	
グローブライド	7,000	4,170.00	29,190,000	
オカムラ	49,500	1,524.00	75,438,000	貸付有価証券 3,900株
美津濃	14,300	2,310.00	33,033,000	
東京電力ホールディングス	1,222,500	339.00	414,427,500	
中部電力	441,000	1,377.00	607,257,000	
関西電力	546,100	1,074.00	586,511,400	貸付有価証券 500株
中国電力	207,900	1,026.00	213,305,400	
北陸電力	131,800	618.00	81,452,400	貸付有価証券 200株
東北電力	337,600	887.00	299,451,200	
四国電力	119,800	776.00	92,964,800	
九州電力	318,300	870.00	276,921,000	貸付有価証券 20,600株
北海道電力	134,900	516.00	69,608,400	

沖縄電力	28,000	1,391.00	38,948,000	
電源開発	114,700	1,617.00	185,469,900	貸付有価証券 2,000株（900株）
エフオン	8,700	940.00	8,178,000	貸付有価証券 2,200株
イーレックス	21,200	2,063.00	43,735,600	貸付有価証券 6,900株（6,800株）
レノバ	24,500	4,115.00	100,817,500	貸付有価証券 11,500株（4,000株）
東京瓦斯	277,200	2,148.50	595,564,200	
大阪瓦斯	261,000	2,106.00	549,666,000	
東邦瓦斯	70,900	5,690.00	403,421,000	貸付有価証券 3,200株
北海道瓦斯	7,700	1,573.00	12,112,100	貸付有価証券 100株
広島ガス	29,700	376.00	11,167,200	
西部ガスホールディングス	16,200	2,483.00	40,224,600	
静岡ガス	40,900	962.00	39,345,800	
メタウォーター	16,200	2,111.00	34,198,200	
S B Sホールディングス	10,700	3,380.00	36,166,000	
東武鉄道	150,200	2,956.00	443,991,200	貸付有価証券 500株
相鉄ホールディングス	49,400	2,239.00	110,606,600	貸付有価証券 1,200株
東急	363,500	1,583.00	575,420,500	
京浜急行電鉄	185,100	1,426.00	263,952,600	貸付有価証券 3,400株
小田急電鉄	230,900	2,907.00	671,226,300	貸付有価証券 2,800株
京王電鉄	80,500	6,790.00	546,595,000	貸付有価証券 400株
京成電鉄	108,000	3,720.00	401,760,000	貸付有価証券 300株
富士急行	19,600	5,490.00	107,604,000	貸付有価証券 2,100株
新京成電鉄	3,700	2,144.00	7,932,800	
東日本旅客鉄道	253,700	8,276.00	2,099,621,200	貸付有価証券 600株
西日本旅客鉄道	128,400	6,676.00	857,198,400	
東海旅客鉄道	119,800	17,550.00	2,102,490,000	

西武ホールディングス	173,700	1,360.00	236,232,000	
鴻池運輸	22,900	1,191.00	27,273,900	
西日本鉄道	40,000	2,766.00	110,640,000	
ハマキョウレックス	11,100	3,250.00	36,075,000	
サカイ引越センター	6,600	5,820.00	38,412,000	
近鉄グループホールディングス	136,500	4,030.00	550,095,000	貸付有価証券 300株
阪急阪神ホールディングス	182,100	3,585.00	652,828,500	
南海電気鉄道	64,700	2,435.00	157,544,500	貸付有価証券 300株
京阪ホールディングス	60,800	3,410.00	207,328,000	
神戸電鉄	3,200	3,505.00	11,216,000	貸付有価証券 1,500株
名古屋鉄道	112,200	2,094.00	234,946,800	貸付有価証券 10,900株
山陽電気鉄道	9,700	1,929.00	18,711,300	
アルプス物流	9,500	1,000.00	9,500,000	貸付有価証券 5,400株（5,400株）
日本通運	47,300	8,680.00	410,564,000	
ヤマトホールディングス	191,300	3,110.00	594,943,000	
山九	35,000	4,855.00	169,925,000	
丸運	7,800	269.00	2,098,200	
丸全昭和運輸	11,100	3,460.00	38,406,000	
センコーグループホールディングス	75,300	1,071.00	80,646,300	貸付有価証券 3,700株（3,700株）
トナミホールディングス	3,300	4,770.00	15,741,000	
ニッコンホールディングス	45,800	2,433.00	111,431,400	
日本石油輸送	1,500	2,573.00	3,859,500	
福山通運	17,500	4,315.00	75,512,500	
セイノーホールディングス	102,200	1,465.00	149,723,000	
エスライン	3,700	896.00	3,315,200	
神奈川中央交通	3,400	3,560.00	12,104,000	
日立物流	30,000	4,600.00	138,000,000	貸付有価証券 100株
丸和運輸機関	28,800	1,594.00	45,907,200	貸付有価証券 4,500株

C & F ロジホールディングス	13,800	1,652.00	22,797,600	
九州旅客鉄道	105,600	2,560.00	270,336,000	
S G ホールディングス	257,900	2,861.00	737,851,900	貸付有価証券 2,800株
日本郵船	114,100	5,670.00	646,947,000	
商船三井	81,000	5,300.00	429,300,000	貸付有価証券 100株
川崎汽船	42,000	3,850.00	161,700,000	貸付有価証券 600株
N S ユナイテッド海運	6,400	2,389.00	15,289,600	貸付有価証券 200株
明治海運	14,500	517.00	7,496,500	貸付有価証券 100株
飯野海運	63,400	456.00	28,910,400	
共栄タンカー	2,400	883.00	2,119,200	
乾汽船	9,300	1,200.00	11,160,000	
日本航空	332,600	2,568.00	854,116,800	貸付有価証券 1,000株
A N A ホールディングス	368,400	2,769.50	1,020,283,800	
パスコ	2,600	1,676.00	4,357,600	
トランコム	4,200	8,190.00	34,398,000	
日新	10,900	1,509.00	16,448,100	
三菱倉庫	47,200	3,455.00	163,076,000	
三井倉庫ホールディングス	14,500	2,460.00	35,670,000	
住友倉庫	48,200	1,592.00	76,734,400	貸付有価証券 100株
澁澤倉庫	7,500	2,100.00	15,750,000	
東陽倉庫	22,900	326.00	7,465,400	貸付有価証券 100株
日本トランスシティ	30,000	546.00	16,380,000	貸付有価証券 100株
ケイヒン	2,600	1,367.00	3,554,200	
中央倉庫	8,300	1,052.00	8,731,600	
川西倉庫	2,500	1,129.00	2,822,500	
安田倉庫	11,200	960.00	10,752,000	
ファイズホールディングス	2,400	844.00	2,025,600	貸付有価証券 200株
東洋埠頭	4,200	1,508.00	6,333,600	

宇徳	9,700	540.00	5,238,000	
上組	75,100	2,304.00	173,030,400	
サンリツ	3,500	736.00	2,576,000	
キムラユニティー	3,600	1,332.00	4,795,200	
キューソー流通システム	3,400	1,716.00	5,834,400	
近鉄エクスプレス	25,800	2,371.00	61,171,800	貸付有価証券 200株
東海運	7,800	313.00	2,441,400	
エーアイティー	8,600	1,033.00	8,883,800	
内外トランスライン	4,800	1,947.00	9,345,600	
日本コンセプト	4,300	1,641.00	7,056,300	
NEC ネットエスアイ	46,800	1,766.00	82,648,800	貸付有価証券 400株
クロスキャット	3,700	974.00	3,603,800	
システナ	50,400	2,005.00	101,052,000	
デジタルアーツ	8,200	8,560.00	70,192,000	
日鉄ソリューションズ	20,500	3,580.00	73,390,000	
キューブシステム	7,500	1,019.00	7,642,500	貸付有価証券 800株
エイジア	2,200	2,039.00	4,485,800	
コア	6,000	1,413.00	8,478,000	
ラクーンホールディングス	10,000	2,312.00	23,120,000	貸付有価証券 3,000株（1,600株）
ソリトンシステムズ	7,100	1,633.00	11,594,300	貸付有価証券 600株
ソフトクリエイイトホールディングス	5,500	2,320.00	12,760,000	
T I S	141,400	2,789.00	394,364,600	貸付有価証券 800株
J N S ホールディングス	7,000	589.00	4,123,000	
電算システム	5,300	3,055.00	16,191,500	
グリー	86,700	612.00	53,060,400	
GMOベパボ	1,200	4,835.00	5,802,000	貸付有価証券 500株
コーエーテクモホールディングス	37,600	5,250.00	197,400,000	
三菱総合研究所	6,100	3,905.00	23,820,500	
ボルテージ	3,800	475.00	1,805,000	貸付有価証券 1,200株（1,000株）

電算	1,600	2,408.00	3,852,800	
A G S	7,200	873.00	6,285,600	
ファインデックス	11,900	1,036.00	12,328,400	貸付有価証券 800株（800株）
ブレインパッド	3,700	4,735.00	17,519,500	
K L a b	25,900	697.00	18,052,300	貸付有価証券 1,100株（500株）
ポールトゥウィン・ピット クルーホールディ	18,800	1,107.00	20,811,600	
イーブクイニシアティ ブジャパン	2,300	3,085.00	7,095,500	貸付有価証券 800株
ネクソン	357,900	2,519.00	901,550,100	貸付有価証券 1,000株
アイスタイル	43,100	505.00	21,765,500	貸付有価証券 600株
エムアップホールディン グス	3,700	3,265.00	12,080,500	貸付有価証券 100株
エイチーム	9,700	1,528.00	14,821,600	貸付有価証券 100株
エニグモ	13,400	1,357.00	18,183,800	
テクノスジャパン	11,000	611.00	6,721,000	
e n i s h	7,400	576.00	4,262,400	貸付有価証券 2,300株
コロプラ	46,500	833.00	38,734,500	貸付有価証券 1,600株
オルトプラス	10,900	419.00	4,567,100	貸付有価証券 200株（100株）
ブロードリーフ	70,100	520.00	36,452,000	貸付有価証券 43,600株
クロス・マーケティング グループ	6,300	699.00	4,403,700	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
デジタルハーツホール ディングス	6,400	1,506.00	9,638,400	
システム情報	10,600	955.00	10,123,000	貸付有価証券 1,300株
メディアドゥ	5,500	4,570.00	25,135,000	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
じげん	35,000	423.00	14,805,000	貸付有価証券 700株
ブイキューブ	7,700	2,618.00	20,158,600	貸付有価証券 1,600株

エンカレッジ・テクノロジー	2,500	665.00	1,662,500	
サイバーリンクス	4,700	1,710.00	8,037,000	貸付有価証券 1,800株（600株）
ディー・エル・イー	11,400	315.00	3,591,000	貸付有価証券 6,900株（4,900株）
フィックスターズ	15,000	869.00	13,035,000	
CARTAHOLDINGS	5,700	1,725.00	9,832,500	貸付有価証券 3,500株（3,500株）
オブティム	9,900	2,290.00	22,671,000	貸付有価証券 4,100株（1,500株）
セレス	4,700	3,365.00	15,815,500	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
SHIFT	7,100	16,610.00	117,931,000	貸付有価証券 3,100株（3,100株）
ティーガイア	15,100	1,961.00	29,611,100	
セック	2,100	2,640.00	5,544,000	
日本アジアグループ	13,700	961.00	13,165,700	貸付有価証券 500株
テクマトリックス	21,900	1,764.00	38,631,600	
プロシップ	4,100	1,390.00	5,699,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	34,100	2,219.00	75,667,900	
GMOペイメントゲートウェイ	27,100	14,250.00	386,175,000	貸付有価証券 6,200株
ザッパラス	5,500	526.00	2,893,000	
システムリサーチ	4,100	2,236.00	9,167,600	
インターネットイニシアティブ	37,700	3,235.00	121,959,500	
さくらインターネット	15,200	632.00	9,606,400	貸付有価証券 3,500株（1,000株）
ヴィンクス	4,000	1,010.00	4,040,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,100	5,050.00	15,655,000	貸付有価証券 1,400株（1,100株）
SRAホールディングス	7,500	2,664.00	19,980,000	
システムインテグレータ	4,000	647.00	2,588,000	
朝日ネット	11,500	709.00	8,153,500	
eBASE	16,900	856.00	14,466,400	
アバント	15,100	1,624.00	24,522,400	
アドソル日進	5,000	2,351.00	11,755,000	

ODKソリューションズ	2,900	802.00	2,325,800	貸付有価証券 100株
フリービット	8,400	797.00	6,694,800	貸付有価証券 100株
コムチュア	13,000	2,369.00	30,797,000	貸付有価証券 300株（300株）
サイバーコム	2,500	1,503.00	3,757,500	
アステリア	10,200	838.00	8,547,600	貸付有価証券 600株
アイル	7,800	1,466.00	11,434,800	
マークラインズ	5,900	3,080.00	18,172,000	
メディカル・データ・ビ ジョン	16,100	2,225.00	35,822,500	
g u m i	19,600	852.00	16,699,200	貸付有価証券 9,500株（3,700株）
ショーケース	3,000	776.00	2,328,000	貸付有価証券 1,300株
モバイルファクトリー	3,200	1,232.00	3,942,400	貸付有価証券 200株
テラスカイ	4,600	2,661.00	12,240,600	貸付有価証券 2,800株（1,000株）
デジタル・インフォメー ション・テクノロジー	6,200	2,010.00	12,462,000	
P C I ホールディングス	6,300	1,219.00	7,679,700	
パイプドHD	2,900	1,691.00	4,903,900	
アイビーシー	2,300	989.00	2,274,700	
ネオジャパン	2,700	1,564.00	4,222,800	貸付有価証券 1,200株（300株）
P R T I M E S	3,000	3,465.00	10,395,000	貸付有価証券 1,200株（200株）
ラクス	42,600	2,518.00	107,266,800	貸付有価証券 100株
ランドコンピュータ	2,100	1,109.00	2,328,900	
ダブルスタンダード	1,800	5,440.00	9,792,000	貸付有価証券 500株（500株）
オープンドア	8,400	2,370.00	19,908,000	貸付有価証券 4,100株（2,100株）
マイネット	4,600	792.00	3,643,200	
アカツキ	5,700	3,595.00	20,491,500	
ベネフィットジャパン	1,100	2,023.00	2,225,300	
U b i c o mホールディ	3,700	3,535.00	13,079,500	

ングス				
カナミックネットワーク	15,100	671.00	10,132,100	
ノムラシステムコーポレーション	6,200	296.00	1,835,200	
チェンジ	26,000	2,895.00	75,270,000	貸付有価証券 12,200株（600株）
シンクロ・フード	8,400	389.00	3,267,600	
オークネット	7,500	1,419.00	10,642,500	
キャピタル・アセット・プランニング	2,800	1,029.00	2,881,200	
セグエグループ	3,600	1,111.00	3,999,600	
エイトレッド	2,700	2,211.00	5,969,700	
A O I T Y O H o l d i n g s	14,300	898.00	12,841,400	貸付有価証券 300株（100株）
マクロミル	28,900	875.00	25,287,500	
ビーグリー	2,800	1,415.00	3,962,000	
オロ	4,500	3,875.00	17,437,500	
ユーザーローカル	2,100	4,530.00	9,513,000	
テモナ	3,100	1,230.00	3,813,000	貸付有価証券 300株（300株）
ニーズウェル	2,900	620.00	1,798,000	
サインポスト	3,400	929.00	3,158,600	貸付有価証券 1,500株
ソルクシーズ	5,400	1,002.00	5,410,800	貸付有価証券 700株
フェイス	4,300	743.00	3,194,900	
プロトコーポレーション	16,900	1,277.00	21,581,300	
ハイマックス	4,000	1,083.00	4,332,000	
野村総合研究所	245,700	3,655.00	898,033,500	
サイバネットシステム	10,000	817.00	8,170,000	
C E ホールディングス	7,500	529.00	3,967,500	
日本システム技術	2,500	1,526.00	3,815,000	
インテージホールディングス	17,600	1,561.00	27,473,600	
東邦システムサイエンス	3,700	956.00	3,537,200	
ソースネクスト	67,100	322.00	21,606,200	貸付有価証券 15,600株（15,600株）
インフォコム	12,900	3,010.00	38,829,000	
H E R O Z	4,000	2,227.00	8,908,000	貸付有価証券

				1,800株
ラクスル	15,400	4,755.00	73,227,000	貸付有価証券 200株
I P S	3,300	2,825.00	9,322,500	貸付有価証券 700株
F I G	15,300	282.00	4,314,600	
システムサポート	4,200	1,383.00	5,808,600	
イーソル	7,700	1,092.00	8,408,400	貸付有価証券 2,000株
アルテリア・ネットワー クス	15,700	1,662.00	26,093,400	
E d u L a b	1,300	5,300.00	6,890,000	
東海ソフト	2,200	1,495.00	3,289,000	
ウイングアーク 1 s t	7,400	2,214.00	16,383,600	貸付有価証券 3,400株（600株）
ヒト・コミュニケーション ズ・ホールディン	3,200	2,207.00	7,062,400	
サーバーワークス	1,400	4,010.00	5,614,000	貸付有価証券 300株
東名	1,300	1,063.00	1,381,900	
ヴィッツ	1,300	2,079.00	2,702,700	貸付有価証券 200株
トビラシステムズ	1,900	1,365.00	2,593,500	貸付有価証券 700株（600株）
S a n s a n	12,600	9,670.00	121,842,000	貸付有価証券 400株
L i n k - U	2,500	1,304.00	3,260,000	貸付有価証券 1,100株（100株）
ギフトィ	8,500	3,365.00	28,602,500	貸付有価証券 1,500株（1,500株）
ベース	1,600	5,570.00	8,912,000	
フォーカスシステムズ	9,500	1,053.00	10,003,500	貸付有価証券 4,400株
クレスコ	9,300	1,800.00	16,740,000	
フジ・メディア・ホール ディングス	146,700	1,233.00	180,881,100	
オービック	44,600	20,870.00	930,802,000	
ジャストシステム	20,100	6,430.00	129,243,000	
T D C ソフト	12,400	1,003.00	12,437,200	
Zホールディングス	1,943,000	543.50	1,056,020,500	貸付有価証券 1,000株

トレンドマイクロ	75,600	5,760.00	435,456,000	
I Dホールディングス	5,400	1,354.00	7,311,600	貸付有価証券 100株
日本オラクル	28,700	9,900.00	284,130,000	
アルファシステムズ	3,800	3,685.00	14,003,000	
フューチャー	17,100	1,958.00	33,481,800	
C A C H o l d i n g s	9,200	1,443.00	13,275,600	
S Bテクノロジー	5,100	3,030.00	15,453,000	貸付有価証券 100株
トーセ	3,800	822.00	3,123,600	
オービックビジネスコン サルタント	13,500	6,550.00	88,425,000	
伊藤忠テクノソリュー ションズ	64,400	3,375.00	217,350,000	
アイティフォー	18,400	787.00	14,480,800	
東計電算	2,100	4,845.00	10,174,500	
エックスネット	2,200	1,019.00	2,241,800	
大塚商会	76,500	5,870.00	449,055,000	
サイボウズ	16,500	2,585.00	42,652,500	貸付有価証券 400株
電通国際情報サービス	17,500	4,170.00	72,975,000	
A C C E S S	17,700	881.00	15,593,700	
デジタルガレージ	23,400	4,705.00	110,097,000	
E Mシステムズ	23,300	843.00	19,641,900	
ウェザーニューズ	4,200	5,550.00	23,310,000	
C I J	9,600	844.00	8,102,400	
ビジネスエンジニアリン グ	1,400	3,200.00	4,480,000	貸付有価証券 600株
日本エンタープライズ	14,400	213.00	3,067,200	
WOWOW	6,800	2,392.00	16,265,600	
スカラ	12,600	782.00	9,853,200	
インテリジェント ウェ イブ	8,300	658.00	5,461,400	貸付有価証券 100株
I M A G I C A G R O U P	12,000	453.00	5,436,000	
ネットワンシステムズ	57,700	3,585.00	206,854,500	
システムソフト	29,200	164.00	4,788,800	貸付有価証券 3,600株（1,900株）

アルゴグラフィックス	11,000	3,385.00	37,235,000	
マーベラス	22,300	761.00	16,970,300	
エイベックス	24,300	1,610.00	39,123,000	
日本ユニシス	49,100	3,275.00	160,802,500	
兼松エレクトロニクス	7,700	3,660.00	28,182,000	
都築電気	6,300	1,811.00	11,409,300	
T B S ホールディングス	93,800	1,756.00	164,712,800	
日本テレビホールディングス	118,100	1,279.00	151,049,900	貸付有価証券 2,700株
朝日放送グループホールディングス	14,000	711.00	9,954,000	貸付有価証券 100株
テレビ朝日ホールディングス	43,700	1,762.00	76,999,400	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	93,100	421.00	39,195,100	貸付有価証券 300株
テレビ東京ホールディングス	10,100	2,119.00	21,401,900	
日本ＢＳ放送	4,800	1,109.00	5,323,200	貸付有価証券 100株
ビジョン	17,600	1,231.00	21,665,600	
スマートバリュー	3,700	750.00	2,775,000	貸付有価証券 1,700株
USEN - NEXT HOLDINGS	13,400	2,324.00	31,141,600	貸付有価証券 400株（400株）
ワイヤレスゲート	5,800	437.00	2,534,600	貸付有価証券 1,200株
コネクシオ	8,000	1,530.00	12,240,000	
日本通信	125,000	221.00	27,625,000	貸付有価証券 16,800株（16,800株）
クロップス	2,600	855.00	2,223,000	
日本電信電話	1,654,300	2,917.00	4,825,593,100	貸付有価証券 9,300株
KDDI	1,134,200	3,513.00	3,984,444,600	貸付有価証券 3,500株
ソフトバンク	1,285,300	1,433.50	1,842,477,550	貸付有価証券 100株
光通信	16,700	19,740.00	329,658,000	
エムティーアイ	13,700	664.00	9,096,800	
GMOインターネット	50,100	3,040.00	152,304,000	
ファイバーゲート	4,600	1,506.00	6,927,600	貸付有価証券

				2,000株
アйдママーケティング コミュニケーション	3,600	420.00	1,512,000	
K A D O K A W A	36,600	4,645.00	170,007,000	貸付有価証券 400株
学研ホールディングス	20,000	1,353.00	27,060,000	
ゼンリン	25,600	1,145.00	29,312,000	
昭文社ホールディングス	5,700	476.00	2,713,200	
インプレスホールディング ス	11,700	198.00	2,316,600	
アイネット	7,300	1,426.00	10,409,800	
松竹	9,400	13,010.00	122,294,000	貸付有価証券 1,100株
東宝	83,500	4,625.00	386,187,500	
東映	4,600	20,160.00	92,736,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	376,600	1,749.00	658,673,400	
ピー・シー・エー	2,100	4,005.00	8,410,500	貸付有価証券 300株
ビジネスブレイン太田昭 和	4,800	1,717.00	8,241,600	
D T S	29,300	2,620.00	76,766,000	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	60,300	5,530.00	333,459,000	
シーイーシー	15,100	1,584.00	23,918,400	
カプコン	121,200	3,220.00	390,264,000	
アイ・エス・ビー	6,500	1,449.00	9,418,500	貸付有価証券 100株
ジャステック	9,000	1,296.00	11,664,000	貸付有価証券 300株
S C S K	32,600	6,510.00	212,226,000	
日本システムウエア	4,700	2,290.00	10,763,000	
アイネス	13,900	1,335.00	18,556,500	貸付有価証券 100株
T K C	23,900	3,385.00	80,901,500	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
富士ソフト	15,100	5,760.00	86,976,000	
N S D	45,500	1,832.00	83,356,000	
コナミホールディングス	51,400	6,940.00	356,716,000	
福井コンピュータホール	6,500	4,230.00	27,495,000	貸付有価証券

ディングス				100株
J B C C ホールディングス	9,500	1,432.00	13,604,000	
ミロク情報サービス	14,000	1,599.00	22,386,000	
ソフトバンクグループ	1,122,200	7,702.00	8,643,184,400	貸付有価証券 1,500株
ハウスイ	1,100	954.00	1,049,400	
高千穂交易	5,500	1,111.00	6,110,500	貸付有価証券 2,100株
オルパヘルスケアホールディングス	2,300	1,702.00	3,914,600	貸付有価証券 900株
伊藤忠食品	3,400	5,190.00	17,646,000	
エレマテック	11,400	1,277.00	14,557,800	貸付有価証券 400株
J A L U X	4,000	1,850.00	7,400,000	
あらた	11,300	4,310.00	48,703,000	
トーメンデバイス	1,800	3,990.00	7,182,000	
東京エレクトロン デバイス	4,700	5,690.00	26,743,000	貸付有価証券 300株
フィールズ	12,400	479.00	5,939,600	
双日	784,100	340.00	266,594,000	貸付有価証券 4,800株
アルフレッサ ホールディングス	147,200	1,696.00	249,651,200	
横浜冷凍	39,800	900.00	35,820,000	
神栄	1,900	1,330.00	2,527,000	貸付有価証券 600株
ラサ商事	7,500	905.00	6,787,500	
アルコニックス	15,100	1,456.00	21,985,600	
神戸物産	97,900	3,370.00	329,923,000	
ハイパー	2,900	547.00	1,586,300	
あい ホールディングス	20,300	2,158.00	43,807,400	
ディー・ビー・エックス	4,300	997.00	4,287,100	
ダイワボウホールディングス	64,700	1,849.00	119,630,300	
マクニカ・富士エレホールディングス	33,800	2,630.00	88,894,000	
ラクト・ジャパン	6,200	2,746.00	17,025,200	
グリムス	4,200	1,791.00	7,522,200	
バイタルケーエスケー・	24,700	754.00	18,623,800	

ホールディングス				
八洲電機	11,000	972.00	10,692,000	
メディアスホールディングス	8,000	1,058.00	8,464,000	貸付有価証券 3,700株（100株）
レスターホールディングス	14,800	1,925.00	28,490,000	
ジューテックホールディングス	3,200	1,018.00	3,257,600	
大光	5,400	691.00	3,731,400	貸付有価証券 1,800株
O C H I ホールディングス	4,100	1,277.00	5,235,700	
T O K A I ホールディングス	68,800	890.00	61,232,000	
黒谷	3,800	859.00	3,264,200	
C o m i n i x	2,500	737.00	1,842,500	
三洋貿易	14,300	1,332.00	19,047,600	
ビューティガレージ	2,300	4,930.00	11,339,000	貸付有価証券 800株
ウイン・パートナーズ	10,200	1,000.00	10,200,000	
ミタチ産業	3,900	675.00	2,632,500	
シップヘルスケアホールディングス	50,000	2,596.00	129,800,000	貸付有価証券 1,700株（1,400株）
明治電機工業	4,900	1,375.00	6,737,500	
デリカフーズホールディングス	5,500	650.00	3,575,000	貸付有価証券 2,500株
スターティアホールディングス	2,700	1,610.00	4,347,000	貸付有価証券 1,200株
コメダホールディングス	31,000	2,059.00	63,829,000	
ピーバンドットコム	1,900	809.00	1,537,100	
アセンテック	3,600	1,387.00	4,993,200	貸付有価証券 800株
富士興産	4,300	1,209.00	5,198,700	
協栄産業	1,600	1,374.00	2,198,400	
小野建	12,700	1,281.00	16,268,700	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
南陽	2,900	1,874.00	5,434,600	
佐鳥電機	8,800	829.00	7,295,200	貸付有価証券 100株
エコートレーディング	3,000	610.00	1,830,000	

伯東	8,600	1,537.00	13,218,200	
コンドーテック	11,000	993.00	10,923,000	
中山福	8,100	464.00	3,758,400	
ナガイレーベン	18,800	2,618.00	49,218,400	
三菱食品	15,600	2,951.00	46,035,600	
松田産業	10,300	2,117.00	21,805,100	
第一興商	28,200	4,355.00	122,811,000	
メディパルホールディングス	142,200	2,185.00	310,707,000	
S P K	6,100	1,348.00	8,222,800	
萩原電気ホールディングス	5,200	2,426.00	12,615,200	
アズワン	10,200	14,180.00	144,636,000	
スズデン	4,900	1,479.00	7,247,100	
尾家産業	4,100	1,257.00	5,153,700	
シモジマ	8,700	1,108.00	9,639,600	
ドウシシャ	13,400	1,683.00	22,552,200	
小津産業	3,100	1,929.00	5,979,900	貸付有価証券 700株
高速	7,500	1,460.00	10,950,000	
たけびし	5,000	1,544.00	7,720,000	
リックス	3,200	1,506.00	4,819,200	
丸文	12,600	635.00	8,001,000	
ハピネット	11,800	1,463.00	17,263,400	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
橋本総業ホールディングス	2,900	2,999.00	8,697,100	
日本ライフライン	45,900	1,377.00	63,204,300	
タカショー	9,200	800.00	7,360,000	
マルカ	4,600	2,480.00	11,408,000	
I D O M	47,800	628.00	30,018,400	
進和	8,400	2,165.00	18,186,000	
エスケイジャパン	3,400	452.00	1,536,800	貸付有価証券 1,900株
ダイトロン	6,000	2,001.00	12,006,000	
シークス	18,000	1,570.00	28,260,000	
田中商事	4,300	683.00	2,936,900	
オーハシテクニカ	7,300	1,520.00	11,096,000	

白銅	5,100	2,119.00	10,806,900	
ダイコー通産	1,700	1,391.00	2,364,700	
伊藤忠商事	992,900	3,275.00	3,251,747,500	
丸紅	1,399,900	978.10	1,369,242,190	貸付有価証券 3,000株
高島	2,200	1,837.00	4,041,400	
長瀬産業	77,900	1,660.00	129,314,000	
蝶理	9,100	1,732.00	15,761,200	
豊田通商	142,600	5,270.00	751,502,000	
三共生興	21,500	538.00	11,567,000	
兼松	56,700	1,463.00	82,952,100	
ツカモトコーポレーション	2,400	1,339.00	3,213,600	
三井物産	1,132,400	2,528.00	2,862,707,200	
日本紙パルプ商事	7,400	3,585.00	26,529,000	
カメイ	18,500	1,133.00	20,960,500	
東都水産	1,600	4,880.00	7,808,000	貸付有価証券 700株
ＯＵＧホールディングス	2,200	2,817.00	6,197,400	
スターゼン	10,500	2,144.00	22,512,000	
山善	55,400	995.00	55,123,000	貸付有価証券 3,200株（3,000株）
椿本興業	2,600	3,380.00	8,788,000	
住友商事	895,900	1,503.50	1,346,985,650	
内田洋行	6,100	4,815.00	29,371,500	
三菱商事	864,300	3,018.00	2,608,457,400	
第一実業	6,400	4,325.00	27,680,000	
キャノンマーケティング ジャパン	35,200	2,566.00	90,323,200	
西華産業	7,500	1,802.00	13,515,000	
佐藤商事	11,700	1,107.00	12,951,900	
菱洋エレクトロ	10,800	2,550.00	27,540,000	
東京産業	12,800	611.00	7,820,800	
ユアサ商事	14,500	3,135.00	45,457,500	貸付有価証券 100株
神鋼商事	3,200	2,378.00	7,609,600	
トルク	8,500	244.00	2,074,000	
阪和興業	28,400	3,260.00	92,584,000	

正栄食品工業	9,200	3,840.00	35,328,000	
カナデン	11,500	1,052.00	12,098,000	
菱電商事	10,200	1,631.00	16,636,200	
フルサト工業	7,200	1,917.00	13,802,400	貸付有価証券 3,200株
岩谷産業	34,100	6,390.00	217,899,000	
ナイス	5,600	2,064.00	11,558,400	
昭光通商	3,000	793.00	2,379,000	貸付有価証券 1,800株
ニチモウ	2,200	2,069.00	4,551,800	
極東貿易	4,100	2,428.00	9,954,800	
アステナホールディングス	20,400	655.00	13,362,000	貸付有価証券 900株
三愛石油	34,900	1,277.00	44,567,300	
稲畑産業	34,100	1,709.00	58,276,900	貸付有価証券 100株
G S I クレオス	6,900	1,005.00	6,934,500	
明和産業	13,100	468.00	6,130,800	
クワザワホールディングス	5,000	615.00	3,075,000	
ヤマエ久野	10,300	1,132.00	11,659,600	
ワキタ	27,900	1,100.00	30,690,000	
東邦ホールディングス	45,500	1,783.00	81,126,500	
サンゲツ	38,300	1,594.00	61,050,200	
ミツウロコグループホールディングス	20,900	1,220.00	25,498,000	
シナネンホールディングス	5,300	3,055.00	16,191,500	
伊藤忠エネクス	31,400	973.00	30,552,200	
サンリオ	39,900	1,936.00	77,246,400	
サンワテクノス	9,300	1,179.00	10,964,700	
リョーサン	15,700	2,061.00	32,357,700	
新光商事	19,100	744.00	14,210,400	
トーヨー	6,400	1,621.00	10,374,400	
三信電気	7,600	2,146.00	16,309,600	貸付有価証券 3,600株（900株）
東陽テクニカ	14,000	1,080.00	15,120,000	貸付有価証券 100株
モスフードサービス	20,100	3,070.00	61,707,000	

加賀電子	12,800	3,020.00	38,656,000	
ソーダニッカ	13,500	558.00	7,533,000	
立花エレテック	10,500	1,459.00	15,319,500	貸付有価証券 3,500株
フォーバル	5,000	869.00	4,345,000	
P A L T A C	22,800	5,750.00	131,100,000	
三谷産業	18,700	385.00	7,199,500	
太平洋興発	5,600	641.00	3,589,600	
西本Wismettac ホールディングス	3,200	2,783.00	8,905,600	
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,300	1,891.00	2,458,300	
コア商事ホールディン グス	10,600	716.00	7,589,600	貸付有価証券 4,900株
国際紙パルプ商事	30,200	252.00	7,610,400	
ヤマタネ	6,100	1,517.00	9,253,700	
丸紅建材リース	1,400	1,831.00	2,563,400	
日鉄物産	10,100	4,335.00	43,783,500	
泉州電業	4,000	3,670.00	14,680,000	
トラスコ中山	32,500	2,920.00	94,900,000	貸付有価証券 200株
オートバックスセブン	52,700	1,472.00	77,574,400	
モリト	10,300	607.00	6,252,100	
加藤産業	20,500	3,395.00	69,597,500	
北恵	3,600	981.00	3,531,600	
イノテック	8,000	1,366.00	10,928,000	
イエローハット	26,800	1,934.00	51,831,200	
J Kホールディングス	12,800	795.00	10,176,000	貸付有価証券 7,800株
日伝	11,800	2,217.00	26,160,600	
北沢産業	9,600	253.00	2,428,800	
杉本商事	7,100	2,251.00	15,982,100	
因幡電機産業	37,900	2,586.00	98,009,400	
東テク	4,700	2,674.00	12,567,800	
ミスミグループ本社	178,100	3,805.00	677,670,500	
アルテック	10,400	341.00	3,546,400	
タキヒヨー	4,700	1,888.00	8,873,600	
蔵王産業	2,700	1,472.00	3,974,400	

スズケン	60,100	3,370.00	202,537,000	貸付有価証券 1,600株
ジェコス	9,800	893.00	8,751,400	
グローセル	15,400	419.00	6,452,600	
ローソン	35,900	5,070.00	182,013,000	貸付有価証券 1,600株
サンエー	10,700	4,245.00	45,421,500	貸付有価証券 500株
カワチ薬品	9,900	2,223.00	22,007,700	
エービーシー・マート	22,200	6,310.00	140,082,000	貸付有価証券 300株
ハードオフコーポレーション	6,200	768.00	4,761,600	
アスクル	22,900	1,815.00	41,563,500	
ゲオホールディングス	19,000	1,204.00	22,876,000	貸付有価証券 1,100株
アダストリア	19,700	2,007.00	39,537,900	
ジーフット	8,600	413.00	3,551,800	貸付有価証券 4,000株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,000	422.00	844,000	
くら寿司	16,700	4,195.00	70,056,500	貸付有価証券 100株
キャンドゥ	6,800	1,952.00	13,273,600	貸付有価証券 3,300株（1,000株）
アイケイ	4,100	782.00	3,206,200	貸付有価証券 100株
パルグループホールディングス	12,400	1,715.00	21,266,000	
エディオン	60,100	1,042.00	62,624,200	貸付有価証券 10,700株（10,400株）
サーラコーポレーション	28,800	592.00	17,049,600	
ワッツ	6,900	935.00	6,451,500	貸付有価証券 200株
ハローズ	5,700	2,689.00	15,327,300	
フジオフードグループ本社	12,000	1,292.00	15,504,000	貸付有価証券 5,600株
あみやき亭	3,100	2,951.00	9,148,100	
ひらまつ	26,100	225.00	5,872,500	貸付有価証券 1,200株（600株）
大黒天物産	4,500	8,870.00	39,915,000	貸付有価証券

				700株（500株）
ハニーズホールディングス	11,200	1,013.00	11,345,600	貸付有価証券 600株（600株）
ファーマライズホールディングス	3,400	773.00	2,628,200	
アルペン	10,900	2,990.00	32,591,000	貸付有価証券 5,100株
ハブ	4,500	782.00	3,519,000	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
クオールホールディングス	19,100	1,500.00	28,650,000	
ジンズホールディングス	9,700	8,070.00	78,279,000	貸付有価証券 100株
ビックカメラ	84,200	1,119.00	94,219,800	
D C Mホールディングス	87,600	1,049.00	91,892,400	
M o n o t a R O	201,900	2,561.00	517,065,900	貸付有価証券 6,900株（6,600株）
東京一番フーズ	3,600	591.00	2,127,600	
D Dホールディングス	6,900	544.00	3,753,600	貸付有価証券 3,500株（100株）
きちりホールディングス	3,800	592.00	2,249,600	
アークランドサービスホールディングス	11,800	2,224.00	26,243,200	貸付有価証券 5,500株
J . フロント リテイリング	169,500	1,090.00	184,755,000	
ドトール・日レスホールディングス	22,500	1,726.00	38,835,000	
マツモトキヨシホールディングス	58,700	5,020.00	294,674,000	貸付有価証券 100株
ブロンコビリー	7,400	2,447.00	18,107,800	貸付有価証券 3,600株
Z O Z O	83,700	3,700.00	309,690,000	貸付有価証券 1,600株
トレジャー・ファクトリー	4,200	944.00	3,964,800	
物語コーポレーション	7,600	7,480.00	56,848,000	貸付有価証券 3,500株
ココカラファイン	12,700	8,450.00	107,315,000	貸付有価証券 6,200株
三越伊勢丹ホールディングス	248,400	831.00	206,420,400	貸付有価証券 3,300株
H a m e e	3,600	1,471.00	5,295,600	貸付有価証券

				1,600株
マーケットエンタープライズ	900	1,115.00	1,003,500	貸付有価証券 100株
ウエルシアホールディングス	75,000	3,755.00	281,625,000	
クリエイティブSDホールディングス	20,900	3,310.00	69,179,000	貸付有価証券 1,500株（400株）
丸善CHホールディングス	16,600	411.00	6,822,600	貸付有価証券 8,100株
ミサワ	2,900	681.00	1,974,900	
ティーライフ	1,900	1,515.00	2,878,500	貸付有価証券 800株
エー・ピーホールディングス	2,700	461.00	1,244,700	
チムニー	4,300	1,384.00	5,951,200	貸付有価証券 2,000株
シュッピン	9,700	1,055.00	10,233,500	貸付有価証券 1,100株
オイシックス・ラ・大地	18,700	3,475.00	64,982,500	
ネクステージ	25,000	1,773.00	44,325,000	
ジョイフル本田	41,600	1,348.00	56,076,800	貸付有価証券 19,500株
鳥貴族ホールディングス	5,200	1,888.00	9,817,600	貸付有価証券 2,400株
ホットランド	10,600	1,385.00	14,681,000	貸付有価証券 4,900株（300株）
すかいらくホールディングス	180,900	1,558.00	281,842,200	貸付有価証券 81,700株
SFPホールディングス	6,900	1,461.00	10,080,900	貸付有価証券 3,200株
綿半ホールディングス	10,600	1,211.00	12,836,600	貸付有価証券 200株
ヨシックス	2,800	2,324.00	6,507,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	41,200	1,105.00	45,526,000	貸付有価証券 3,600株
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,400	1,461.00	10,811,400	貸付有価証券 3,400株
B E E N O S	7,200	3,520.00	25,344,000	
あさひ	10,600	1,427.00	15,126,200	貸付有価証券 5,300株
日本調剤	8,600	1,587.00	13,648,200	

コスモス薬品	14,300	17,220.00	246,246,000	貸付有価証券 900株
トーエル	6,900	808.00	5,575,200	
オンリー	2,400	464.00	1,113,600	貸付有価証券 100株
セブン & アイ・ホールディングス	555,300	5,151.00	2,860,350,300	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	76,300	897.00	68,441,100	貸付有価証券 35,700株（2,000株）
ツルハホールディングス	31,000	14,060.00	435,860,000	貸付有価証券 1,300株
サンマルクホールディングス	11,200	1,608.00	18,009,600	
フェリシモ	3,100	1,410.00	4,371,000	
トリドールホールディングス	35,100	1,882.00	66,058,200	
T O K Y O B A S E	12,800	720.00	9,216,000	
ウイルプラスホールディングス	2,200	1,135.00	2,497,000	貸付有価証券 1,000株
J Mホールディングス	9,600	2,150.00	20,640,000	貸付有価証券 4,500株
サツドラホールディングス	2,100	2,156.00	4,527,600	
アレンザホールディングス	10,800	1,209.00	13,057,200	
串カツ田中ホールディングス	3,800	1,917.00	7,284,600	
パロックジャパンリミテッド	9,800	804.00	7,879,200	
クスリのアオキホールディングス	14,100	8,510.00	119,991,000	貸付有価証券 1,900株
力の源ホールディングス	6,500	633.00	4,114,500	貸付有価証券 3,000株
F O O D & L I F E C O M P A N I E	83,100	4,800.00	398,880,000	
メディカルシステムネットワーク	12,300	704.00	8,659,200	
はるやまホールディングス	6,600	666.00	4,395,600	
ノジマ	25,200	2,919.00	73,558,800	
カップ・クリエイト	19,900	1,468.00	29,213,200	貸付有価証券 6,200株（200株）

ライトオン	10,600	703.00	7,451,800	貸付有価証券 3,100株（3,100株）
良品計画	163,300	2,082.00	339,990,600	貸付有価証券 200株
三城ホールディングス	17,600	270.00	4,752,000	
アドヴァン	14,400	937.00	13,492,800	
アルビス	4,600	2,293.00	10,547,800	
コナカ	16,700	347.00	5,794,900	貸付有価証券 100株
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,639.00	2,786,300	
G - 7ホールディングス	6,900	3,160.00	21,804,000	貸付有価証券 100株（100株）
イオン北海道	18,700	1,123.00	21,000,100	
コジマ	24,400	704.00	17,177,600	貸付有価証券 12,200株
ヒマラヤ	5,000	1,031.00	5,155,000	
コーナン商事	20,200	3,665.00	74,033,000	貸付有価証券 100株
エコス	5,200	1,893.00	9,843,600	
ワタミ	18,700	998.00	18,662,600	貸付有価証券 600株
マルシェ	3,700	515.00	1,905,500	貸付有価証券 1,700株
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	283,800	2,318.00	657,848,400	
西松屋チェーン	31,100	1,501.00	46,681,100	貸付有価証券 12,700株（500株）
ゼンショーホールディン グス	76,200	2,752.00	209,702,400	貸付有価証券 1,700株
幸楽苑ホールディングス	9,000	1,543.00	13,887,000	貸付有価証券 700株（700株）
ハークスレイ	3,000	1,026.00	3,078,000	
サイゼリヤ	21,100	2,651.00	55,936,100	
V Tホールディングス	53,400	470.00	25,098,000	
魚力	4,400	2,010.00	8,844,000	貸付有価証券 1,200株
ポプラ	3,700	286.00	1,058,200	貸付有価証券 1,700株（1,700株）
フジ・コーポレーション	7,500	1,276.00	9,570,000	貸付有価証券 600株
ユナイテッドアローズ	16,200	2,174.00	35,218,800	

ハイデイ日高	20,500	1,799.00	36,879,500	貸付有価証券 11,100株
京都きもの友禅	9,000	274.00	2,466,000	
コロワイド	47,200	1,992.00	94,022,400	貸付有価証券 26,700株（1,600株）
ピーシーデポコーポレーション	16,500	449.00	7,408,500	貸付有価証券 2,300株
壱番屋	10,000	4,870.00	48,700,000	
トップカルチャー	5,100	351.00	1,790,100	
P L A N T	3,600	727.00	2,617,200	
スギホールディングス	28,300	8,820.00	249,606,000	
薬王堂ホールディングス	6,200	2,432.00	15,078,400	
スクロール	20,300	827.00	16,788,100	貸付有価証券 9,500株（3,100株）
ヨンドシーホールディングス	13,100	1,925.00	25,217,500	
木曽路	18,600	2,378.00	44,230,800	
S R S ホールディングス	18,300	816.00	14,932,800	貸付有価証券 7,800株（7,800株）
千趣会	25,600	402.00	10,291,200	貸付有価証券 15,900株
タカキュー	11,000	139.00	1,529,000	
リテールパートナーズ	17,200	1,203.00	20,691,600	貸付有価証券 100株
ケーヨー	26,200	780.00	20,436,000	
上新電機	16,300	2,722.00	44,368,600	
日本瓦斯	70,200	1,812.00	127,202,400	貸付有価証券 3,600株（3,600株）
ロイヤルホールディングス	24,800	2,270.00	56,296,000	貸付有価証券 12,200株
東天紅	1,000	1,170.00	1,170,000	
いなげや	15,800	1,537.00	24,284,600	
チヨダ	13,800	893.00	12,323,400	
ライフコーポレーション	13,300	3,560.00	47,348,000	
リンガーハット	17,500	2,346.00	41,055,000	
M r M a x H D	19,500	654.00	12,753,000	貸付有価証券 500株
テンアライド	13,100	337.00	4,414,700	貸付有価証券 6,200株
A O K I ホールディング	28,400	671.00	19,056,400	

ス				
オークワ	22,300	1,104.00	24,619,200	貸付有価証券 9,400株
コメリ	21,900	2,599.00	56,918,100	
青山商事	31,600	800.00	25,280,000	貸付有価証券 14,800株（5,200株）
しまむら	16,500	9,470.00	156,255,000	貸付有価証券 1,400株
はせがわ	7,500	300.00	2,250,000	
高島屋	103,400	1,340.00	138,556,000	貸付有価証券 500株
松屋	31,000	975.00	30,225,000	
エイチ・ツー・オー リ テイリング	67,200	942.00	63,302,400	貸付有価証券 600株
近鉄百貨店	5,400	3,150.00	17,010,000	
丸井グループ	120,100	2,160.00	259,416,000	
アクシアル リテイリン グ	11,800	3,875.00	45,725,000	
井筒屋	7,200	235.00	1,692,000	貸付有価証券 2,000株
イオン	546,300	3,062.00	1,672,770,600	
イズミ	28,900	4,185.00	120,946,500	
平和堂	26,200	2,302.00	60,312,400	貸付有価証券 100株
フジ	17,100	1,988.00	33,994,800	
ヤオコー	16,100	6,410.00	103,201,000	貸付有価証券 2,800株
ゼビオホールディングス	17,200	979.00	16,838,800	
ケーズホールディングス	120,800	1,271.00	153,536,800	
O l y m p i c グループ	7,300	779.00	5,686,700	
日産東京販売ホールディ ングス	20,900	237.00	4,953,300	貸付有価証券 500株
シルバーライフ	2,900	2,284.00	6,623,600	貸付有価証券 200株
一家ダイニングプロジェ クト	2,900	595.00	1,725,500	
G e n k y D r u g S t o r e s	6,200	3,850.00	23,870,000	
ナルミヤ・インターナ ショナル	2,700	1,074.00	2,899,800	

ブックオフグループホールディングス	8,300	942.00	7,818,600	貸付有価証券 4,800株
ギフト	1,800	2,622.00	4,719,600	
アインホールディングス	20,600	6,940.00	142,964,000	貸付有価証券 300株
元気寿司	4,000	2,590.00	10,360,000	
ヤマダホールディングス	475,800	512.00	243,609,600	貸付有価証券 18,600株
アークランドサカモト	22,200	1,500.00	33,300,000	
ニトリホールディングス	56,300	18,840.00	1,060,692,000	
グルメ杵屋	10,100	971.00	9,807,100	
愛眼	11,300	228.00	2,576,400	
ケーユーホールディングス	7,400	938.00	6,941,200	
吉野家ホールディングス	46,600	2,082.00	97,021,200	貸付有価証券 3,400株（3,300株）
松屋フーズホールディングス	6,800	3,495.00	23,766,000	
サガミホールディングス	20,100	1,030.00	20,703,000	貸付有価証券 10,500株
関西スーパーマーケット	10,700	987.00	10,560,900	
王将フードサービス	9,400	5,650.00	53,110,000	貸付有価証券 200株（200株）
プレナス	15,900	2,038.00	32,404,200	貸付有価証券 100株
ミニストップ	10,500	1,416.00	14,868,000	
アークス	27,100	2,474.00	67,045,400	
バローホールディングス	29,000	2,295.00	66,555,000	貸付有価証券 400株
藤久	3,300	818.00	2,699,400	貸付有価証券 1,500株
ベルク	7,000	5,490.00	38,430,000	貸付有価証券 100株（100株）
大庄	7,600	1,075.00	8,170,000	貸付有価証券 3,500株
ファーストリテイリング	19,000	81,350.00	1,545,650,000	
サンドラッグ	53,400	3,600.00	192,240,000	貸付有価証券 1,000株
サックスパーホールディングス	12,000	643.00	7,716,000	
ヤマザワ	3,300	1,719.00	5,672,700	

やまや	2,900	2,277.00	6,603,300	貸付有価証券 700株
ベルーナ	30,500	962.00	29,341,000	
島根銀行	4,900	620.00	3,038,000	
じもとホールディングス	9,600	646.00	6,201,600	
めぶきフィナンシャルグループ	738,700	236.00	174,333,200	貸付有価証券 1,100株
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,800	1,466.00	26,094,800	
九州フィナンシャルグループ	290,300	398.00	115,539,400	貸付有価証券 500株
ゆうちょ銀行	402,700	925.00	372,497,500	貸付有価証券 176,900株
富山第一銀行	33,900	276.00	9,356,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	866,100	423.00	366,360,300	貸付有価証券 6,800株
西日本フィナンシャルホールディングス	92,800	656.00	60,876,800	貸付有価証券 100株
三十三フィナンシャルグループ	12,300	1,344.00	16,531,200	
第四北越フィナンシャルグループ	23,100	2,419.00	55,878,900	貸付有価証券 200株
ひろぎんホールディングス	209,700	581.00	121,835,700	貸付有価証券 3,000株
新生銀行	115,900	1,530.00	177,327,000	貸付有価証券 200株
あおぞら銀行	84,700	2,490.00	210,903,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,724,500	605.30	5,886,239,850	
りそなホールディングス	1,640,500	444.90	729,858,450	貸付有価証券 11,700株（9,300株）
三井住友トラスト・ホールディングス	268,700	3,610.00	970,007,000	
三井住友フィナンシャルグループ	983,800	3,909.00	3,845,674,200	
千葉銀行	474,400	687.00	325,912,800	貸付有価証券 7,700株
群馬銀行	292,600	356.00	104,165,600	
武蔵野銀行	21,200	1,686.00	35,743,200	
千葉興業銀行	36,200	262.00	9,484,400	
筑波銀行	59,100	172.00	10,165,200	

七十七銀行	44,600	1,257.00	56,062,200	
青森銀行	11,000	2,123.00	23,353,000	
秋田銀行	8,500	1,394.00	11,849,000	
山形銀行	16,000	854.00	13,664,000	
岩手銀行	9,300	1,712.00	15,921,600	
東邦銀行	127,100	208.00	26,436,800	貸付有価証券 1,900株
東北銀行	6,800	1,005.00	6,834,000	
みちのく銀行	9,100	943.00	8,581,300	
ふくおかフィナンシャル グループ	128,300	1,939.00	248,773,700	貸付有価証券 100株
静岡銀行	346,200	888.00	307,425,600	
十六銀行	17,800	1,968.00	35,030,400	
スルガ銀行	124,700	354.00	44,143,800	貸付有価証券 1,000株
八十二銀行	320,200	367.00	117,513,400	
山梨中央銀行	16,500	812.00	13,398,000	
大垣共立銀行	28,100	1,876.00	52,715,600	
福井銀行	12,200	1,400.00	17,080,000	
北國銀行	13,200	2,181.00	28,789,200	
清水銀行	5,900	1,482.00	8,743,800	
富山銀行	2,700	2,386.00	6,442,200	
滋賀銀行	28,500	2,050.00	58,425,000	
南都銀行	20,700	1,848.00	38,253,600	
百五銀行	127,900	306.00	39,137,400	貸付有価証券 200株
京都銀行	50,900	5,160.00	262,644,000	
紀陽銀行	50,300	1,471.00	73,991,300	貸付有価証券 100株
ほくほくフィナンシャル グループ	94,600	839.00	79,369,400	貸付有価証券 600株
山陰合同銀行	89,600	546.00	48,921,600	貸付有価証券 900株
中国銀行	122,300	871.00	106,523,300	
鳥取銀行	4,500	1,112.00	5,004,000	
伊予銀行	188,400	545.00	102,678,000	
百十四銀行	15,100	1,463.00	22,091,300	
四国銀行	20,200	703.00	14,200,600	

阿波銀行	21,800	2,036.00	44,384,800	貸付有価証券 100株
大分銀行	8,200	1,672.00	13,710,400	
宮崎銀行	8,900	2,005.00	17,844,500	
佐賀銀行	8,100	1,369.00	11,088,900	
沖縄銀行	13,000	2,580.00	33,540,000	
琉球銀行	30,900	724.00	22,371,600	
セブン銀行	475,000	235.00	111,625,000	貸付有価証券 27,700株
みずほフィナンシャルグループ	1,931,700	1,607.00	3,104,241,900	
高知銀行	5,200	810.00	4,212,000	
山口フィナンシャルグループ	177,400	654.00	116,019,600	
長野銀行	4,700	1,126.00	5,292,200	
名古屋銀行	11,400	2,574.00	29,343,600	
北洋銀行	214,300	240.00	51,432,000	貸付有価証券 10,500株
愛知銀行	4,800	2,807.00	13,473,600	
中京銀行	5,100	1,466.00	7,476,600	
大光銀行	4,900	1,359.00	6,659,100	
愛媛銀行	19,800	790.00	15,642,000	
トマト銀行	5,500	1,038.00	5,709,000	
京葉銀行	60,600	408.00	24,724,800	
栃木銀行	68,700	171.00	11,747,700	
北日本銀行	4,400	1,715.00	7,546,000	
東和銀行	25,000	518.00	12,950,000	
福島銀行	16,300	231.00	3,765,300	貸付有価証券 3,000株
大東銀行	6,800	607.00	4,127,600	
トモニホールディングス	109,900	301.00	33,079,900	
フィデアホールディングス	138,000	119.00	16,422,000	貸付有価証券 500株
池田泉州ホールディングス	163,500	160.00	26,160,000	
F P G	47,800	750.00	35,850,000	貸付有価証券 3,200株
ジャパンインベストメントアドバイザー	9,600	1,457.00	13,987,200	貸付有価証券 900株

マーキュリアインベストメント	5,500	791.00	4,350,500	
S B I ホールディングス	175,200	2,658.00	465,681,600	貸付有価証券 2,900株
日本アジア投資	12,000	273.00	3,276,000	
ジャフコ グループ	21,800	6,800.00	148,240,000	貸付有価証券 200株（200株）
大和証券グループ本社	1,064,600	628.70	669,314,020	
野村ホールディングス	2,170,500	578.00	1,254,549,000	貸付有価証券 1,200株
岡三証券グループ	121,100	425.00	51,467,500	貸付有価証券 6,400株
丸三証券	42,200	621.00	26,206,200	貸付有価証券 19,200株
東洋証券	46,900	168.00	7,879,200	貸付有価証券 100株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	151,600	400.00	60,640,000	貸付有価証券 300株
光世証券	3,400	629.00	2,138,600	
水戸証券	38,000	302.00	11,476,000	貸付有価証券 1,600株
いちよし証券	28,500	578.00	16,473,000	
松井証券	69,600	817.00	56,863,200	
マネックスグループ	127,500	742.00	94,605,000	貸付有価証券 27,900株
極東証券	19,100	820.00	15,662,000	
岩井コスモホールディングス	14,600	1,668.00	24,352,800	貸付有価証券 200株
藍澤證券	25,500	1,043.00	26,596,500	
マネーパートナーズグループ	15,100	235.00	3,548,500	貸付有価証券 700株
スパークス・グループ	65,600	267.00	17,515,200	
小林洋行	4,100	278.00	1,139,800	
かんぽ生命保険	176,200	2,117.00	373,015,400	
S O M P O ホールディングス	250,600	4,204.00	1,053,522,400	
アニコム ホールディングス	40,000	899.00	35,960,000	
M S & A D インシュアランスグループホール	345,200	3,238.00	1,117,757,600	貸付有価証券 1,400株
第一生命ホールディング	751,000	2,052.50	1,541,427,500	

ス				
東京海上ホールディングス	468,200	5,063.00	2,370,496,600	
T & Dホールディングス	424,900	1,449.00	615,680,100	貸付有価証券 300株
アドバンスクリエイト	6,700	909.00	6,090,300	
全国保証	37,000	4,785.00	177,045,000	貸付有価証券 10,200株
あんしん保証	4,800	360.00	1,728,000	貸付有価証券 2,200株
ジェイリース	4,700	1,358.00	6,382,600	貸付有価証券 300株
イントラスト	4,000	728.00	2,912,000	
日本モーゲージサービス	7,200	1,002.00	7,214,400	貸付有価証券 900株（200株）
C a s a	4,000	980.00	3,920,000	貸付有価証券 1,800株
アルヒ	21,000	1,449.00	30,429,000	貸付有価証券 10,300株
プレミアグループ	6,600	3,450.00	22,770,000	
クレディセゾン	83,000	1,385.00	114,955,000	
芙蓉総合リース	14,900	7,110.00	105,939,000	
みずほリース	21,900	3,610.00	79,059,000	貸付有価証券 10,800株
東京センチュリー	33,000	5,910.00	195,030,000	貸付有価証券 4,500株
日本証券金融	60,100	818.00	49,161,800	貸付有価証券 1,300株
アイフル	238,600	388.00	92,576,800	貸付有価証券 1,600株
リコーリース	11,200	3,475.00	38,920,000	貸付有価証券 900株
イオンフィナンシャルサービス	87,000	1,320.00	114,840,000	
アコム	285,700	516.00	147,421,200	貸付有価証券 5,300株
ジャックス	15,700	2,609.00	40,961,300	
オリエントコーポレーション	384,600	153.00	58,843,800	
オリックス	863,000	1,937.50	1,672,062,500	貸付有価証券 1,100株

三菱ＨＣキャピタル	491,700	602.00	296,003,400	
九州リースサービス	7,000	670.00	4,690,000	貸付有価証券 1,400株（200株）
日本取引所グループ	384,000	2,619.50	1,005,888,000	貸付有価証券 3,200株
イー・ギャランティ	16,400	2,400.00	39,360,000	
アサックス	7,400	701.00	5,187,400	貸付有価証券 4,500株
ＮＥＣキャピタルソ リューション	5,800	2,203.00	12,777,400	貸付有価証券 200株
いちご	158,300	369.00	58,412,700	
日本駐車場開発	155,900	162.00	25,255,800	
スター・マイカ・ホール ディングス	7,300	1,151.00	8,402,300	貸付有価証券 100株
ＳＲＥホールディングス	2,100	7,090.00	14,889,000	
ＡＤワークスグループ	28,500	167.00	4,759,500	
ヒューリック	301,600	1,329.00	400,826,400	貸付有価証券 10,500株
三栄建築設計	5,700	2,017.00	11,496,900	
野村不動産ホールディン グス	86,400	2,921.00	252,374,400	
三重交通グループホール ディングス	28,800	478.00	13,766,400	
サムティ	20,200	2,031.00	41,026,200	
ディア・ライフ	18,300	470.00	8,601,000	
コーセーアールイー	4,200	629.00	2,641,800	貸付有価証券 500株
日本商業開発	9,000	1,865.00	16,785,000	貸付有価証券 4,400株
プレサンスコーポレー ション	23,400	1,464.00	34,257,600	
ハウスコム	2,400	1,235.00	2,964,000	
日本管理センター	7,700	1,327.00	10,217,900	
サンセイランディック	4,200	874.00	3,670,800	貸付有価証券 1,900株
エストラスト	1,700	673.00	1,144,100	
フージャースホールディ ングス	23,200	735.00	17,052,000	
オープンハウス	45,100	5,160.00	232,716,000	貸付有価証券 900株

東急不動産ホールディングス	386,500	718.00	277,507,000	貸付有価証券 500株
飯田グループホールディングス	118,600	2,958.00	350,818,800	
イーランド	2,300	1,017.00	2,339,100	
ムゲンエステート	8,700	515.00	4,480,500	貸付有価証券 3,200株
ビーロッド	6,700	577.00	3,865,900	貸付有価証券 3,100株
ファーストブラザーズ	2,600	1,007.00	2,618,200	
ハウズドゥ	7,000	1,025.00	7,175,000	貸付有価証券 3,200株
シーアールイー	3,700	1,602.00	5,927,400	貸付有価証券 1,700株
プロパティエージェント	2,300	2,375.00	5,462,500	貸付有価証券 1,000株
ケイアイスター不動産	4,500	4,985.00	22,432,500	
アグレ都市デザイン	2,600	1,042.00	2,709,200	
グッドコムアセット	6,800	1,388.00	9,438,400	貸付有価証券 200株
ジェイ・エス・ビー	2,600	3,760.00	9,776,000	
テンポイノベーション	4,000	894.00	3,576,000	貸付有価証券 1,700株
グローバル・リンク・マネジメント	2,400	869.00	2,085,600	
フェイスネットワーク	1,200	1,334.00	1,600,800	
パーク 2 4	76,300	2,107.00	160,764,100	
パラカ	3,700	1,625.00	6,012,500	
三井不動産	647,900	2,714.00	1,758,400,600	
三菱地所	933,900	1,907.00	1,780,947,300	
平和不動産	24,300	4,285.00	104,125,500	
東京建物	140,400	1,658.00	232,783,200	
ダイビル	36,000	1,456.00	52,416,000	
京阪神ビルディング	24,500	1,414.00	34,643,000	
住友不動産	319,600	4,134.00	1,321,226,400	
テーオーシー	27,900	696.00	19,418,400	
東京楽天地	2,300	4,250.00	9,775,000	貸付有価証券 1,000株
レオパレス 2 1	117,900	152.00	17,920,800	

スターツコーポレーション	16,900	2,743.00	46,356,700	
フジ住宅	16,500	629.00	10,378,500	
空港施設	14,200	658.00	9,343,600	
明和地所	6,700	613.00	4,107,100	
ゴールドクレスト	12,800	1,791.00	22,924,800	貸付有価証券 400株
エスリード	5,500	1,588.00	8,734,000	貸付有価証券 100株
日神グループホールディングス	21,000	463.00	9,723,000	貸付有価証券 9,600株
日本エスコン	25,800	776.00	20,020,800	貸付有価証券 1,900株
タカラレーベン	59,600	339.00	20,204,400	貸付有価証券 600株
A V A N T I A	7,300	894.00	6,526,200	
イオンモール	71,300	1,809.00	128,981,700	貸付有価証券 100株
毎日コムネット	4,800	729.00	3,499,200	貸付有価証券 1,400株
ファースト住建	6,100	1,220.00	7,442,000	
カチタス	35,200	3,150.00	110,880,000	
トーセイ	19,600	1,099.00	21,540,400	
穴吹興産	3,100	2,069.00	6,413,900	貸付有価証券 1,400株
サンフロンティア不動産	17,500	1,050.00	18,375,000	
エフ・ジェー・ネクスト	14,000	1,020.00	14,280,000	
インテリックス	3,200	723.00	2,313,600	
ランドビジネス	6,000	347.00	2,082,000	
サンネクスタグループ	4,500	1,019.00	4,585,500	
グランディハウス	9,700	426.00	4,132,200	
日本空港ビルデング	49,400	5,490.00	271,206,000	
明豊ファシリティワークス	6,300	848.00	5,342,400	
日本工営	8,600	3,200.00	27,520,000	
L I F U L L	42,000	350.00	14,700,000	貸付有価証券 600株
ミクシィ	35,000	2,873.00	100,555,000	貸付有価証券 200株
ジェイエイシーリクルー	9,500	1,800.00	17,100,000	

トメント				
日本M & A センター	225,900	2,737.00	618,288,300	貸付有価証券 2,700株
メンバーズ	4,100	3,325.00	13,632,500	
中広	1,900	363.00	689,700	貸付有価証券 100株
U T グループ	19,900	3,190.00	63,481,000	
アイティメディア	4,600	1,956.00	8,997,600	貸付有価証券 2,100株（1,200株）
タケエイ	15,400	1,418.00	21,837,200	貸付有価証券 5,600株
E・Jホールディングス	7,200	1,066.00	7,675,200	
夢真ビーネックスグループ	36,600	1,297.00	47,470,200	貸付有価証券 100株
コシダカホールディングス	36,800	631.00	23,220,800	貸付有価証券 10,900株
アルトナー	3,300	867.00	2,861,100	
パソナグループ	14,900	2,304.00	34,329,600	貸付有価証券 800株
C D S	3,400	1,539.00	5,232,600	
リンクアンドモチベーション	25,300	700.00	17,710,000	貸付有価証券 11,800株（5,700株）
G C A	18,000	980.00	17,640,000	
エス・エム・エス	46,800	3,200.00	149,760,000	
サニーサイドアップグループ	4,800	814.00	3,907,200	貸付有価証券 2,200株（300株）
パーソルホールディングス	137,700	2,239.00	308,310,300	
リニカル	7,700	831.00	6,398,700	
クックパッド	43,300	252.00	10,911,600	
エスクリ	4,300	491.00	2,111,300	
アイ・ケイ・ケイ	6,700	670.00	4,489,000	
学情	4,900	1,419.00	6,953,100	
スタジオアリス	6,900	2,385.00	16,456,500	貸付有価証券 4,200株
シミックホールディングス	7,600	1,530.00	11,628,000	
エプコ	3,300	938.00	3,095,400	
N J S	3,400	1,996.00	6,786,400	
総合警備保障	54,800	5,120.00	280,576,000	

カカコム	101,700	3,365.00	342,220,500	
セントケア・ホールディング	10,100	1,032.00	10,423,200	
サイネックス	2,300	687.00	1,580,100	
ルネサンス	8,600	1,255.00	10,793,000	貸付有価証券 4,200株
ディップ	21,500	3,425.00	73,637,500	貸付有価証券 400株
デジタルホールディングス	9,600	2,284.00	21,926,400	貸付有価証券 3,300株（2,900株）
新日本科学	16,800	841.00	14,128,800	貸付有価証券 800株
キャリアデザインセンター	3,500	1,054.00	3,689,000	
ベネフィット・ワン	50,100	3,505.00	175,600,500	貸付有価証券 3,400株（100株）
エムスリー	243,000	7,511.00	1,825,173,000	貸付有価証券 1,000株
ツカダ・グローバルホールディング	11,000	416.00	4,576,000	貸付有価証券 300株
プラス	1,800	574.00	1,033,200	貸付有価証券 400株（400株）
アウトソーシング	78,900	2,076.00	163,796,400	貸付有価証券 600株
ウェルネット	13,900	564.00	7,839,600	
ワールドホールディングス	4,700	3,000.00	14,100,000	
ディー・エヌ・エー	58,300	2,219.00	129,367,700	貸付有価証券 2,600株
博報堂D Yホールディングス	191,700	1,754.00	336,241,800	貸付有価証券 2,000株
ぐるなび	24,000	565.00	13,560,000	貸付有価証券 10,100株
タカミヤ	16,700	549.00	9,168,300	
ジャパンベストレスキューシステム	9,300	850.00	7,905,000	
ファンコミュニケーションズ	37,900	401.00	15,197,900	
ライク	3,600	2,063.00	7,426,800	
ビジネス・ブレークスルー	5,700	440.00	2,508,000	
エスプール	35,400	969.00	34,302,600	

W D B ホールディングス	6,300	2,828.00	17,816,400	
手間いらず	1,700	6,480.00	11,016,000	貸付有価証券 200株（100株）
ティア	8,000	471.00	3,768,000	
C D G	1,300	1,576.00	2,048,800	
アドウェイズ	22,400	861.00	19,286,400	貸付有価証券 3,100株
バリューコマース	9,300	3,160.00	29,388,000	
インフォマート	139,300	952.00	132,613,600	貸付有価証券 1,700株
J P ホールディングス	39,300	281.00	11,043,300	貸付有価証券 2,100株
E P S ホールディングス	20,700	1,797.00	37,197,900	貸付有価証券 400株（100株）
レッグス	3,400	2,769.00	9,414,600	貸付有価証券 1,500株（100株）
プレステージ・インター ナショナル	51,600	690.00	35,604,000	貸付有価証券 300株
アミューズ	7,500	2,370.00	17,775,000	
ドリームインキュベータ	4,200	1,019.00	4,279,800	
クイック	8,500	1,232.00	10,472,000	
T A C	7,500	235.00	1,762,500	
電通グループ	154,900	3,840.00	594,816,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,400	1,040.00	6,656,000	
ぴあ	3,900	3,635.00	14,176,500	貸付有価証券 200株
イオンファンタジー	5,300	2,260.00	11,978,000	貸付有価証券 2,400株
シーティーエス	15,500	853.00	13,221,500	
ネクシィーズグループ	4,800	924.00	4,435,200	貸付有価証券 200株（200株）
H . U . グループホール ディングス	38,500	2,889.00	111,226,500	
アルプス技研	12,200	2,006.00	24,473,200	
ダイオーズ	2,700	1,029.00	2,778,300	
日本空調サービス	14,400	716.00	10,310,400	
オリエンタルランド	146,500	16,480.00	2,414,320,000	貸付有価証券 500株
ダスキン	31,900	2,579.00	82,270,100	貸付有価証券

				100株
明光ネットワークジャパン	16,200	589.00	9,541,800	貸付有価証券 3,100株（3,100株）
ファルコホールディングス	6,600	1,675.00	11,055,000	
秀英予備校	3,000	408.00	1,224,000	
ラウンドワン	47,000	1,454.00	68,338,000	貸付有価証券 200株
リゾートトラスト	63,100	1,843.00	116,293,300	貸付有価証券 900株
ビー・エム・エル	17,700	3,710.00	65,667,000	貸付有価証券 200株
りらいあコミュニケーションズ	20,900	1,365.00	28,528,500	
リソー教育	69,900	320.00	22,368,000	
早稲田アカデミー	5,800	924.00	5,359,200	貸付有価証券 2,300株
ユー・エス・エス	154,200	1,889.00	291,283,800	貸付有価証券 100株
東京個別指導学院	12,100	626.00	7,574,600	
サイバーエージェント	339,400	2,342.00	794,874,800	
楽天グループ	642,800	1,257.00	807,999,600	貸付有価証券 9,200株
クリーク・アンド・リバー社	7,200	1,474.00	10,612,800	貸付有価証券 100株
モーニングスター	20,100	449.00	9,024,900	
テー・オー・ダブリュー	24,100	335.00	8,073,500	貸付有価証券 11,300株
山田コンサルティンググループ	8,000	1,186.00	9,488,000	
セントラルスポーツ	5,100	2,461.00	12,551,100	貸付有価証券 2,500株
フルキャストホールディングス	11,700	2,192.00	25,646,400	
エン・ジャパン	24,500	4,000.00	98,000,000	貸付有価証券 100株
リソルホールディングス	1,500	3,990.00	5,985,000	貸付有価証券 600株
テクノプロ・ホールディングス	27,500	7,780.00	213,950,000	
アトラグループ	3,200	322.00	1,030,400	貸付有価証券

				2,000株
インターワークス	3,900	418.00	1,630,200	
アイ・アールジャパン ホールディングス	5,600	14,250.00	79,800,000	貸付有価証券 1,300株
K e e P e r 技研	8,900	2,848.00	25,347,200	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
ファーストロジック	2,700	730.00	1,971,000	
三機サービス	2,700	1,031.00	2,783,700	貸付有価証券 1,300株
G u n o s y	8,600	916.00	7,877,600	
デザインワン・ジャパン	3,400	227.00	771,800	
イー・ガーディアン	5,600	2,757.00	15,439,200	
リブセンス	7,600	225.00	1,710,000	
ジャパンマテリアル	42,300	1,330.00	56,259,000	
ベクトル	17,200	956.00	16,443,200	
ウチヤマホールディング ス	6,800	385.00	2,618,000	
チャーム・ケア・コーポ レーション	10,200	1,216.00	12,403,200	
キャリアリンク	4,500	2,197.00	9,886,500	貸付有価証券 2,500株
I B J	11,300	1,105.00	12,486,500	貸付有価証券 5,300株
アサンテ	5,000	1,747.00	8,735,000	
バリューHR	5,500	1,754.00	9,647,000	
M & A キャピタルパート ナーズ	11,300	4,870.00	55,031,000	
ライドオンエクスプレス ホールディングス	5,300	1,466.00	7,769,800	貸付有価証券 200株
E R I ホールディングス	3,900	637.00	2,484,300	
アビスト	2,100	2,939.00	6,171,900	
シグマクシス	7,600	2,244.00	17,054,400	
ウィルグループ	10,100	1,002.00	10,120,200	
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	20,400	255.00	5,202,000	
メドピア	10,600	4,440.00	47,064,000	貸付有価証券 200株（100株）
レアジョブ	2,600	1,804.00	4,690,400	貸付有価証券 1,100株
リクルートホールディン	986,600	5,666.00	5,590,075,600	貸付有価証券

グス				2,900株
エラン	19,000	1,298.00	24,662,000	
土木管理総合試験所	6,700	386.00	2,586,200	
ネットマーケティング	6,700	409.00	2,740,300	貸付有価証券 1,200株
日本郵政	1,042,000	928.40	967,392,800	
ベルシステム24ホールディングス	23,100	1,760.00	40,656,000	
鎌倉新書	13,900	1,004.00	13,955,600	貸付有価証券 6,500株（1,300株）
S M N	2,900	800.00	2,320,000	
一蔵	1,700	447.00	759,900	
グローバルキッズCOMPANY	2,500	989.00	2,472,500	
エアトリ	8,600	2,903.00	24,965,800	
アトラエ	9,600	2,010.00	19,296,000	貸付有価証券 400株（400株）
ストライク	5,200	4,270.00	22,204,000	
ソラスト	33,800	1,398.00	47,252,400	
セラク	4,300	2,209.00	9,498,700	
インソース	13,400	2,214.00	29,667,600	貸付有価証券 6,100株（6,000株）
ベイカレント・コンサルティング	9,000	36,400.00	327,600,000	
Orchestra Holdings	3,100	2,910.00	9,021,000	
アイモバイル	3,900	1,850.00	7,215,000	
キャリアインデックス	5,600	964.00	5,398,400	
MS - Japan	5,600	1,226.00	6,865,600	貸付有価証券 100株
船場	2,700	808.00	2,181,600	
グレイステクノロジー	14,000	1,629.00	22,806,000	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
ジャパンエレベーターサービスホールディング	39,700	2,554.00	101,393,800	
フルテック	1,900	1,358.00	2,580,200	
グリーンズ	5,200	616.00	3,203,200	貸付有価証券 700株
ツナググループ・ホールディングス	3,000	382.00	1,146,000	貸付有価証券 600株

GameWith	4,100	579.00	2,373,900	
ソウルドアウト	3,300	1,772.00	5,847,600	貸付有価証券 700株（600株）
MS&Consulting	2,200	600.00	1,320,000	
ウェルビー	5,100	1,403.00	7,155,300	
エル・ティー・エス	1,300	3,535.00	4,595,500	貸付有価証券 400株（400株）
ミダック	3,000	6,990.00	20,970,000	貸付有価証券 1,400株（400株）
日総工産	10,800	813.00	8,780,400	貸付有価証券 200株
キュービーネットホールディングス	6,300	1,816.00	11,440,800	
RPAホールディングス	16,100	719.00	11,575,900	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
スプリックス	3,900	1,292.00	5,038,800	貸付有価証券 400株（400株）
マネジメントソリューションズ	6,700	2,380.00	15,946,000	
プロレド・パートナーズ	2,500	2,870.00	7,175,000	貸付有価証券 300株（300株）
and factory	3,100	691.00	2,142,100	
テノ・ホールディングス	1,500	1,188.00	1,782,000	
フロンティア・マネジメント	3,100	1,162.00	3,602,200	貸付有価証券 100株（100株）
ピアラ	1,000	1,052.00	1,052,000	貸付有価証券 400株（400株）
コプロ・ホールディングス	1,800	1,276.00	2,296,800	
ギークス	2,400	1,826.00	4,382,400	
カーブスホールディングス	37,800	928.00	35,078,400	
フォーラムエンジニアリング	9,600	950.00	9,120,000	
ダイレクトマーケティングミックス	7,300	4,035.00	29,455,500	
ポピンズホールディングス	3,600	4,820.00	17,352,000	貸付有価証券 100株（100株）
LITALICO	5,600	5,180.00	29,008,000	
アドバンテッジリスクマ	7,000	1,197.00	8,379,000	

ネジメント				
リログループ	75,300	2,670.00	201,051,000	貸付有価証券 22,700株
東祥	8,600	1,952.00	16,787,200	貸付有価証券 4,200株
エイチ・アイ・エス	21,500	2,629.00	56,523,500	貸付有価証券 3,900株（3,900株）
ラックランド	3,900	2,780.00	10,842,000	貸付有価証券 1,800株
共立メンテナンス	22,800	3,885.00	88,578,000	貸付有価証券 4,300株（3,800株）
イチネンホールディングス	14,300	1,229.00	17,574,700	
建設技術研究所	8,900	2,417.00	21,511,300	
スペース	8,900	901.00	8,018,900	
長大	5,500	1,959.00	10,774,500	
燦ホールディングス	6,000	1,218.00	7,308,000	
スバル興業	800	7,990.00	6,392,000	貸付有価証券 200株
東京テアトル	5,400	1,279.00	6,906,600	
タナベ経営	2,600	1,470.00	3,822,000	
ナガワ	4,400	8,440.00	37,136,000	貸付有価証券 2,200株
東京都競馬	9,000	4,695.00	42,255,000	
常磐興産	5,500	1,449.00	7,969,500	
カナモト	24,300	2,589.00	62,912,700	
西尾レントオール	12,700	3,200.00	40,640,000	貸付有価証券 100株
トランス・コスモス	13,100	3,060.00	40,086,000	貸付有価証券 100株
乃村工藝社	59,000	943.00	55,637,000	貸付有価証券 7,000株
藤田観光	5,500	2,306.00	12,683,000	貸付有価証券 2,700株
KNT-CTホールディングス	7,300	1,321.00	9,643,300	貸付有価証券 4,500株
日本管財	14,700	2,362.00	34,721,400	貸付有価証券 8,600株
トーカイ	13,300	2,470.00	32,851,000	
白洋舎	1,600	2,335.00	3,736,000	貸付有価証券 900株

	セコム	135,700	8,610.00	1,168,377,000	
	セントラル警備保障	6,600	3,110.00	20,526,000	
	丹青社	26,000	888.00	23,088,000	
	メイテック	16,600	6,270.00	104,082,000	貸付有価証券 100株
	応用地質	15,500	1,275.00	19,762,500	貸付有価証券 400株
	船井総研ホールディングス	28,200	2,454.00	69,202,800	
	進学会ホールディングス	5,400	420.00	2,268,000	貸付有価証券 1,000株
	オオバ	9,700	791.00	7,672,700	
	いであ	3,400	1,761.00	5,987,400	
	学究社	4,000	1,347.00	5,388,000	
	ベネッセホールディングス	50,500	2,751.00	138,925,500	貸付有価証券 500株
	イオンディライト	17,000	3,470.00	58,990,000	
	ナック	6,500	907.00	5,895,500	貸付有価証券 100株
	ダイセキ	23,100	4,680.00	108,108,000	
	ステップ	5,000	1,587.00	7,935,000	
	小計 銘柄数：2,171 組入時価比率：98.4%			387,628,573,890 100.0%	
	合計			387,628,573,890	

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

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

(2)株式以外の有価証券(2021年6月22日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2021年 6月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年超			
市場取引				

株価指数先物取引				
買建	6,294,911,500	-	6,308,190,000	13,118,615
合計	6,294,911,500	-	6,308,190,000	13,118,615

（注）時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2021年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	5,674,181,547
コール・ローン	2,383,879,746
株式	982,017,272,041
投資証券	23,393,307,049
派生商品評価勘定	35,024,372
未収入金	17,494,646
未収配当金	843,880,376
差入委託証拠金	6,906,322,894
流動資産合計	1,021,271,362,671
資産合計	1,021,271,362,671
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	103,098,227
未払解約金	182,258,738
未払利息	2,091
その他未払費用	2,432,600
流動負債合計	287,791,656
負債合計	287,791,656
純資産の部	
元本等	
元本	252,216,611,468
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	768,766,959,547
元本等合計	1,020,983,571,015
純資産合計	1,020,983,571,015
負債純資産合計	1,021,271,362,671

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2021年 6月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	4,0480円
(10,000口当たり純資産額)	(40,480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 2020年 6月23日
至 2021年 6月22日

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

○ 市場リスクの管理

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

○ 信用リスクの管理

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

○ 流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2021年 6月22日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 6月22日現在

期首	2020年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	232,675,647,335円
同期中における追加設定元本額	57,877,568,834円
同期中における一部解約元本額	38,336,604,701円
期末元本額	252,216,611,468円
期末元本額の内訳*	

バランスセレクト30	35,120,828円
バランスセレクト50	107,014,724円
バランスセレクト70	125,140,552円
野村外国株式インデックスファンド	490,056,325円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,471,847,195円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	4,486,744,044円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	3,801,317,452円
野村資産設計ファンド2015	11,098,176円
野村資産設計ファンド2020	11,110,046円
野村資産設計ファンド2025	21,106,054円
野村資産設計ファンド2030	28,939,796円
野村資産設計ファンド2035	24,216,451円
野村資産設計ファンド2040	46,502,653円
野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	48,804,879,763円
のむラップ・ファンド（保守型）	790,604,743円
のむラップ・ファンド（普通型）	7,536,676,384円
のむラップ・ファンド（積極型）	6,323,664,069円
野村資産設計ファンド2045	8,127,916円
野村インデックスファンド・外国株式	5,594,383,284円
マイ・ロード	1,007,100,307円
ネクストコア	22,720,947円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	131,480,950円
野村外国株インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	1,758,622,210円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	586,289,204円
野村資産設計ファンド2050	11,307,761円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	3,722,458円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	1,905,390円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,483,945円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,201,093円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	181,236,840円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	518,572,972円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,185,406円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,796,401円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	19,840,943円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	7,233,436円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	31,808,566円
野村6資産均等バランス	1,015,417,140円
野村つみたて外国株投信	7,802,367,289円
野村外国株（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	4,625,625,362円
世界6資産分散ファンド	39,387,530円
野村資産設計ファンド2060	5,530,195円
野村スリーゼロ先進国株式投信	271,667,044円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数（為替ヘッジなし）連動型上場投信	2,669,990,767円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	2,538,619,352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）	157,490,761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）	75,029,982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）	755,944,504円

グローバル・インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,321,873,389円
ワールド・インデックス・ファンドＶＡ安定型（適格機関投資家専用）	1,703,794円
ワールド・インデックス・ファンドＶＡバランス型（適格機関投資家専用）	4,752,964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）	1,849,764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）	1,575,701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）	22,481,614円
野村外国株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	8,606,244円
野村世界インデックス・バランス４０ＶＡ（適格機関投資家専用）	8,695,521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）	32,097,856円
野村グローバル・インデックス・バランス５０ＶＡ（適格機関投資家専用）	103,246,846円
野村グローバル・インデックス・バランス７５ＶＡ（適格機関投資家専用）	2,450,417,166円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	28,676,815円
ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・外国株式（適格機関投資家専用）	201,324,611円
野村ＦｏＦｓ用・外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩインデックスファンド（適格機関投資家専用）	12,231,277,725円
野村ＦＯＦｓ用・ターゲット・リターン・８資産バランス（２％コース向け）（適格機関投資家専用）	1,217,124円
バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	1,451,499円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	9,107,327円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	9,426,259円
野村外国株式インデックスファンド・ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（確定拠出年金向け）	77,495,335,653円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	2,265,148,972円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	8,194,487,780円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	7,757,267,112円
マイバランスＤＣ３０	800,807,047円
マイバランスＤＣ５０	1,788,424,358円
マイバランスＤＣ７０	1,491,447,153円
野村ＤＣ外国株式インデックスファンド・ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ	28,151,701,248円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	475,969,467円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	38,948,377円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	344,124,601円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	284,544,031円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	259,405,493円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	14,126,145円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	6,544,268円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	34,985,353円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	5,627,690円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	4,925,351円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	4,061,045円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	141,714,970円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	103,198,003円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	59,197,913円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	76,293,885円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	2,456,202円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	10,919,950円
多資産分散投資ファンド（バランス１０）（確定拠出年金向け）	37,972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(2021年6月22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES CO	120,000	23.84	2,860,800.00	
		HALLIBURTON CO	150,000	23.35	3,502,500.00	
		SCHLUMBERGER LTD	242,000	33.12	8,015,040.00	
		CHENIERE ENERGY INC	42,200	85.24	3,597,128.00	
		CHEVRON CORP	329,200	106.05	34,911,660.00	
		CONOCOPHILLIPS	231,800	60.45	14,012,310.00	
		DEVON ENERGY CORP	109,000	28.60	3,117,400.00	
		EOG RESOURCES INC	100,800	84.99	8,566,992.00	
		EXXON MOBIL CORP	723,500	62.59	45,283,865.00	
		HESS CORP	47,300	90.40	4,275,920.00	
		KINDER MORGAN INC	344,000	18.29	6,291,760.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	110,100	61.05	6,721,605.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	158,000	29.50	4,661,000.00	
		ONEOK INC	74,000	55.59	4,113,660.00	
		PHILLIPS 66	73,900	87.35	6,455,165.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	35,400	161.09	5,702,586.00	
		VALERO ENERGY CORP	70,400	79.98	5,630,592.00	
		WILLIAMS COS	210,000	26.75	5,617,500.00	
		AIR PRODUCTS	38,100	296.56	11,298,936.00	
		ALBEMARLE CORP	19,700	161.41	3,179,777.00	
		CELANESE CORP-SERIES A	19,500	149.37	2,912,715.00	
		CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	35,300	51.42	1,815,126.00	
		CORTEVA INC	128,500	43.41	5,578,185.00	
		DOW INC	128,500	63.11	8,109,635.00	
		DUPONT DE NEMOURS INC	90,600	77.32	7,005,192.00	
		EASTMAN CHEMICAL CO.	23,000	119.04	2,737,920.00	
		ECOLAB INC	44,000	209.79	9,230,760.00	

FMC CORP	21,200	114.14	2,419,768.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	42,200	148.41	6,262,902.00	
LINDE PLC	89,200	288.33	25,719,036.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	45,200	102.80	4,646,560.00	
MOSAIC CO/THE	63,000	30.84	1,942,920.00	
PPG INDUSTRIES	39,800	171.64	6,831,272.00	
RPM INTERNATIONAL INC	21,100	89.10	1,880,010.00	
SHERWIN-WILLIAMS	43,300	273.10	11,825,230.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	10,500	342.23	3,593,415.00	
VULCAN MATERIALS CO	22,300	168.94	3,767,362.00	
AMCOR PLC	268,000	11.47	3,073,960.00	
AVERY DENNISON CORP	14,600	209.88	3,064,248.00	
BALL CORP	55,100	79.96	4,405,796.00	
CROWN HOLDINGS INC	22,800	99.75	2,274,300.00	
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	63,800	61.04	3,894,352.00	
PACKAGING CORP OP AMERICA	16,100	135.33	2,178,813.00	
SEALED AIR CORP	26,500	58.49	1,549,985.00	
WESTROCK CO	43,200	53.84	2,325,888.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	252,000	35.78	9,016,560.00	
NEWMONT CORP	135,400	63.43	8,588,422.00	
NUCOR CORP	50,900	95.86	4,879,274.00	
STEEL DYNAMICS	37,100	60.04	2,227,484.00	
BOEING CO	95,000	245.28	23,301,600.00	
GENERAL DYNAMICS	41,000	190.78	7,821,980.00	
HEICO CORP	7,900	141.14	1,115,006.00	
HEICO CORP-CLASS A	12,300	130.07	1,599,861.00	
HOWMET AEROSPACE INC	66,000	34.07	2,248,620.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	6,500	213.05	1,384,825.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	35,500	222.68	7,905,140.00	
LOCKHEED MARTIN	42,800	382.50	16,371,000.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	27,300	373.29	10,190,817.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	260,700	88.00	22,941,600.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	8,100	433.50	3,511,350.00	
TEXTRON INC	37,900	66.09	2,504,811.00	
TRANSDIGM GROUP INC	9,020	670.93	6,051,788.60	

ALLEGION PLC	16,300	137.77	2,245,651.00	
CARRIER GLOBAL CORP	139,000	46.50	6,463,500.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	23,400	97.71	2,286,414.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	122,200	66.33	8,105,526.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,700	328.55	1,872,735.00	
MASCO CORP	45,800	58.58	2,682,964.00	
OWENS CORNING INC	18,900	96.18	1,817,802.00	
SMITH (A.O.) CORP	21,800	67.64	1,474,552.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	40,300	179.56	7,236,268.00	
AMETEK INC	39,000	133.72	5,215,080.00	
EATON CORP PLC	68,700	143.04	9,826,848.00	
EMERSON ELEC	103,500	94.93	9,825,255.00	
GENERAC HOLDINGS INC	11,000	389.21	4,281,310.00	
PLUG POWER INC	85,600	29.85	2,555,160.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	19,600	280.32	5,494,272.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	28,300	57.34	1,622,722.00	
SUNRUN INC	29,200	50.15	1,464,380.00	
3M CORP	99,400	195.21	19,403,874.00	
GENERAL ELEC CO	1,505,000	13.19	19,850,950.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	119,300	216.00	25,768,800.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	38,300	63.17	2,419,411.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	18,130	458.30	8,308,979.00	
CATERPILLAR INC DEL	93,600	213.21	19,956,456.00	
CUMMINS INC	24,900	235.89	5,873,661.00	
DEERE & COMPANY	50,600	337.88	17,096,728.00	
DOVER CORP	24,300	146.30	3,555,090.00	
FORTIVE CORP	56,200	69.52	3,907,024.00	
IDEX CORP	13,300	217.11	2,887,563.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	54,100	223.11	12,070,251.00	
INGERSOLL-RAND INC	62,100	46.92	2,913,732.00	
NORDSON CORP	9,800	219.56	2,151,688.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	69,600	81.04	5,640,384.00	
PACCAR	58,300	87.40	5,095,420.00	
PARKER HANNIFIN CORP	22,400	288.05	6,452,320.00	

PENTAIR PLC	27,500	65.70	1,806,750.00	
SNAP-ON INC	9,700	220.53	2,139,141.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	27,100	198.79	5,387,209.00	
WABTEC CORP	31,800	79.48	2,527,464.00	
XYLEM INC	30,300	116.33	3,524,799.00	
FASTENAL CO	96,900	51.46	4,986,474.00	
GRAINGER(W.W.) INC	7,940	445.09	3,534,014.60	
UNITED RENTALS INC	12,200	299.21	3,650,362.00	
CINTAS CORP	16,000	362.79	5,804,640.00	
COPART INC	35,800	131.72	4,715,576.00	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	38,700	108.43	4,196,241.00	
ROLLINS INC	35,850	33.73	1,209,220.50	
WASTE CONNECTIONS INC	44,500	119.91	5,335,995.00	
WASTE MANAGEMENT INC	73,000	139.36	10,173,280.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	22,000	94.35	2,075,700.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	29,000	123.45	3,580,050.00	
FEDEX CORPORATION	42,700	293.16	12,517,932.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	123,400	203.32	25,089,688.00	
XPO LOGISTICS INC	15,900	145.69	2,316,471.00	
DELTA AIR LINES INC	25,200	45.77	1,153,404.00	
SOUTHWEST AIRLINES	24,900	56.30	1,401,870.00	
AMERCO	1,720	534.85	919,942.00	
CSX CORP	129,900	95.81	12,445,719.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	14,600	159.69	2,331,474.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	15,900	283.63	4,509,717.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	26,700	45.48	1,214,316.00	
LYFT INC-A	43,500	59.50	2,588,250.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	43,500	264.76	11,517,060.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	17,400	251.40	4,374,360.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	204,200	48.12	9,826,104.00	
UNION PAC CORP	114,500	217.51	24,904,895.00	
APTIV PLC	45,400	150.44	6,829,976.00	
AUTOLIV INC	14,000	98.12	1,373,680.00	
BORGWARNER INC	40,400	48.50	1,959,400.00	

LEAR CORP	9,700	173.87	1,686,539.00	
FORD MOTOR COMPANY	674,000	14.78	9,961,720.00	
GENERAL MOTORS CO	220,400	59.30	13,069,720.00	
TESLA INC	131,230	620.83	81,471,520.90	
DR HORTON INC	58,600	90.55	5,306,230.00	
GARMIN LTD	26,000	142.01	3,692,260.00	
LENNAR CORP-A	46,500	97.60	4,538,400.00	
MOHAWK INDUSTRIES	10,200	187.20	1,909,440.00	
NEWELL BRANDS INC	66,000	26.54	1,751,640.00	
NVR INC	607	4,817.69	2,924,337.83	
PULTEGROUP INC	47,000	54.20	2,547,400.00	
WHIRLPOOL CORP	10,300	214.52	2,209,556.00	
HASBRO INC	21,400	92.16	1,972,224.00	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	42,500	108.11	4,594,675.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	20,800	352.29	7,327,632.00	
NIKE INC-B	217,300	130.08	28,266,384.00	
V F CORP	56,300	80.60	4,537,780.00	
AIRBNB INC-CLASS A	10,900	149.70	1,631,730.00	
ARAMARK	39,000	37.36	1,457,040.00	
BOOKING HOLDINGS INC	6,960	2,263.07	15,750,967.20	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	35,300	103.82	3,664,846.00	
CARNIVAL CORP	140,000	28.67	4,013,800.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,780	1,426.60	6,819,148.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	22,000	133.43	2,935,460.00	
DOMINOS PIZZA INC	6,900	459.46	3,170,274.00	
DRAFTKINGS INC - CL A	27,700	49.00	1,357,300.00	
EXPEDIA GROUP INC	23,600	167.92	3,962,912.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	46,800	126.74	5,931,432.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	58,600	54.57	3,197,802.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	46,400	142.88	6,629,632.00	
MCDONALD'S CORP	127,400	232.90	29,671,460.00	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	17.42	592,280.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	67,000	42.09	2,820,030.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	38,600	87.40	3,373,640.00	
STARBUCKS CORP	202,000	110.97	22,415,940.00	

VAIL RESORTS INC	6,700	320.90	2,150,030.00	
WYNN RESORTS LTD	17,100	127.61	2,182,131.00	
YUM BRANDS INC	50,800	116.76	5,931,408.00	
GENUINE PARTS CO	25,200	124.42	3,135,384.00	
LKQ CORP	49,000	48.12	2,357,880.00	
POOL CORP	7,000	452.90	3,170,300.00	
AMAZON.COM INC	73,150	3,453.96	252,657,174.00	
CHEWY INC - CLASS A	12,300	77.85	957,555.00	
EBAY INC	116,500	64.40	7,502,600.00	
ETSY INC	20,900	170.79	3,569,511.00	
MERCADOLIBRE INC	7,670	1,476.34	11,323,527.80	
WAYFAIR INC - CLASS A	12,400	304.06	3,770,344.00	
DOLLAR GENERAL CORP	41,800	213.97	8,943,946.00	
DOLLAR TREE INC	40,700	101.19	4,118,433.00	
TARGET CORP	85,100	233.77	19,893,827.00	
ADVANCE AUTO PARTS	12,000	198.47	2,381,640.00	
AUTOZONE	3,930	1,415.60	5,563,308.00	
BEST BUY COMPANY INC	39,300	108.68	4,271,124.00	
BURLINGTON STORES INC	11,400	310.08	3,534,912.00	
CARMAX INC	27,900	116.09	3,238,911.00	
CARVANA CO	12,400	295.73	3,667,052.00	
HOME DEPOT	184,000	307.60	56,598,400.00	
L BRANDS, INC	40,200	65.79	2,644,758.00	
LOWES COS INC	124,500	188.88	23,515,560.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	12,250	547.00	6,700,750.00	
ROSS STORES INC	61,700	119.41	7,367,597.00	
TJX COS INC	203,700	64.91	13,222,167.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	19,500	175.37	3,419,715.00	
ULTA BEAUTY INC	9,400	334.90	3,148,060.00	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	75,710	386.80	29,284,628.00	
KROGER CO	123,000	39.58	4,868,340.00	
SYSCO CORP	86,600	77.36	6,699,376.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	124,500	51.93	6,465,285.00	
WALMART INC	265,900	136.40	36,268,760.00	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	1,540	986.08	1,518,563.20	

BROWN-FORMAN CORP-CL B	52,700	74.03	3,901,381.00	
COCA COLA CO	699,600	54.36	38,030,256.00	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	36,300	62.50	2,268,750.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	29,200	225.94	6,597,448.00	
KEURIG DR PEPPER INC	119,000	34.29	4,080,510.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	31,400	55.71	1,749,294.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	66,600	92.04	6,129,864.00	
PEPSICO INC	235,800	146.56	34,558,848.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	93,800	61.84	5,800,592.00	
BUNGE LIMITED	24,700	80.18	1,980,446.00	
CAMPBELL SOUP CO	36,000	45.55	1,639,800.00	
CONAGRA BRANDS INC	82,100	35.84	2,942,464.00	
GENERAL MILLS	102,800	60.14	6,182,392.00	
HERSHEY CO/THE	25,100	172.24	4,323,224.00	
HORMEL FOODS CORP	50,000	47.82	2,391,000.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,600	131.12	2,438,832.00	
KELLOGG CO	43,300	64.17	2,778,561.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	114,000	40.83	4,654,620.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	23,900	79.66	1,903,874.00	
MCCORMICK & CO INC.	43,200	87.17	3,765,744.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	242,900	62.66	15,220,114.00	
TYSON FOODS INC-CL A	50,100	73.57	3,685,857.00	
ALTRIA GROUP INC	315,700	47.29	14,929,453.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	267,100	100.16	26,752,736.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	42,500	83.95	3,567,875.00	
CLOROX CO	21,300	172.92	3,683,196.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	139,400	81.44	11,352,736.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	57,200	129.46	7,405,112.00	
PROCTER & GAMBLE CO	420,800	133.07	55,995,856.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	39,600	301.48	11,938,608.00	
ABBOTT LABORATORIES	302,800	111.44	33,744,032.00	
ABIOMED INC	8,000	325.09	2,600,720.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	12,950	611.54	7,919,443.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	85,500	81.51	6,969,105.00	
BECTON,DICKINSON	49,600	240.83	11,945,168.00	

BOSTON SCIENTIFIC CORP	241,000	43.60	10,507,600.00	
DANAHER CORP	109,900	262.59	28,858,641.00	
DENTSPLY SIRONA INC	38,400	64.99	2,495,616.00	
DEXCOM INC	16,700	423.03	7,064,601.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	106,900	102.84	10,993,596.00	
HOLOGIC INC	43,400	63.17	2,741,578.00	
IDEXX LABORATORIES INC	14,760	606.63	8,953,858.80	
INSULET CORP	11,600	281.58	3,266,328.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	20,220	894.00	18,076,680.00	
MASIMO CORP	9,300	240.66	2,238,138.00	
MEDTRONIC PLC	230,300	125.54	28,911,862.00	
NOVOCURE LTD	15,200	220.52	3,351,904.00	
RESMED INC	24,500	239.52	5,868,240.00	
STERIS PLC	17,400	201.36	3,503,664.00	
STRYKER CORP	57,500	259.73	14,934,475.00	
TELEFLEX INC	8,100	400.29	3,242,349.00	
THE COOPER COMPANIES, INC.	8,300	389.44	3,232,352.00	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	12,400	357.59	4,434,116.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	34,900	163.48	5,705,452.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	25,700	116.62	2,997,134.00	
ANTHEM INC	41,600	376.41	15,658,656.00	
CARDINAL HEALTH INC	51,400	56.68	2,913,352.00	
CENTENE CORP	100,700	72.17	7,267,519.00	
CIGNA CORP	59,700	236.48	14,117,856.00	
CVS HEALTH CORP	225,200	84.02	18,921,304.00	
DAVITA INC	12,500	124.36	1,554,500.00	
HCA HEALTHCARE INC	46,400	208.09	9,655,376.00	
HENRY SCHEIN INC	23,100	76.39	1,764,609.00	
HUMANA INC	22,280	435.55	9,704,054.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	16,900	265.33	4,484,077.00	
MCKESSON CORP	27,700	188.72	5,227,544.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	9,700	246.40	2,390,080.00	
OAK STREET HEALTH INC	16,300	58.54	954,202.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	23,500	129.43	3,041,605.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	162,200	398.07	64,566,954.00	

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	13,000	151.85	1,974,050.00	
ABBVIE INC	301,800	114.73	34,625,514.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	38,300	180.66	6,919,278.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	20,400	171.26	3,493,704.00	
AMGEN INC	98,900	240.24	23,759,736.00	
BIOGEN INC	26,000	380.91	9,903,660.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	30,600	80.76	2,471,256.00	
EXACT SCIENCES CORP	29,600	127.66	3,778,736.00	
GILEAD SCIENCES INC	216,100	67.35	14,554,335.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	38,500	93.88	3,614,380.00	
INCYTE CORP	31,200	84.93	2,649,816.00	
MODERNA INC	53,700	208.24	11,182,488.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	17,000	101.79	1,730,430.00	
NOVAVAX INC	11,900	180.99	2,153,781.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	17,990	534.27	9,611,517.30	
SEAGEN INC	23,100	158.30	3,656,730.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	44,600	187.70	8,371,420.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	384,300	66.83	25,682,769.00	
CATALENT INC	28,000	109.75	3,073,000.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	74,000	34.87	2,580,380.00	
ELI LILLY & CO.	139,200	222.67	30,995,664.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,600	177.22	1,878,532.00	
JOHNSON & JOHNSON	449,200	163.84	73,596,928.00	
MERCK & CO INC	432,400	76.75	33,186,700.00	
PFIZER INC	953,000	39.42	37,567,260.00	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	28,900	43.08	1,245,012.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	195,000	10.11	1,971,450.00	
VIATRIS INC	215,000	14.35	3,085,250.00	
ZOETIS INC	80,700	186.60	15,058,620.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,328,000	39.75	52,788,000.00	
CITIGROUP	357,100	68.45	24,443,495.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	74,400	45.50	3,385,200.00	
FIFTH THIRD BANCORP	120,000	37.79	4,534,800.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	30,300	183.60	5,563,080.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	256,000	13.68	3,502,080.00	

JPMORGAN CHASE & CO	521,500	150.43	78,449,245.00	
KEYCORP	170,000	20.59	3,500,300.00	
M & T BANK CORP	21,700	147.65	3,204,005.00	
PNC FINANCIAL	72,000	184.15	13,258,800.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	162,000	19.86	3,217,320.00	
SVB FINANCIAL GROUP	8,700	553.47	4,815,189.00	
TRUIST FINANCIAL CORP	229,000	54.50	12,480,500.00	
US BANCORP	242,200	55.98	13,558,356.00	
WELLS FARGO CO	706,600	43.28	30,581,648.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	234,300	277.10	64,924,530.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	69,000	30.32	2,092,080.00	
VOYA FINANCIAL INC	21,700	60.90	1,321,530.00	
AFLAC INC	113,000	53.07	5,996,910.00	
ALLEGHANY CORP	2,300	674.06	1,550,338.00	
ALLSTATE CORP	51,400	128.16	6,587,424.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,500	123.81	1,547,625.00	
AMERICAN INTL GROUP	149,600	47.75	7,143,400.00	
AON PLC	38,500	234.00	9,009,000.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	71,000	37.90	2,690,900.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	33,300	139.66	4,650,678.00	
ASSURANT INC	10,200	154.73	1,578,246.00	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,200	63.66	1,349,592.00	
BROWN & BROWN INC	42,700	52.46	2,240,042.00	
CHUBB LTD	77,200	159.03	12,277,116.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	26,700	116.86	3,120,162.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	4,400	190.14	836,616.00	
EVEREST RE GROUP LTD	7,100	243.58	1,729,418.00	
FNF GROUP	45,400	44.65	2,027,110.00	
GLOBE LIFE INC	17,700	95.70	1,693,890.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	62,200	62.15	3,865,730.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	33,500	61.79	2,069,965.00	
LOEWS CORP	38,500	54.56	2,100,560.00	
MARKEL CORP	2,330	1,184.15	2,759,069.50	
MARSH & MCLENNAN COS	86,800	136.34	11,834,312.00	
METLIFE INC	129,000	59.68	7,698,720.00	

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	48,000	61.62	2,957,760.00	
PROGRESSIVE CO	101,100	94.60	9,564,060.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	68,700	100.77	6,922,899.00	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	12,200	115.81	1,412,882.00	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	9,200	144.52	1,329,584.00	
TRAVELERS COS INC/THE	42,600	148.65	6,332,490.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	21,800	230.18	5,017,924.00	
WR BERKLEY CORP	23,900	74.35	1,776,965.00	
ACCENTURE PLC-CL A	108,400	285.56	30,954,704.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	27,400	115.82	3,173,468.00	
AUTOMATIC DATA PROCESS	72,800	196.47	14,303,016.00	
BLACK KNIGHT INC	27,000	75.52	2,039,040.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	19,400	160.89	3,121,266.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	92,000	69.62	6,405,040.00	
EPAM SYSTEMS INC	9,500	518.54	4,926,130.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	105,400	145.57	15,343,078.00	
FISERV INC	103,000	108.49	11,174,470.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	13,400	263.00	3,524,200.00	
GARTNER INC	15,300	238.87	3,654,711.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	50,400	193.68	9,761,472.00	
GODADDY INC - CLASS A	29,600	84.84	2,511,264.00	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	153,300	146.65	22,481,445.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	12,700	166.85	2,118,995.00	
MASTERCARD INC	151,500	373.09	56,523,135.00	
MONGODB INC	9,500	380.00	3,610,000.00	
OKTA INC	20,300	233.18	4,733,554.00	
PAYCHEX INC	54,800	103.66	5,680,568.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	190,100	283.10	53,817,310.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3,900	248.29	968,331.00	
SQUARE INC - A	67,000	233.89	15,670,630.00	
TWILIO INC - A	27,200	363.19	9,878,768.00	
VERISIGN INC	17,600	224.74	3,955,424.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	289,900	234.32	67,929,368.00	
WESTERN UNION CO	66,000	23.64	1,560,240.00	
WIX.COM LTD	9,400	285.97	2,688,118.00	

ADOBE INC	81,810	567.35	46,414,903.50	
ANSYS INC	14,500	336.83	4,884,035.00	
AUTODESK INC.	37,600	283.22	10,649,072.00	
AVALARA INC	15,300	155.74	2,382,822.00	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	29,100	66.44	1,933,404.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	46,900	132.13	6,196,897.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	21,600	92.41	1,996,056.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	18,700	119.25	2,229,975.00	
CITRIX SYSTEMS INC	21,800	116.06	2,530,108.00	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	39,400	101.08	3,982,552.00	
COUPA SOFTWARE INC	12,700	240.71	3,057,017.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	30,200	237.68	7,177,936.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	7,100	136.00	965,600.00	
DATADOG INC - CLASS A	29,300	102.35	2,998,855.00	
DOCUSIGN INC	32,100	270.02	8,667,642.00	
DROPBOX INC-CLASS A	51,000	29.28	1,493,280.00	
DYNATRACE INC	33,000	57.77	1,906,410.00	
FAIR ISAAC CORP	5,120	506.32	2,592,358.40	
FORTINET INC	23,500	237.92	5,591,120.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	13,600	111.76	1,519,936.00	
HUBSPOT INC	7,590	575.50	4,368,045.00	
INTUIT INC	46,700	477.90	22,317,930.00	
MICROSOFT CORP	1,224,500	262.63	321,590,435.00	
NORTONLIFELOCK INC	102,000	27.37	2,791,740.00	
ORACLE CORPORATION	328,200	77.99	25,596,318.00	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	89,000	25.42	2,262,380.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	16,400	370.94	6,083,416.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	9,000	356.70	3,210,300.00	
PTC INC	18,700	134.65	2,517,955.00	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	12,500	287.38	3,592,250.00	
SALESFORCE.COM INC	156,800	244.48	38,334,464.00	
SERVICENOW INC	33,690	534.75	18,015,727.50	
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	83,000	44.57	3,699,310.00	
SPLUNK INC	27,000	125.49	3,388,230.00	

SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	40,300	72.84	2,935,452.00	
SYNOPSYS INC	26,400	264.80	6,990,720.00	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	73,100	61.26	4,478,106.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	7,100	446.25	3,168,375.00	
UNITY SOFTWARE INC	9,400	107.89	1,014,166.00	
VMWARE INC - CLASS A	14,200	157.34	2,234,228.00	
WORKDAY INC-CLASS A	30,400	236.93	7,202,672.00	
ZENDESK INC	20,500	146.07	2,994,435.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	35,000	369.25	12,923,750.00	
ZSCALER INC	13,700	216.41	2,964,817.00	
ARISTA NETWORKS INC	9,600	369.50	3,547,200.00	
CISCO SYSTEMS	721,500	53.18	38,369,370.00	
F5 NETWORKS INC	10,400	185.48	1,928,992.00	
JUNIPER NETWORKS INC	53,000	27.64	1,464,920.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	28,700	211.31	6,064,597.00	
APPLE INC	2,869,100	132.30	379,581,930.00	
DELL TECHNOLOGIES-C	46,000	100.00	4,600,000.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	220,000	14.73	3,240,600.00	
HP INC	212,000	29.21	6,192,520.00	
NETAPP INC	38,200	79.43	3,034,226.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	36,200	85.31	3,088,222.00	
WESTERN DIGITAL CORP	51,600	69.20	3,570,720.00	
AMPHENOL CORP-CL A	103,700	67.03	6,951,011.00	
ARROW ELECTRS INC	12,100	112.33	1,359,193.00	
CDW CORPORATION	23,900	169.73	4,056,547.00	
COGNEX CORP	30,800	79.37	2,444,596.00	
CORNING INC	129,000	39.39	5,081,310.00	
IPG PHOTONICS CORP	5,900	204.41	1,206,019.00	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	32,100	149.08	4,785,468.00	
TE CONNECTIVITY LTD	57,200	131.64	7,529,808.00	
TRIMBLE INC	42,200	78.96	3,332,112.00	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	8,900	504.13	4,486,757.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	208,100	82.59	17,186,979.00	
ANALOG DEVICES INC	63,400	164.15	10,407,110.00	
APPLIED MATERIALS	157,500	133.05	20,955,375.00	

BROADCOM INC	69,770	464.61	32,415,839.70
ENPHASE ENERGY INC	21,600	163.08	3,522,528.00
INTEL CORP	694,400	55.87	38,796,128.00
KLA CORP	26,600	308.81	8,214,346.00
LAM RESEARCH	24,460	618.62	15,131,445.20
MARVELL TECHNOLOGY INC	138,000	54.82	7,565,160.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	45,200	100.48	4,541,696.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	46,600	147.75	6,885,150.00
MICRON TECHNOLOGY	192,300	77.07	14,820,561.00
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	7,600	354.11	2,691,236.00
NVIDIA CORP	105,790	737.09	77,976,751.10
NXP SEMICONDUCTORS NV	48,000	198.46	9,526,080.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	68,000	36.49	2,481,320.00
QORVO INC	19,400	176.24	3,419,056.00
QUALCOMM INC	194,800	133.96	26,095,408.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	28,700	171.54	4,923,198.00
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	9,200	258.61	2,379,212.00
TERADYNE INC	28,900	126.22	3,647,758.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	157,300	186.11	29,275,103.00
XILINX INC	41,200	127.53	5,254,236.00
AT & T INC	1,219,000	28.93	35,265,670.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	27.15	651,600.00
LIBERTY GLOBAL PLC-C	64,000	27.19	1,740,160.00
LUMEN TECHNOLOGIES INC	165,000	14.12	2,329,800.00
VERIZON COMMUNICATIONS	707,200	56.39	39,879,008.00
T-MOBILE US INC	105,500	145.66	15,367,130.00
ALLIANT ENERGY CORP	40,900	57.33	2,344,797.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	86,000	83.19	7,154,340.00
DUKE ENERGY CORP	131,300	101.31	13,302,003.00
EDISON INTERNATIONAL	65,800	56.10	3,691,380.00
ENTERGY CORP	33,600	104.49	3,510,864.00
EVERGY INC	39,900	63.71	2,542,029.00
EVERSOURCE ENERGY	59,300	80.69	4,784,917.00
EXELON CORPORATION	168,800	44.71	7,547,048.00
FIRSTENERGY CORP	93,000	37.79	3,514,470.00

NEXTERA ENERGY INC	336,200	74.33	24,989,746.00
NRG ENERGY INC	40,500	37.91	1,535,355.00
PG&E CORP	261,000	10.26	2,677,860.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	19,100	82.63	1,578,233.00
PPL CORPORATION	129,000	28.12	3,627,480.00
SOUTHERN CO.	180,800	62.50	11,300,000.00
XCEL ENERGY INC	93,200	67.14	6,257,448.00
ATMOS ENERGY CORP	22,200	99.04	2,198,688.00
UGI CORP	36,000	46.28	1,666,080.00
AMEREN CORPORATION	44,400	83.39	3,702,516.00
CENTERPOINT ENERGY INC	94,000	24.94	2,344,360.00
CMS ENERGY CORP	48,200	58.53	2,821,146.00
CONSOLIDATED EDISON INC	57,000	75.19	4,285,830.00
DOMINION ENERGY INC	137,300	75.90	10,421,070.00
DTE ENERGY COMPANY	32,800	132.91	4,359,448.00
NISOURCE INC	65,000	25.39	1,650,350.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	85,800	60.06	5,153,148.00
SEMPRA ENERGY	53,800	138.46	7,449,148.00
WEC ENERGY GROUP INC	53,600	90.67	4,859,912.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	30,600	161.30	4,935,780.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	39,600	47.50	1,881,000.00
ALLY FINANCIAL INC	63,000	50.23	3,164,490.00
AMERICAN EXPRESS CO	116,300	164.90	19,177,870.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	78,300	154.89	12,127,887.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	51,900	118.05	6,126,795.00
SYNCHRONY FINANCIAL	99,100	48.00	4,756,800.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	20,000	241.35	4,827,000.00
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,300	58.47	1,830,111.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	141,700	49.66	7,036,822.00
BLACKROCK INC	26,190	861.26	22,556,399.40
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	117,800	98.31	11,580,918.00
CARLYLE GROUP INC/THE	29,000	45.15	1,309,350.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	17,900	118.04	2,112,916.00
CME GROUP INC	61,400	216.01	13,263,014.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,400	329.67	2,109,888.00

FRANKLIN RESOURCES INC	51,000	32.42	1,653,420.00
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	8,200	148.09	1,214,338.00
GOLDMAN SACHS GROUP	59,300	357.54	21,202,122.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	96,100	113.70	10,926,570.00
INVESCO LTD	68,000	26.90	1,829,200.00
KKR & CO INC-A	90,400	57.90	5,234,160.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,700	455.20	3,049,840.00
MOODYS CORP	29,000	355.65	10,313,850.00
MORGAN STANLEY	242,300	85.94	20,823,262.00
MSCI INC	14,270	515.59	7,357,469.30
NASDAQ INC	20,100	178.78	3,593,478.00
NORTHERN TRUST CORP	34,300	113.16	3,881,388.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	21,200	128.21	2,718,052.00
S&P GLOBAL INC	40,900	399.52	16,340,368.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	247,800	72.74	18,024,972.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	61.68	1,178,088.00
STATE STREET CORP	59,600	81.61	4,863,956.00
T ROWE PRICE GROUP INC	39,400	194.97	7,681,818.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	16,400	85.62	1,404,168.00
AES CORP	110,000	26.15	2,876,500.00
VISTRA CORP	70,000	17.92	1,254,400.00
CERNER CORP	52,000	79.48	4,132,960.00
TELADOC HEALTH INC	23,000	155.39	3,573,970.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	23,600	308.26	7,274,936.00
10X GENOMICS INC-CLASS A	13,000	197.88	2,572,440.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	51,900	146.41	7,598,679.00
AVANTOR INC	91,000	34.91	3,176,810.00
BIO TECHNE CORP	6,600	440.21	2,905,386.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	3,640	625.67	2,277,438.80
CHARLES RIVER LABORATORIES	8,500	360.59	3,065,015.00
ILLUMINA INC	25,000	461.05	11,526,250.00
IQVIA HOLDINGS INC	33,200	243.45	8,082,540.00
METTLER-TOLEDO INTL	4,110	1,364.55	5,608,300.50
PERKINELMER INC	18,800	152.43	2,865,684.00
PPD INC	20,000	46.29	925,800.00
	67,320	483.56	32,553,259.20

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC				
WATERS CORP	10,500	342.44	3,595,620.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	22,600	88.24	1,994,224.00	
CLARIVATE PLC	57,000	26.00	1,482,000.00	
COSTAR GROUP INC	6,620	900.98	5,964,487.60	
EQUIFAX INC	20,700	238.72	4,941,504.00	
IHS MARKIT LTD	63,800	110.26	7,034,588.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	22,900	132.82	3,041,578.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	23,800	105.81	2,518,278.00	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	20,300	87.94	1,785,182.00	
TRUNSON	33,200	109.99	3,651,668.00	
VERISK ANALYTICS INC	26,000	174.91	4,547,660.00	
CBRE GROUP INC	58,000	89.00	5,162,000.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	184,000	4.88	897,920.00	
ALTICE USA INC-A	42,000	33.91	1,424,220.00	
CABLE ONE INC	980	1,854.28	1,817,194.40	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	23,020	694.81	15,994,526.20	
COMCAST CORP-CL A	781,200	57.28	44,747,136.00	
DISCOVERY INC - A	24,500	29.69	727,405.00	
DISCOVERY INC - C	49,100	27.96	1,372,836.00	
DISH NETWORK CORP-A	43,400	40.98	1,778,532.00	
FOX CORP-CLASS A	58,000	37.49	2,174,420.00	
FOX CORP-CLASS B	25,400	35.77	908,558.00	
INTERPUBRIC GROUP	67,000	32.39	2,170,130.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-A	4,000	158.20	632,800.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	27,600	162.78	4,492,728.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	29,900	44.13	1,319,487.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	44.60	575,340.00	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	67,000	25.73	1,723,910.00	
OMNICOM GROUP	37,600	79.81	3,000,856.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	175,000	6.32	1,106,000.00	
VIACOMCBS INC-CLASS B	95,100	40.96	3,895,296.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	132,200	91.82	12,138,604.00	
DISNEY (WALT) CO	310,200	173.97	53,965,494.00	
ELECTRONIC ARTS	48,500	140.96	6,836,560.00	
	34,000	45.28	1,539,520.00	

	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C				
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	26,600	89.06	2,368,996.00	
	NETFLIX INC	75,690	497.00	37,617,930.00	
	ROKU INC	18,500	382.73	7,080,505.00	
	SEA LTD-ADR	2,300	281.06	646,438.00	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	19,400	173.47	3,365,318.00	
	ALPHABET INC-CL A	51,400	2,436.25	125,223,250.00	
	ALPHABET INC-CL C	50,380	2,529.10	127,416,058.00	
	FACEBOOK INC-A	411,100	332.29	136,604,419.00	
	IAC/ INTERACTIVECORP	13,600	152.46	2,073,456.00	
	MATCH GROUP INC	43,600	155.72	6,789,392.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	92,300	71.13	6,565,299.00	
	SNAP INC-A	159,000	63.60	10,112,400.00	
	TWITTER INC	136,800	61.96	8,476,128.00	
	ZILLOW GROUP INC - A	9,800	113.84	1,115,632.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	27,500	112.99	3,107,225.00	
小計	銘柄数：600			6,383,325,873.03	
				(703,953,177,277)	
	組入時価比率：68.9%			71.7%	
カナダドル	CAMECO CORP	72,000	24.06	1,732,320.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	199,000	44.89	8,933,110.00	
	CENOVUS ENERGY INC	216,000	12.39	2,676,240.00	
	ENBRIDGE INC	344,000	49.47	17,017,680.00	
	IMPERIAL OIL	46,000	40.27	1,852,420.00	
	INTER PIPELINE LTD	60,000	20.30	1,218,000.00	
	KEYERA CORP	34,000	32.92	1,119,280.00	
	PARKLAND CORP	28,000	38.17	1,068,760.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	96,000	40.78	3,914,880.00	
	SUNCOR ENERGY INC	263,000	30.30	7,968,900.00	
	TC ENERGY CORP	162,400	63.97	10,388,728.00	
	NUTRIEN LTD	96,100	73.70	7,082,570.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	24,700	68.88	1,701,336.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	41,000	79.20	3,247,200.00	
	B2GOLD CORP	175,000	5.50	962,500.00	
	BARRICK GOLD	299,000	26.14	7,815,860.00	

FIRST QUANTUM MINERALS LTD	103,000	26.29	2,707,870.00	
FRANCO-NEVADA CORP	32,300	182.92	5,908,316.00	
IVANHOE MINES LTD-CL A	103,000	8.00	824,000.00	
KINROSS GOLD CORP	217,000	8.04	1,744,680.00	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	48,000	49.51	2,376,480.00	
LUNDIN MINING CORP	118,000	10.27	1,211,860.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	35,300	35.47	1,252,091.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	79,000	26.27	2,075,330.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	76,100	54.98	4,183,978.00	
YAMANA GOLD INC	164,000	5.47	897,080.00	
WEST FRASER TIMBER	14,000	87.30	1,222,200.00	
CAE INC	50,000	39.00	1,950,000.00	
WSP GLOBAL INC	19,800	140.89	2,789,622.00	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	37,000	20.92	774,040.00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	15,000	105.90	1,588,500.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	30,000	38.41	1,152,300.00	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	18,300	73.94	1,353,102.00	
AIR CANADA	32,000	27.40	876,800.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	120,600	129.80	15,653,880.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	113,500	94.79	10,758,665.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	48,200	113.36	5,463,952.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	31,800	42.88	1,363,584.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	45,400	82.25	3,734,150.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	10,200	197.54	2,014,908.00	
DOLLARAMA INC	52,000	56.56	2,941,120.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	145,000	43.35	6,285,750.00	
EMPIRE CO LTD A	32,000	41.50	1,328,000.00	
LOBLAW COMPANIES	28,500	75.18	2,142,630.00	
METRO INC	43,500	58.75	2,555,625.00	
WESTON(GEORGE)LTD	12,300	117.61	1,446,603.00	
SAPUTO INC	41,000	36.55	1,498,550.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	51,000	36.26	1,849,260.00	
CANOPY GROWTH CORP	35,000	28.92	1,012,200.00	
BANK OF MONTREAL	111,400	128.05	14,264,770.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	205,800	79.85	16,433,130.00	

CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	77,300	146.33	11,311,309.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	58,300	92.82	5,411,406.00	
ROYAL BANK OF CANADA	244,300	126.26	30,845,318.00	
TORONTO DOMINION BANK	311,600	87.56	27,283,696.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,640	545.02	2,528,892.80	
GREAT-WEST LIFE CO INC	50,000	36.62	1,831,000.00	
IA FINANCIAL CORP INC	18,300	67.73	1,239,459.00	
INTACT FINANCIAL CORP	27,500	169.12	4,650,800.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	326,000	24.10	7,856,600.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	97,000	39.83	3,863,510.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	98,800	62.71	6,195,748.00	
CGI INC	37,100	111.85	4,149,635.00	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	8,500	91.50	777,750.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	19,270	1,823.70	35,142,699.00	
BLACKBERRY LTD	94,000	15.79	1,484,260.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,410	1,846.34	6,296,019.40	
LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	16,400	101.78	1,669,192.00	
OPEN TEXT CORP	47,000	61.76	2,902,720.00	
BCE INC	10,600	61.22	648,932.00	
TELUS CORP	78,600	27.73	2,179,578.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	58,200	64.40	3,748,080.00	
EMERA INC	42,500	57.30	2,435,250.00	
FORTIS INC	81,000	56.53	4,578,930.00	
HYDRO ONE LTD	55,000	30.35	1,669,250.00	
ALTAGAS LTD	52,000	26.04	1,354,080.00	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	97,000	18.75	1,818,750.00	
ATCO LTD CL1	13,000	45.53	591,890.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	20,300	35.64	723,492.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	221,100	61.41	13,577,751.00	
IGM FINANCIAL INC	15,000	44.68	670,200.00	
ONEX CORPORATION	13,200	88.18	1,163,976.00	
TMX GROUP LTD	9,500	131.94	1,253,430.00	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	24,000	49.81	1,195,440.00	
NORTHLAND POWER INC	40,000	41.73	1,669,200.00	
	30,500	121.68	3,711,240.00	

小計	銘柄数：89				
	組入時価比率：3.6%				
				407,960,727.20	
				(36,328,902,757)	
				3.7%	
ユーロ	TENARIS SA	88,000	9.22	811,360.00	
	ENI SPA	428,000	10.41	4,458,904.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	81,000	9.76	790,722.00	
	NESTE OYJ	71,400	52.26	3,731,364.00	
	OMV AG	25,000	48.47	1,211,750.00	
	REPSOL SA	262,000	10.76	2,821,216.00	
	TOTALENERGIES SE	428,100	39.96	17,106,876.00	
	VOPAK	11,400	38.63	440,382.00	
	AIR LIQUIDE SA	80,400	148.20	11,915,280.00	
	AKZO NOBEL	32,900	106.85	3,515,365.00	
	ARKEMA	11,600	105.85	1,227,860.00	
	BASF SE	156,000	65.69	10,247,640.00	
	COVESTRO AG	34,400	53.18	1,829,392.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	33,000	28.34	935,220.00	
	FUCHS PETROLUB SE -PFD	10,500	42.24	443,520.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	29,100	154.20	4,487,220.00	
	LANXESS	12,700	58.42	741,934.00	
	SOLVAY SA	13,000	107.95	1,403,350.00	
	SYMRISE AG	22,500	116.40	2,619,000.00	
	UMICORE	34,300	49.02	1,681,386.00	
	CRH PLC	132,200	42.55	5,625,110.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	24,900	72.62	1,808,238.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	42,300	44.55	1,884,465.00	
	ARCELORMITTAL	119,000	24.24	2,884,560.00	
	VOESTALPINE AG	20,000	34.28	685,600.00	
	STORA ENSO OYJ-R	96,000	14.98	1,438,560.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	91,000	31.67	2,881,970.00	
	AIRBUS SE	100,600	112.92	11,359,752.00	
	DASSAULT AVIATION SA	500	1,021.00	510,500.00	

MTU AERO ENGINES AG	9,200	221.40	2,036,880.00	
SAFRAN SA	58,000	125.94	7,304,520.00	
THALES SA	18,600	85.32	1,586,952.00	
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	87,800	56.31	4,944,018.00	
KINGSPAN GROUP PLC	26,400	76.74	2,025,936.00	
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	43,000	24.34	1,046,620.00	
BOUYGUES	40,000	32.86	1,314,400.00	
EIFFAGE SA	14,100	88.40	1,246,440.00	
FERROVIAL SA	80,454	25.08	2,017,786.32	
VINCI	91,800	94.02	8,631,036.00	
LEGRAND SA	45,200	87.94	3,974,888.00	
PRYSMIAN SPA	43,000	29.83	1,282,690.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	91,500	134.38	12,295,770.00	
SIEMENS ENERGY AG	66,000	25.43	1,678,380.00	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	38,000	26.61	1,011,180.00	
SIEMENS AG	129,900	136.50	17,731,350.00	
ALSTOM	49,300	43.00	2,119,900.00	
CNH INDUSTRIAL NV	180,000	13.80	2,484,900.00	
GEA GROUP AG	24,200	34.18	827,156.00	
KION GROUP AG	13,100	87.88	1,151,228.00	
KNORR-BREMSE AG	12,700	109.15	1,386,205.00	
KONE OYJ	57,400	69.16	3,969,784.00	
RATIONAL AG	830	751.40	623,662.00	
WARTSILA OYJ	82,000	12.65	1,037,300.00	
BRENNTAG SE	26,800	78.90	2,114,520.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	169,800	57.25	9,721,050.00	
INPOST SA	34,000	14.65	498,100.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	56,000	10.23	573,104.00	
ADP	4,700	123.00	578,100.00	
AENA SME SA	13,300	143.00	1,901,900.00	
ATLANTIA SPA	89,000	16.07	1,430,675.00	
GETLINK	72,000	13.10	943,560.00	
CONTINENTAL AG	18,900	128.14	2,421,846.00	
FAURECIA	20,688	43.62	902,410.56	
MICHELIN (CGDE)	28,700	137.60	3,949,120.00	

VALEO SA	37,300	26.86	1,001,878.00	
BAYER MOTOREN WERK	55,900	93.13	5,205,967.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,200	77.20	787,440.00	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	146,400	79.36	11,618,304.00	
FERRARI NV	21,300	170.55	3,632,715.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	25,400	95.46	2,424,684.00	
RENAULT SA	33,700	35.91	1,210,167.00	
STELLANTIS NV	347,074	17.02	5,907,199.48	
VOLKSWAGEN AG	5,800	293.80	1,704,040.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	31,200	226.65	7,071,480.00	
SEB SA	4,180	154.50	645,810.00	
ADIDAS AG	32,800	289.70	9,502,160.00	
ESSILORLUXOTTICA	49,300	150.40	7,414,720.00	
HERMES INTERNATIONAL	5,330	1,225.50	6,531,915.00	
KERING SA	12,970	759.20	9,846,824.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	47,440	680.10	32,263,944.00	
MONCLER SPA	32,100	58.24	1,869,504.00	
PUMA SE	18,900	96.12	1,816,668.00	
ACCOR SA	32,000	33.52	1,072,640.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	28,200	159.20	4,489,440.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	15,400	49.55	763,070.00	
SODEXO	15,900	78.28	1,244,652.00	
DELIVERY HERO SE	27,300	107.40	2,932,020.00	
HELLOFRESH SE	29,000	81.56	2,365,240.00	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	30,600	75.30	2,304,180.00	
PROSUS NV	83,600	84.59	7,071,724.00	
ZALANDO SE	36,200	99.98	3,619,276.00	
INDITEX SA	184,000	30.60	5,630,400.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	107,000	17.06	1,825,955.00	
COLRUYT SA	8,700	46.92	408,204.00	
JERONIMO MARTINS	47,000	15.76	740,720.00	
KESKO OYJ-B SHS	44,000	30.64	1,348,160.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	182,000	24.79	4,512,690.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	130,600	63.77	8,328,362.00	
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	91,000	11.06	1,006,915.00	

HEINEKEN HOLDING NV	20,000	83.50	1,670,000.00
HEINEKEN NV	43,800	99.78	4,370,364.00
PERNOD RICARD SA	36,000	179.60	6,465,600.00
REMY COINTREAU	3,900	167.50	653,250.00
DANONE	110,700	57.26	6,338,682.00
JDE PEET'S BV	11,000	31.20	343,200.00
KERRY GROUP PLC-A	27,700	108.45	3,004,065.00
HENKEL AG & CO KGAA	18,000	78.00	1,404,000.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	31,000	89.24	2,766,440.00
BEIERSDORF AG	17,900	102.40	1,832,960.00
LOREAL-ORD	42,800	389.25	16,659,900.00
BIOMERIEUX	6,900	91.82	633,558.00
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	7,200	158.00	1,137,600.00
DIASORIN SPA	4,000	153.40	613,600.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	156,300	42.69	6,672,447.00
SARTORIUS AG-VORZUG	4,450	408.60	1,818,270.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	46,000	49.44	2,274,240.00
AMPLIFON SPA	20,300	40.38	819,714.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	36,600	69.42	2,540,772.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	72,700	44.20	3,213,340.00
ORPEA	9,300	105.00	976,500.00
ARGENX SE	7,600	267.50	2,033,000.00
GRIFOLS SA	54,000	23.11	1,247,940.00
BAYER AG-REG	169,300	52.19	8,835,767.00
IPSEN	5,500	88.30	485,650.00
MERCK KGAA	22,500	153.65	3,457,125.00
ORION OYJ	16,500	37.11	612,315.00
RECORDATI SPA	16,800	48.17	809,256.00
SANOFI	194,500	88.22	17,158,790.00
UCB SA	20,600	85.22	1,755,532.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	70,000	10.40	728,280.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,128,000	5.23	5,908,464.00
BANCO SANTANDER SA	2,990,000	3.28	9,807,200.00
BNP PARIBAS	192,400	53.86	10,362,664.00
CAIXABANK	760,000	2.61	1,987,400.00

COMMERZBANK AG	158,000	6.15	972,806.00
CREDIT AGRICOLE SA	202,000	11.83	2,390,064.00
ERSTE GROUP BANK AG	49,000	32.24	1,579,760.00
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	101,000	14.23	1,437,735.00
ING GROEP NV	658,000	11.10	7,305,116.00
INTESA SANPAOLO	2,850,000	2.36	6,744,525.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROEP NV	43,500	63.32	2,754,420.00
MEDIOBANCA S.P.A.	107,000	9.84	1,052,880.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	29,000	19.79	573,910.00
SOCIETE GENERALE	138,000	24.83	3,427,230.00
UNICREDIT SPA	361,000	10.20	3,685,088.00
EURAZEO SE	5,953	74.00	440,522.00
EXOR NV	19,500	67.66	1,319,370.00
GROUPE BRUXELLES LAM	19,500	93.88	1,830,660.00
SOFINA SA	2,900	362.40	1,050,960.00
WENDEL	4,300	114.70	493,210.00
AEGON NV	293,000	3.60	1,054,800.00
AGEAS	28,900	48.37	1,397,893.00
ALLIANZ SE-REG	70,000	217.20	15,204,000.00
ASSICURAZIONI GENERALI	188,000	16.93	3,183,780.00
AXA SA	334,000	21.82	7,289,550.00
CNP ASSURANCES	28,000	14.26	399,420.00
HANNOVER RUECK SE	9,600	144.85	1,390,560.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	23,700	238.80	5,659,560.00
NN GROUP NV	51,300	40.23	2,063,799.00
POSTE ITALIANE SPA	88,000	11.51	1,013,320.00
SAMPO OYJ-A SHS	86,400	38.94	3,364,416.00
SCOR SE	30,000	26.80	804,000.00
ADYEN NV	3,350	1,914.80	6,414,580.00
AMADEUS IT GROUP SA	76,000	62.98	4,786,480.00
ATOS SE	15,300	51.56	788,868.00
BECHTLE AG	4,400	149.55	658,020.00
CAPGEMINI SA	27,300	156.65	4,276,545.00
EDENRED	42,400	49.60	2,103,040.00

NEXI SPA	74,000	17.78	1,316,090.00	
WORLDLINE SA	41,300	80.36	3,318,868.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	22,300	198.25	4,420,975.00	
NEMETSCHEK SE	9,200	63.38	583,096.00	
SAP SE	177,400	118.06	20,943,844.00	
TEAMVIEWER AG	25,200	32.84	827,568.00	
NOKIA OYJ	961,000	4.33	4,164,013.00	
ASM INTERNATIONAL NV	7,800	260.10	2,028,780.00	
ASML HOLDING NV	71,690	568.70	40,770,103.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	225,000	32.63	7,342,875.00	
STMICROELECTRONICS NV	119,000	30.15	3,588,445.00	
CELLNEX TELECOM SA	86,518	53.02	4,587,184.36	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	571,000	17.81	10,170,652.00	
ELISA OYJ	25,700	50.98	1,310,186.00	
ILIAD SA	2,400	129.65	311,160.00	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	55,000	9.90	544,720.00	
KONINKLIJKE KPN NV	550,000	2.63	1,449,800.00	
ORANGE SA	346,000	9.90	3,426,784.00	
PROXIMUS	26,000	16.98	441,610.00	
TELECOM ITALIA SPA	1,590,000	0.43	693,081.00	
TELECOM ITALIA-RNC	1,180,000	0.47	555,780.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	150,000	2.26	339,450.00	
TELEFONICA SA	878,000	3.98	3,496,196.00	
TELEFONICA SA-RTS	878,000	0.19	174,809.80	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	35.20	591,360.00	
ELECTRICITE DE FRANCE	79,000	11.63	918,770.00	
ELIA GROUP SA/NV	4,800	91.00	436,800.00	
ENDESA S.A.	57,000	22.59	1,287,630.00	
ENEL SPA	1,382,000	8.12	11,221,840.00	
ENERGIAS DE PORTUGAL	476,000	4.58	2,182,460.00	
FORTUM OYJ	79,000	23.59	1,863,610.00	
IBERDROLA SA	980,000	10.84	10,628,100.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	70,000	17.05	1,193,850.00	
TERNA SPA	251,000	6.31	1,584,312.00	
VERBUND AG	11,000	75.35	828,850.00	

	ENAGAS SA	39,000	19.81	772,590.00	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	50,000	21.85	1,092,500.00	
	SNAM SPA	351,158	4.88	1,716,460.30	
	E.ON SE	380,000	9.98	3,793,540.00	
	ENGIE	308,000	11.80	3,634,400.00	
	RWE AG	108,500	30.27	3,284,295.00	
	SUEZ	62,000	20.00	1,240,000.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	94,000	25.12	2,361,280.00	
	AMUNDI SA	10,000	74.10	741,000.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	360,000	11.01	3,964,320.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG	32,000	147.90	4,732,800.00	
	NATIXIS	158,000	4.00	632,474.00	
	EDP RENOVAVEIS SA	49,000	18.89	925,610.00	
	UNIPER SE	15,100	30.78	464,778.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	23,700	92.80	2,199,360.00	
	QIAGEN N.V.	39,400	39.70	1,564,180.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,540	375.30	1,703,862.00	
	BUREAU VERITAS SA	47,000	26.88	1,263,360.00	
	RANDSTAD NV	21,400	63.94	1,368,316.00	
	TELEPERFORMANCE	10,200	328.40	3,349,680.00	
	WOLTERS KLUWER	46,700	83.28	3,889,176.00	
	AROUNDTOWN SA	173,000	6.91	1,196,468.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	59,800	51.64	3,088,072.00	
	LEG IMMOBILIEN SE	12,500	122.95	1,536,875.00	
	VONOVIA SE	92,800	53.90	5,001,920.00	
	PUBLICIS GROUPE	38,000	54.70	2,078,600.00	
	BOLLORE	138,000	4.54	627,624.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	14,400	57.98	834,912.00	
	VIVENDI SA	121,000	28.84	3,489,640.00	
	SCOUT24 AG	15,200	67.24	1,022,048.00	
小計	銘柄数：234			813,803,494.82	
				(106,852,398,869)	
	組入時価比率：10.5%			10.9%	
英ボンド	BP PLC	3,497,000	3.16	11,080,244.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	697,000	14.24	9,925,280.00	

ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	634,000	13.62	8,637,616.00	
CRODA INTERNATIONAL PLC	24,600	71.62	1,761,852.00	
JOHNSON MATTHEY PLC	34,800	30.64	1,066,272.00	
ANGLO AMERICAN PLC	222,000	27.75	6,160,500.00	
ANTOFAGASTA PLC	70,000	14.12	988,400.00	
BHP GROUP PLC	361,000	20.38	7,358,985.00	
EVRAZ PLC	76,000	6.23	473,632.00	
GLENCORE PLC	1,680,000	3.01	5,061,000.00	
RIO TINTO PLC-REG	190,600	57.92	11,039,552.00	
MONDI PLC	84,000	18.75	1,575,000.00	
BAE SYSTEMS PLC	547,000	5.39	2,948,330.00	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,380,000	1.09	1,507,788.00	
DCC PLC	16,000	58.88	942,080.00	
MELROSE INDUSTRIES PLC	850,000	1.58	1,346,400.00	
SMITHS GROUP PLC	71,000	15.95	1,132,450.00	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	13,100	133.90	1,754,090.00	
ASHTED GROUP PLC	78,000	51.22	3,995,160.00	
BUNZLE	55,000	23.79	1,308,450.00	
FERGUSON PLC	38,900	98.32	3,824,648.00	
RENTOKIL INTIAL PLC	318,000	4.89	1,555,656.00	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	181,000	7.09	1,284,738.00	
PERSIMMON PLC	52,600	30.38	1,597,988.00	
TAYLOR WIMPEY PLC	620,000	1.65	1,023,000.00	
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	22,600	46.02	1,040,052.00	
BURBERRY GROUP PLC	66,000	22.21	1,465,860.00	
COMPASS GROUP PLC	302,000	15.64	4,723,280.00	
ENTAIN PLC	102,000	18.35	1,871,700.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	32,500	50.64	1,645,800.00	
WHITBREAD PLC	36,300	32.24	1,170,312.00	
OCADO GROUP PLC	83,000	19.57	1,624,310.00	
NEXT PLC	21,900	77.82	1,704,258.00	
JD SPORTS FASHION PLC	93,000	8.83	821,376.00	
KINGFISHER PLC	349,000	3.53	1,234,064.00	
MORRISON SUPERMARKETS	370,000	2.40	888,740.00	
SAINSBURY	299,000	2.70	807,599.00	

TESCO PLC	1,302,631	2.25	2,938,735.53
COCA-COLA HBC AG-DI	34,000	26.65	906,100.00
DIAGEO PLC	397,300	34.87	13,853,851.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	62,000	22.70	1,407,400.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	370,000	28.11	10,402,550.00
IMPERIAL BRANDS PLC	161,000	15.91	2,562,315.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	121,900	64.50	7,862,550.00
UNILEVER PLC	450,900	43.04	19,408,990.50
SMITH & NEPHEW PLC	150,000	15.40	2,310,000.00
NMC HEALTH PLC	13,300	0.24	3,192.00
ASTRAZENECA PLC	225,100	84.08	18,926,408.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	864,000	14.15	12,225,600.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	29,600	23.81	704,776.00
BARCLAYS PLC	2,920,000	1.72	5,049,848.00
HSBC HOLDINGS PLC	3,460,000	4.26	14,758,630.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	11,960,000	0.46	5,620,602.00
NATWEST GROUP PLC	860,000	2.02	1,740,640.00
STANDARD CHARTERED PLC	443,000	4.71	2,089,188.00
M&G PLC	440,000	2.42	1,064,800.00
ADMIRAL GROUP PLC	30,800	31.92	983,136.00
AVIVA PLC	670,000	4.16	2,787,870.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	219,000	2.94	645,831.00
LEGAL & GENERAL	1,010,000	2.72	2,748,210.00
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	89,000	7.00	623,712.00
PRUDENTIAL PLC	450,000	14.56	6,554,250.00
AVEVA GROUP PLC	19,911	36.33	723,366.63
SAGE GROUP PLC (THE)	175,000	6.78	1,186,500.00
HALMA PLC	65,000	27.13	1,763,450.00
BT GROUP PLC	1,530,000	2.01	3,084,480.00
VODAFONE GROUP PLC	4,600,000	1.29	5,955,160.00
SSE PLC	177,000	15.16	2,684,205.00
NATIONAL GRID PLC	614,000	9.26	5,691,166.00
SEVERN TRENT PLC	43,000	25.19	1,083,170.00
UNITED UTILITIES GROUP PLC	122,000	10.27	1,253,550.00
3I GROUP PLC	167,000	12.07	2,016,525.00

	HARGREAVES LANSDOWN PLC	65,000	16.31	1,060,150.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	56,300	81.24	4,573,812.00	
	SCHRODERS PLC	19,700	35.49	699,153.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	95,000	14.84	1,410,275.00	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	366,000	2.74	1,005,768.00	
	EXPERIAN PLC	159,000	28.00	4,452,000.00	
	INTERTEK GROUP PLC	28,500	55.84	1,591,440.00	
	RELX PLC	334,000	19.33	6,456,220.00	
	INFORMA PLC	248,000	5.31	1,318,368.00	
	PEARSON	126,000	8.52	1,074,528.00	
	WPP PLC	200,000	9.82	1,965,600.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	171,000	6.28	1,073,880.00	
小計	銘柄数：84			298,648,414.16	
				(45,812,666,732)	
	組入時価比率：4.5%			4.7%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	32,000	19.04	609,280.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,440	903.00	1,300,320.00	
	GIVAUDAN-REG	1,598	4,320.00	6,903,360.00	
	SIKA AG-REG	24,500	296.40	7,261,800.00	
	HOLCIM LTD	88,400	55.74	4,927,416.00	
	GEBERIT AG-REG	6,280	683.60	4,293,008.00	
	ABB LTD	294,000	30.82	9,061,080.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,700	264.80	979,760.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,700	272.70	1,827,090.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	9,300	317.90	2,956,470.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	89,500	113.60	10,167,200.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,700	318.90	1,498,830.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	61.65	456,210.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	630	2,150.00	1,354,500.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	177	9,080.00	1,607,160.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	18	95,100.00	1,711,800.00	
	NESTLE SA-REG	492,400	116.20	57,216,880.00	
	ALCON INC	86,700	64.68	5,607,756.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	9,600	332.70	3,193,920.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,790	1,425.00	2,550,750.00	
		379,500	86.16	32,697,720.00	

	NOVARTIS AG-REG				
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	120,100	349.15	41,932,915.00	
	ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	5,300	374.00	1,982,200.00	
	VIFOR PHARMA AG	7,600	136.45	1,037,020.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	5,400	82.70	446,580.00	
	BALOISE HOLDING AG	7,400	147.60	1,092,240.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	5,220	462.70	2,415,294.00	
	SWISS RE LTD	52,500	85.14	4,469,850.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	25,800	374.80	9,669,840.00	
	TEMENOS AG-REG	12,000	150.80	1,809,600.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	29,400	116.20	3,416,280.00	
	SWISSCOM AG-REG	4,450	532.80	2,370,960.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	412,000	9.40	3,874,448.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	39,400	60.54	2,385,276.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,850	1,374.50	5,291,825.00	
	UBS GROUP AG	628,000	14.27	8,961,560.00	
	LONZA AG-REG	12,570	644.20	8,097,594.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	24,900	62.44	1,554,756.00	
	SGS SA-REG	1,060	2,857.00	3,028,420.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	13,500	93.05	1,256,175.00	
小計	銘柄数：40			263,275,143.00	
				(31,585,118,905)	
	組入時価比率：3.1%			3.2%	
スウェーデン ローナ	LUNDIN ENERGY AB	37,000	304.00	11,248,000.00	
	BOLIDEN AB	44,000	313.60	13,798,400.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B	100,000	138.20	13,820,000.00	
	ASSA ABLOY AB-B	170,000	263.90	44,863,000.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	242,000	89.64	21,692,880.00	
	SKANSKA AB-B SHS	60,000	232.00	13,920,000.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	26,000	276.70	7,194,200.00	
	ALFA LAVAL AB	51,000	296.00	15,096,000.00	
	ATLAS COPCO AB-A	116,300	529.60	61,592,480.00	
	ATLAS COPCO AB-B	66,800	451.80	30,180,240.00	
	EPIROC AB - A	113,000	184.00	20,792,000.00	
	EPIROC AB - B	69,000	161.20	11,122,800.00	

	SANDVIK AB	195,000	217.60	42,432,000.00	
	SKF AB-B SHARES	68,000	216.00	14,688,000.00	
	VOLVO AB-A SHS	34,000	228.20	7,758,800.00	
	VOLVO AB-B SHS	241,000	221.10	53,285,100.00	
	SECURITAS AB-B SHS	54,000	127.95	6,909,300.00	
	ELECTROLUX AB-B	41,000	238.90	9,794,900.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	73,000	115.10	8,402,300.00	
	EVOLUTION AB	29,300	1,460.60	42,795,580.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	124,000	199.96	24,795,040.00	
	ICA GRUPPEN AB	17,100	397.80	6,802,380.00	
	SWEDISH MATCH AB	285,000	76.58	21,825,300.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	103,000	285.80	29,437,400.00	
	NORDEA BANK ABP	548,000	95.11	52,120,280.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	283,000	109.85	31,087,550.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	267,000	96.50	25,765,500.00	
	SWEDBANK AB	160,000	154.58	24,732,800.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	20,000	334.60	6,692,000.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	314.80	7,870,000.00	
	INVESTOR AB-B SHS	306,800	196.50	60,286,200.00	
	KINNEVIK AB - B	39,000	321.10	12,522,900.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	12,600	551.20	6,945,120.00	
	SINCH AB	83,000	142.00	11,786,000.00	
	ERICSSON LM-B	491,000	108.42	53,234,220.00	
	HEXAGON AB-B SHS	335,300	125.30	42,013,090.00	
	TELIA CO AB	480,000	36.96	17,740,800.00	
	TELE 2 AB-B SHS	78,000	115.85	9,036,300.00	
	EQT AB	42,000	309.10	12,982,200.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	18,700	554.40	10,367,280.00	
	EMBRACER GROUP AB	44,000	223.70	9,842,800.00	
小計	銘柄数：41			929,271,140.00	
				(11,996,890,417)	
	組入時価比率：1.2%			1.2%	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	170,000	178.00	30,260,000.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,600	465.30	13,772,880.00	
	NORSK HYDRO	218,000	50.96	11,109,280.00	

	MOWI ASA	78,000	234.60	18,298,800.00	
	ORKLA ASA	133,000	87.00	11,571,000.00	
	DNB ASA	155,000	189.00	29,295,000.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,000	192.00	5,952,000.00	
	TELENOR ASA	116,000	144.65	16,779,400.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	18,100	346.80	6,277,080.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	14,400	399.40	5,751,360.00	
	ADEVINTA ASA	45,000	165.25	7,436,250.00	
小計	銘柄数：11			156,503,050.00	
				(2,009,499,162)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	18,200	569.40	10,363,080.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	33,700	466.40	15,717,680.00	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S-B SHS	1,660	3,031.00	5,031,460.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	174,000	231.60	40,298,400.00	
	DSV PANALPINA A S	34,900	1,459.00	50,919,100.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	560	17,550.00	9,828,000.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,040	18,145.00	18,870,800.00	
	PANDORA A/S	17,700	817.60	14,471,520.00	
	CARLSBERG B	18,000	1,155.50	20,799,000.00	
	AMBU A/S-B	29,000	231.40	6,710,600.00	
	COLOPLAST-B	19,400	998.20	19,365,080.00	
	DEMANT A/S	20,100	342.40	6,882,240.00	
	GN STORE NORD A/S	21,200	536.00	11,363,200.00	
	GENMAB A/S	11,060	2,692.00	29,773,520.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	295,400	516.30	152,515,020.00	
	DANSKE BANK AS	122,000	112.15	13,682,300.00	
	TRYG A/S	60,666	155.00	9,403,230.00	
	ORSTED A/S	31,800	873.80	27,786,840.00	
小計	銘柄数：18			463,781,070.00	
				(8,190,373,696)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
豪ドル	AMPOL LTD	40,000	28.93	1,157,200.00	
	OIL SEARCH LTD	350,000	3.90	1,365,000.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	330,000	4.73	1,560,900.00	

SANTOS LTD.	310,000	7.25	2,247,500.00	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	30.25	514,250.00	
WOODSIDE PETROLEUM	163,000	22.77	3,711,510.00	
ORICA LTD	59,000	13.33	786,470.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	73,000	45.55	3,325,150.00	
BHP GROUP LIMITED	506,000	45.61	23,078,660.00	
BLUESCOPE STEEL LTD	90,000	20.99	1,889,100.00	
EVOLUTION MINING LTD	272,000	4.68	1,272,960.00	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	288,000	21.81	6,281,280.00	
NEWCREST MINING	143,000	26.05	3,725,150.00	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	194,000	10.00	1,940,000.00	
RIO TINTO LTD	62,900	120.05	7,551,145.00	
SOUTH32 LTD	780,000	2.80	2,184,000.00	
REECE LTD	49,000	22.68	1,111,320.00	
BRAMBLES LTD	247,000	11.24	2,776,280.00	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	170,000	4.67	793,900.00	
AURIZON HOLDINGS LTD	305,000	3.70	1,128,500.00	
SYDNEY AIRPORT	244,000	5.90	1,439,600.00	
TRANSURBAN GROUP	462,000	14.71	6,796,020.00	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	99,000	42.17	4,174,830.00	
CROWN RESORTS LTD	55,000	12.13	667,150.00	
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	10,300	119.74	1,233,322.00	
TABCORP HOLDINGS	370,909	5.16	1,913,890.44	
WESFARMERS LIMITED	196,000	57.54	11,277,840.00	
COLES GROUP LTD	227,000	16.47	3,738,690.00	
WOOLWORTHS GROUP LTD	219,000	43.02	9,421,380.00	
TREASURY WINE ESTATES LTD	111,000	11.99	1,330,890.00	
COCHLEAR LTD	11,500	245.33	2,821,295.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	29,500	64.81	1,911,895.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	78,000	37.54	2,928,120.00	
CSL LIMITED	77,300	305.00	23,576,500.00	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	487,000	28.08	13,674,960.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	304,400	98.06	29,849,464.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	563,000	26.42	14,874,460.00	
WESTPAC BANKING CORP	632,000	26.15	16,526,800.00	

		INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	430,000	5.07	2,180,100.00	
		MEDIBANK PRIVATE LTD	450,000	3.08	1,386,000.00	
		QBE INSURANCE	244,000	10.91	2,662,040.00	
		SUNCORP GROUP LTD	222,000	11.04	2,450,880.00	
		AFTERPAY LTD	37,500	117.21	4,395,375.00	
		COMPUTERSHARE LTD	84,636	16.88	1,428,655.68	
		WISETECH GLOBAL LTD	21,000	32.05	673,050.00	
		XERO LIMITED	23,300	140.96	3,284,368.00	
		TELSTRA CORP LTD	730,000	3.53	2,576,900.00	
		AUSNET SERVICES	330,000	1.78	589,050.00	
		APA GROUP	205,000	9.30	1,906,500.00	
		AGL ENERGY LTD	105,000	9.14	959,700.00	
		ASX LTD	34,500	75.20	2,594,400.00	
		MACQUARIE GROUP LIMITED	59,100	150.90	8,918,190.00	
		MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	26,000	50.79	1,320,540.00	
		REA GROUP LTD	8,800	164.48	1,447,424.00	
		SEEK LTD	60,000	32.78	1,966,800.00	
		小計 銘柄数：55			257,297,354.12	
					(21,342,815,524)	
		組入時価比率：2.1%			2.2%	
ニュージーランドドル		AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	223,000	7.44	1,659,120.00	
		A2 MILK CO LTD	117,000	6.50	760,500.00	
		FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	100,000	30.99	3,099,000.00	
		RYMAN HEALTHCARE LTD	74,000	13.00	962,000.00	
		SPARK NEW ZEALAND LTD	307,000	4.73	1,453,645.00	
		MERCURY NZ LTD	100,000	6.40	640,000.00	
		MERIDIAN ENERGY LTD	201,000	5.19	1,043,190.00	
		小計 銘柄数：7			9,617,455.00	
					(740,063,162)	
		組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル		XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	330,000	31.40	10,362,000.00	
		CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	460,040	58.90	27,096,356.00	
		TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	233,000	132.00	30,756,000.00	
		MTR CORP	272,000	42.45	11,546,400.00	

		GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	379,000	63.25	23,971,750.00	
		SANDS CHINA LTD	432,000	34.75	15,012,000.00	
		SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	8.85	2,389,500.00	
		WYNN MACAU LTD	228,000	13.14	2,995,920.00	
		CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	320,000	16.50	5,280,000.00	
		BUDWEISER BREWING CO APAC LT	290,000	24.35	7,061,500.00	
		WH GROUP LIMITED	1,610,000	7.01	11,286,100.00	
		BANK OF EAST ASIA	220,060	15.18	3,340,510.80	
		BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	610,000	26.35	16,073,500.00	
		HANG SENG BANK	131,000	151.20	19,807,200.00	
		AIA GROUP LTD	2,075,000	93.70	194,427,500.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	599,600	10.48	6,283,808.00	
		CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	107,000	47.20	5,050,400.00	
		CLP HLDGS	281,000	77.15	21,679,150.00	
		POWER ASSETS HOLDINGS LTD	225,000	48.10	10,822,500.00	
		HONG KONG & CHINA GAS	1,953,383	11.74	22,932,716.42	
		HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	206,100	460.00	94,806,000.00	
		CK ASSET HOLDINGS LTD	355,040	52.40	18,604,096.00	
		ESR CAYMAN LTD	330,000	25.35	8,365,500.00	
		HANG LUNG PROPERTIES LTD	360,000	19.24	6,926,400.00	
		HENDERSON LAND	267,443	37.60	10,055,856.80	
		NEW WORLD DEVELOPMENT	268,916	40.55	10,904,543.80	
		SINO LAND CO.LTD	620,000	12.34	7,650,800.00	
		SUN HUNG KAI PROPERTIES	222,000	119.00	26,418,000.00	
		SWIRE PACIFIC-A	75,000	55.90	4,192,500.00	
		SWIRE PROPERTIES LTD	230,000	23.80	5,474,000.00	
		WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	279,000	45.10	12,582,900.00	
	小計	銘柄数：31			654,155,407.82	
					(9,289,006,791)	
		組入時価比率：0.9%			0.9%	
シンガポール ル		SINGAPORE TECH ENGINEERING	249,000	3.89	968,610.00	
		KEPPEL CORP.	232,000	5.06	1,173,920.00	
		SINGAPORE AIRLINES LTD	240,000	4.98	1,195,200.00	

		GENTING SINGAPORE LTD	1,130,000	0.87	983,100.00	
		WILMAR INTERNATIONAL LTD	340,000	4.55	1,547,000.00	
		DBS GROUP HLDGS	302,000	29.63	8,948,260.00	
		OCBC-ORD	580,000	11.89	6,896,200.00	
		UNITED OVERSEAS BANK	201,000	25.63	5,151,630.00	
		VENTURE CORP LTD	45,000	18.73	842,850.00	
		SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,400,000	2.29	3,206,000.00	
		SINGAPORE EXCHANGE LTD	129,000	11.01	1,420,290.00	
		CAPITALAND LIMITED	430,000	3.68	1,582,400.00	
		CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	7.35	514,500.00	
		UOL GROUP LIMITED	87,000	7.30	635,100.00	
	小計	銘柄数：14			35,065,060.00	
					(2,874,984,269)	
		組入時価比率：0.3%			0.3%	
	新シェケル	ICL GROUP LTD	125,000	22.72	2,840,000.00	
		ELBIT SYSTEMS LTD	5,000	433.00	2,165,000.00	
		BANK HAPOLIM BM	183,000	26.61	4,869,630.00	
		BANK LEUMI LE-ISRAEL	238,000	25.55	6,080,900.00	
		ISRAEL DISCOUNT BANK-A	213,000	15.82	3,369,660.00	
		MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	23,000	101.50	2,334,500.00	
		NICE LTD	10,600	723.70	7,671,220.00	
		AZRIELI GROUP	6,500	232.00	1,508,000.00	
	小計	銘柄数：8			30,838,910.00	
					(1,041,374,480)	
		組入時価比率：0.1%			0.1%	
	合計				982,017,272,041	
					(982,017,272,041)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(2021年6月22日現在)

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

投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	93,000	1,587,510.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	22,400	4,176,704.00	
		AMERICAN TOWER CORP	75,500	20,214,370.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	238,000	2,184,840.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,200	5,132,820.00	
		BOSTON PROPERTIES	25,000	2,990,750.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,000	2,167,040.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	73,300	14,487,745.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	47,400	7,379,232.00	
		DUKE REALTY CORP	62,200	3,032,250.00	
		EQUINIX INC	15,260	12,551,350.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	29,400	2,256,450.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	60,100	4,769,536.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,400	3,513,138.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	22,600	3,698,716.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	94,000	3,180,960.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	123,000	2,168,490.00	
		INVITATION HOMES INC	99,000	3,715,470.00	
		IRON MOUNTAIN INC	49,000	2,222,640.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	99,000	2,006,730.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,300	3,299,914.00	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,500	1,339,550.00	
		PROLOGIS INC	125,600	15,397,304.00	
		PUBLIC STORAGE	26,500	8,044,075.00	
		REALTY INCOME CORP	63,400	4,315,004.00	
		REGENCY CENTERS CORP	25,900	1,695,155.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	19,200	6,165,504.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	56,400	7,416,600.00	
		SUN COMMUNITIES INC	17,800	3,136,182.00	
		UDR INC	51,100	2,532,005.00	
		VENTAS INC	63,900	3,681,918.00	
		VEREIT INC	37,000	1,744,550.00	
		VICI PROPERTIES INC	94,000	3,010,820.00	
		VORNADO REALTY TRUST	27,000	1,299,510.00	
		WELLTOWER INC	72,100	5,809,818.00	

小計	WEYERHAEUSER CO	127,000	4,351,020.00	
	WP CAREY INC	30,500	2,345,145.00	
	銘柄数：37	2,172,960	179,020,815.00	
	組入時価比率：1.9%		(19,742,415,478)	84.5%
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	882,825.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	486,420.00	
	銘柄数：2	36,900	1,369,245.00	
	組入時価比率：0.0%		(121,931,267)	0.5%
ユーロ	COVIVIO	8,500	644,300.00	
	GECINA SA	8,100	1,076,895.00	
	KLEPIERRE	32,300	734,502.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21,200	1,666,956.00	
	銘柄数：4	70,100	4,122,653.00	
	組入時価比率：0.1%		(541,304,338)	2.3%
英ポンド	BRITISH LAND	159,000	784,665.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	111,000	752,136.00	
	SEGRO PLC	209,000	2,284,370.00	
	銘柄数：3	479,000	3,821,171.00	
	組入時価比率：0.1%		(586,167,631)	2.5%
豪ドル	DEXUS	196,000	2,108,960.00	
	GOODMAN GROUP	283,000	5,920,360.00	
	GPT GROUP	330,000	1,590,600.00	
	LENDLEASE GROUP	111,000	1,348,650.00	
	MIRVAC GROUP	660,000	1,927,200.00	
	SCENTRE GROUP	920,000	2,594,400.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	400,000	1,864,000.00	
	VICINITY CENTRES	670,000	1,095,450.00	
	銘柄数：8	3,570,000	18,449,620.00	
	組入時価比率：0.1%		(1,530,395,979)	6.5%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	3,708,300.00	
	LINK REIT	353,000	27,463,400.00	

	小計	銘柄数：2	823,000	31,171,700.00	
				(442,638,140)	
		組入時価比率：0.0%		1.9%	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	539,240	1,579,973.20	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	829,979	1,742,955.90	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	791,800.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	549,980	1,110,959.60	
	小計	銘柄数：4	2,289,199	5,225,688.70	
				(428,454,216)	
		組入時価比率：0.0%		1.8%	
合計				23,393,307,049	
				(23,393,307,049)	

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2021年 6月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	15,054,295,672	-	14,979,887,899	74,407,773
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	2,083,965,757	-	2,090,299,675	6,333,918
米ドル	1,726,746,348	-	1,731,363,360	4,617,012
カナダドル	83,851,275	-	84,595,790	744,515
ユーロ	52,233,800	-	52,521,160	287,360
スイスフラン	29,815,275	-	29,993,375	178,100
デンマーククローネ	24,584,420	-	24,724,000	139,580
豪ドル	95,153,299	-	95,391,990	238,691
香港ドル	71,581,340	-	71,710,000	128,660
合計	-	-	-	68,073,855

（注）時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2021年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,865,140,599
コール・ローン	295,101,183
株式	63,937,419,593
投資信託受益証券	2,757,089,051
投資証券	60,305,758
派生商品評価勘定	2,088,884
未収入金	2,860,653
未収配当金	159,027,599
差入委託証拠金	883,684,941
流動資産合計	69,962,718,261
資産合計	69,962,718,261
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	40,854,439
未払解約金	11,527,026
未払利息	258
その他未払費用	1,656,900
流動負債合計	54,038,623
負債合計	54,038,623
純資産の部	
元本等	
元本	41,493,863,678
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	28,414,815,960

(2021年 6月22日現在)

元本等合計	69,908,679,638
純資産合計	69,908,679,638
負債純資産合計	69,962,718,261

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2021年 6月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.6848円
(10,000口当たり純資産額)	(16,848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 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

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

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 6月22日現在	
期首	2020年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	33,700,514,136円
同期中における追加設定元本額	11,498,332,245円
同期中における一部解約元本額	3,704,982,703円
期末元本額	41,493,863,678円
期末元本額の内訳＊	
野村資産設計ファンド2015	19,958,520円
野村資産設計ファンド2020	19,985,255円
野村資産設計ファンド2025	37,447,593円
野村資産設計ファンド2030	51,008,577円
野村資産設計ファンド2035	42,964,352円
野村資産設計ファンド2040	81,604,124円
野村資産設計ファンド2045	14,419,380円
野村インデックスファンド・新興国株式	3,430,076,376円
ネクストコア	22,876,377円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	313,537,376円
野村資産設計ファンド2050	19,899,432円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	6,676,536円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	3,358,681円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	2,598,564円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	2,115,029円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,040,817円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,330,899円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	7,187,004円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,882,680円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	14,068,571円
野村つみたて外国株投信	2,975,266,002円
野村外国株（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	994,193,949円
野村外国株（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	1,763,883,503円
世界6資産分散ファンド	93,925,581円
野村資産設計ファンド2060	9,775,899円

NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIEマージング・マーケット・インデックス（為替ヘッジなし）連動型上場投信	680,020,703円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	1,264,219,851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）	6,913,551円
ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・新興国株式（適格機関投資家専用）	348,319,867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）	726,082円
野村新興国株式インデックスファンド（確定拠出年金向け）	28,721,857,533円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	471,983,560円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	37,670,048円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	9,918,908円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	8,645,833円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	7,144,519円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	4,344,041円
多資産分散投資ファンド（バランス１０）（確定拠出年金向け）	18,105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(2021年6月22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	20,300	13.13	266,539.00	
		LUKOIL PJSC-SPON ADR	30,250	91.14	2,756,985.00	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	6,430	212.60	1,367,018.00	
		PJSC GAZPROM-ADR	434,000	7.35	3,190,768.00	
		ROSNEFT OJSC - GDR	83,900	7.29	612,302.20	
		SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	105,600	5.07	535,392.00	
		TATNEFT-SPONSORED ADR	16,500	43.59	719,235.00	
		YPF S.A. -SPONSORED ADR	10,600	5.04	53,424.00	
		PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	12,100	21.16	256,036.00	
		QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	9,779	43.57	426,071.03	
		CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	9,600	9.35	89,760.00	
		NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	10,300	35.26	363,178.00	
		PJSC ALROSA	176,000	1.86	327,374.08	
		PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	45,000	34.43	1,549,350.00	
		POLYUS PJSC-REG S-GDR	4,710	99.85	470,293.50	

SEVERSTAL-GDR REG S	15,800	21.80	344,440.00	
SOUTHERN COPPER CORP	6,300	61.66	388,458.00	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	31,700	29.49	934,833.00	
LI AUTO INC - ADR	33,000	30.11	993,630.00	
NIO INC ADR	93,000	46.51	4,325,430.00	
XPENG INC ADR	22,700	43.63	990,401.00	
HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR	12,500	55.53	694,125.00	
YUM CHINA HOLDINGS INC	30,300	66.64	2,019,192.00	
BAOZUN INC-SPN ADR	4,900	34.51	169,099.00	
DADA NEXUS LTD-ADR	4,100	29.02	118,982.00	
JD.COM INC-ADR	62,210	72.62	4,517,690.20	
OZON HOLDINGS PLC - ADR	2,900	57.92	167,968.00	
PINDUODUO INC ADR	31,560	120.78	3,811,816.80	
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	36,400	36.86	1,341,704.00	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	32,200	17.65	568,330.00	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	25,900	15.37	398,083.00	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	8,500	32.92	279,820.00	
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	4,000	18.42	73,680.00	
ADECOAGRO SA	9,000	11.06	99,540.00	
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	8,000	8.51	68,080.00	
BEIGENE, LTD ADR	3,250	325.64	1,058,330.00	
BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	3,000	27.79	83,370.00	
I-MAB-SPONSORED ADR	2,300	77.24	177,652.00	
ZAI LAB LTD - ADR	5,420	158.88	861,129.60	
HUTCHMED CHINA-ADR	5,200	26.24	136,448.00	
BANCO DE CHILE-ADR	18,100	19.83	358,923.00	
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	13,800	20.69	285,522.00	
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	7,330	29.37	215,282.10	
CREDICORP LTD	4,970	116.58	579,402.60	
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	777,000	4.22	3,282,141.24	
STATE BANK OF INDIA-GDR	13,800	56.60	781,080.00	
TCS GROUP HOLDING-REG S	9,300	78.12	726,516.00	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	87,890	1.31	115,135.90	
21VIANET GROUP INC-ADR	7,200	23.26	167,472.00	
CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	6,000	14.87	89,220.00	

GDS HOLDINGS LTD-ADR	6,500	77.41	503,165.00	
GLOBANT SA	2,850	222.42	633,897.00	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	4,000	33.40	133,600.00	
AGORA INC-ADR	3,400	38.06	129,404.00	
ONECONNECT FINANCIAL TECHNOLOGY	8,100	11.39	92,259.00	
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4,100	58.70	240,670.00	
MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR	28,650	9.39	269,023.50	
ENEL AMERICAS S.A-ADR	29,900	6.83	204,217.00	
ENEL CHILE SA-ADR	42,900	2.92	125,268.00	
INTER RAO UES PJSC	2,280,000	0.06	150,457.20	
360 DIGITECH INC-ADR	6,000	40.43	242,580.00	
LUFAX HOLDING LTD	11,300	12.23	138,199.00	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	85,170	2.43	207,136.84	
NOAH HLDS LTD ADR	3,000	47.47	142,410.00	
UP FINTECH HOLDINGS LTD ADR	5,500	23.01	126,555.00	
GAOTU TECHEDU INC-ADR	8,600	13.72	117,992.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	109,400	8.10	886,140.00	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	29,730	23.25	691,222.50	
51JOB INC-ADR	2,210	76.39	168,821.90	
KE HOLDINGS INC ADR	25,590	48.65	1,244,953.50	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	87,648	0.95	83,528.54	
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	12,020	113.58	1,365,231.60	
DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	6,000	7.87	47,220.00	
HUYA INC-ADR	5,900	16.46	97,114.00	
IQIYI INC-ADR	21,400	14.43	308,802.00	
NETEASE INC-ADR	28,930	107.94	3,122,704.20	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	46,700	15.11	705,637.00	
AUTOHOME INC-ADR	4,810	63.07	303,366.70	
BAIDU INC - SPON ADR	19,400	185.56	3,599,864.00	
JOYY INC	4,250	65.60	278,800.00	
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	7,000	22.02	154,140.00	
MOMO INC-SPON ADR	11,500	14.67	168,705.00	
WEIBO CORP-SPON ADR	4,500	49.23	221,535.00	
YANDEX NV-A	22,740	68.47	1,557,007.80	
小計 銘柄数：84			62,668,279.53	

				(6,911,057,866)	
	組入時価比率：9.9%			10.8%	
メキシコペソ	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	93,958	51.91	4,877,359.78	
	CEMEX SAB - CPO	1,079,985	15.93	17,204,161.05	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	223,983	87.95	19,699,304.85	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	279.96	2,354,463.60	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	64.97	2,267,453.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	14,300	379.91	5,432,713.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	30,400	225.00	6,840,000.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,400	163.00	2,673,200.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	378,000	63.31	23,931,180.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	32,000	114.34	3,658,880.00	
	BECLE SAB DE CV	47,000	51.68	2,428,960.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	38,000	105.71	4,016,980.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	140,000	171.53	24,014,200.00	
	GRUMA S.A.B.-B	15,600	225.91	3,524,196.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	114,000	43.81	4,994,340.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	110,000	36.09	3,969,900.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	183,900	129.51	23,816,889.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	140,200	20.36	2,854,472.00	
	TELESITES SAB DE CV	111,000	19.04	2,113,440.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,474,000	15.77	39,014,980.00	
	GRUPO TELEvisa SAB - SER CPO	168,000	58.50	9,828,000.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	23,100	72.51	1,674,981.00	
小計	銘柄数：22			211,190,053.28	
				(1,134,660,799)	
	組入時価比率：1.6%			1.8%	
リアル	COSAN SA	86,800	25.02	2,171,736.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	278,000	29.34	8,156,520.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	354,000	28.95	10,248,300.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	48,000	19.72	946,560.00	
	BRASKEM SA-PREF A	13,200	55.11	727,452.00	
	KLABIN SA-UNIT	61,000	26.15	1,595,150.00	
	BRADSPAR SA -PREF	15,000	68.15	1,022,250.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	42.04	1,942,248.00	
	GERDAU SA PFD NPV	74,500	29.87	2,225,315.00	

VALE SA	287,821	110.11	31,691,970.31	
SUZANO SA	52,960	58.50	3,098,160.00	
WEG SA	117,448	35.25	4,140,042.00	
LOCALIZA RENT A CAR	45,660	63.22	2,886,625.20	
RUMO SA	96,000	20.06	1,925,760.00	
CCR SA	75,600	13.98	1,056,888.00	
ALPARGATAS SA-PREF	12,000	49.62	595,440.00	
B2W CIA DIGITAL	13,500	70.49	951,615.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	72,995	22.10	1,613,189.50	
LOJAS RENNER S.A.	62,795	46.28	2,906,152.60	
MAGAZINE LUIZA SA	203,000	21.27	4,317,810.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	43,600	27.58	1,202,488.00	
VIA VAREJO SA	92,000	15.75	1,449,000.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	29,600	21.65	640,840.00	
RAIA DROGASIL SA	78,200	25.75	2,013,650.00	
AMBEV SA	355,956	18.73	6,667,055.88	
BRF SA	39,700	28.83	1,144,551.00	
JBS SA	74,600	28.17	2,101,482.00	
NATURA &CO HOLDING SA	62,500	57.31	3,581,875.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	69,500	15.42	1,071,690.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	37,300	84.67	3,158,191.00	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	16,600	66.90	1,110,540.00	
HYPERA SA	23,900	36.52	872,828.00	
BANCO BRADESCO S.A.	111,049	23.38	2,596,325.62	
BANCO BRADESCO SA - PREF	347,639	27.67	9,619,171.13	
BANCO DO BRASIL SA	53,600	34.58	1,853,488.00	
BANCO INTER SA-UNITS	27,300	69.16	1,888,068.00	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	43.66	1,065,304.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	358,991	32.45	11,649,257.95	
ITAUSA SA	336,017	11.74	3,944,839.58	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	44,100	25.47	1,123,227.00	
TOTVS SA	40,000	36.76	1,470,400.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	41,605	45.14	1,878,049.70	
TIM SA	46,552	12.67	589,813.84	
	18,000	47.42	853,560.00	

	CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B				
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	30,000	47.57	1,427,100.00	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	69,683	13.07	910,756.81	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	86,000	6.27	539,220.00	
	CPFL ENERGIA SA	19,300	28.79	555,647.00	
	ENERGISA SA-UNITS	10,200	47.75	487,050.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	70,000	25.33	1,773,100.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	21,300	38.18	813,234.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	430,899	17.07	7,355,445.93	
	BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT	22,500	122.98	2,767,050.00	
	ENGIE BRASIL SA	12,000	41.00	492,000.00	
小計	銘柄数：54			164,885,483.05	
				(3,625,403,070)	
	組入時価比率：5.2%			5.7%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	25,900	7,360.00	190,624,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	71,951	1,755.10	126,281,200.10	
	S.A.C.I. FALABELLA	50,200	3,249.00	163,099,800.00	
	CENCOSUD SA	126,000	1,474.00	185,724,000.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	3,241	32,301.00	104,687,541.00	
	COLBUN SA	471,000	109.90	51,762,900.00	
	CENCOSUD SHOPPING SA	23,000	1,305.00	30,015,000.00	
小計	銘柄数：7			852,194,441.10	
				(125,716,576)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	15,900	27,490.00	437,091,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	13,000	20,000.00	260,000,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,800	22,400.00	757,120,000.00	
小計	銘柄数：3			1,454,211,000.00	
				(42,662,188)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ユーロ	FF GROUP	2,030	0.00	0.00	
	OPAP SA	13,190	12.98	171,206.20	
	JUMBO SA	6,732	14.41	97,008.12	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS	180,800	0.84	153,643.84	
	HELLENIC TELECOM	18,000	15.06	271,170.00	

小計	銘柄数：5			693,028.16	
	組入時価比率：0.1%			(90,994,597)	0.1%
英bond	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	27,800	15.90	442,159.00	
	小計 銘柄数：1			442,159.00	
	組入時価比率：0.1%			(67,827,190)	0.1%
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,300	99.60	826,680.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,000	18.19	2,110,040.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	41,460	15.24	631,850.40	
	KOC HLDGS	53,000	18.59	985,270.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	88,000	7.95	699,600.00	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	6,200	171.60	1,063,920.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	30,000	64.55	1,936,500.00	
	AKBANK T.A.S	205,000	5.30	1,086,500.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	142,160	8.19	1,164,290.40	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	91,800	5.18	475,524.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	77,000	16.70	1,285,900.00	
	小計 銘柄数：11			12,266,074.80	
	組入時価比率：0.2%			(153,850,923)	0.2%
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	774.50	3,911,225.00	
	MONETA MONEY BANK AS	42,000	79.80	3,351,600.00	
	CEZ AS	9,500	630.50	5,989,750.00	
小計	銘柄数：3			13,252,575.00	
	組入時価比率：0.1%			(68,207,027)	0.1%
フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	25,000	2,340.00	58,500,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	9,200	8,300.00	76,360,000.00	
	OTP BANK NYRT	16,200	16,500.00	267,300,000.00	
小計	銘柄数：3			402,160,000.00	
	組入時価比率：0.2%			(149,408,070)	0.2%
ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	18,800	79.08	1,486,704.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	97,770	6.59	644,890.92	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	9,900	183.40	1,815,660.00	

	LPP SA	94	11,470.00	1,078,180.00	
	ALLEGRO.EU SA	29,400	59.40	1,746,360.00	
	DINO POLSKA SA	3,820	270.20	1,032,164.00	
	BANK PEKAO SA	15,700	98.50	1,546,450.00	
	PKO BANK POLSKI SA	63,000	40.48	2,550,240.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,100	261.50	810,650.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	37,500	38.62	1,448,250.00	
	ORANGE POLSKA SA	39,150	6.63	259,564.50	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	51,730	10.06	520,662.45	
	CYFROWY POLSAT SA	18,900	29.80	563,220.00	
	CD PROJEKT RED SA	4,960	183.38	909,564.80	
小計	銘柄数：14			16,412,560.67	
				(475,773,873)	
	組入時価比率：0.7%			0.7%	
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY	367,000	0.05	19,451.00	
	LEGEND HLDS CORP-RTS	18,100	0.00	0.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	130,000	6.63	861,900.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,740,900	3.95	6,876,555.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	245,000	16.88	4,135,600.00	
	PERENNIAL ENERGY HOLDINGS LTD	55,000	2.03	111,650.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,520,000	3.42	5,198,400.00	
	YANZHOU COAL MINING-H	96,000	11.24	1,079,040.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	91,000	40.30	3,667,300.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	309,000	9.05	2,796,450.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	176,000	7.46	1,312,960.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	280,000	3.98	1,114,400.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	160,000	9.91	1,585,600.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	240,000	4.25	1,020,000.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD	11,800	106.70	1,259,060.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	14.96	1,466,080.00	
	MMG LTD	168,000	3.37	566,160.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LTD	36,000	14.08	506,880.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H	57,000	7.48	426,360.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO-H	431,000	9.89	4,262,590.00	

LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	78,000	6.01	468,780.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	118,000	10.38	1,224,840.00	
AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	202,000	5.52	1,115,040.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	92,000	18.76	1,725,920.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	3.43	598,192.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	113,500	32.80	3,722,800.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	290,000	3.99	1,157,100.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	153,250	5.40	827,550.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	55,984	12.64	707,637.76	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	36,300	44.95	1,631,685.00	
CITIC LTD	473,000	8.17	3,864,410.00	
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	165,940	11.20	1,858,528.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	57,000	25.75	1,467,750.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	77,000	8.51	655,270.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	50,000	15.76	788,000.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	149,800	15.92	2,384,816.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H	116,000	7.98	925,680.00	
BOC AVIATION LTD	15,000	65.70	985,500.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	33,000	33.60	1,108,800.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	281,000	4.41	1,239,210.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	104,000	75.50	7,852,000.00	
EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERVICES	46,000	18.22	838,120.00	
GREENTOWN SER	128,000	12.08	1,546,240.00	
AIR CHINA LIMITED-H	102,000	6.14	626,280.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	5.19	550,140.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	210,000	19.52	4,099,200.00	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	98,000	5.41	530,180.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	106,000	11.44	1,212,640.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	6.18	630,360.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	8.81	599,080.00	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	79,000	10.76	850,040.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	6.50	741,000.00	

FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	43,600	53.00	2,310,800.00	
MINTH GROUP LTD	54,000	34.30	1,852,200.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	218,000	7.30	1,591,400.00	
BYD CO LTD-H	56,500	232.60	13,141,900.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	184,000	7.14	1,313,760.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	419,000	25.05	10,495,950.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	224,000	24.60	5,510,400.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	199,890	6.94	1,387,236.60	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	86,000	16.50	1,419,000.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	139,200	27.15	3,779,280.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	77,000	173.40	13,351,800.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	204,000	4.86	991,440.00	
LI NING CO LTD	161,000	81.15	13,065,150.00	
SHENZHOI INTERNATIONAL GROUP	59,500	188.20	11,197,900.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD.	74,000	37.50	2,775,000.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS	57,000	29.50	1,681,500.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	1,090,680	205.40	224,025,672.00	
HENGTEI NETWORKS GROUP LTD	192,000	6.80	1,305,600.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	22,400	106.30	2,381,120.00	
MEITUAN-CLASS B	259,600	301.80	78,347,280.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	70,800	19.92	1,410,336.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LIMITED	36,000	38.60	1,389,600.00	
GOME RETAIL HODINGS LTD	1,100,360	1.21	1,331,435.60	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	112,000	12.26	1,373,120.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	43,000	60.80	2,614,400.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	149,000	5.89	877,610.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	7,000	108.65	760,550.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	103,333	70.35	7,269,476.55	
NONGFU SPRING LTD	27,400	40.95	1,122,030.00	
TSING TAO BREWERY CO-H	38,000	83.90	3,188,200.00	
CHINA FEIHE LTD	250,000	17.26	4,315,000.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.00	0.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	227,000	46.00	10,442,000.00	

DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	4.65	518,475.00	
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	168,000	15.06	2,530,080.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	70,000	8.29	580,300.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	349,000	5.94	2,073,060.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	31,000	51.00	1,581,000.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	83,000	40.70	3,378,100.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	23,000	23.65	543,950.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	44,500	52.45	2,334,025.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	47,000	65.70	3,087,900.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	180,000	17.76	3,196,800.00	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC	15,000	67.25	1,008,750.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	86,000	19.96	1,716,560.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	16.62	845,958.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	96,400	22.90	2,207,560.00	
3SBIO,INC	77,000	12.00	924,000.00	
AKESO INC	20,000	59.50	1,190,000.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	84,000	85.70	7,198,800.00	
CANSINO BIOLOGICS INC	5,800	376.20	2,181,960.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	98,000	20.25	1,984,500.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	4.80	446,400.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	248,000	4.93	1,222,640.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	645,520	11.30	7,294,376.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	84,000	32.80	2,755,200.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	34,500	54.65	1,885,425.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	747,500	7.60	5,681,000.00	
SSY GROUP LTD	82,000	4.87	399,340.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,910,000	2.69	5,137,900.00	
BANK OF CHINA LTD-H	5,680,000	2.80	15,904,000.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	597,790	5.15	3,078,618.50	
CHINA BOHAI BANK CO LTD	160,000	3.06	489,600.00	
CHINA CITIC BANK-H	640,000	4.02	2,572,800.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	6,922,000	6.14	42,501,080.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	257,000	3.20	822,400.00	

CHINA MERCHANTS BANK-H	281,192	65.40	18,389,956.80	
CHINA MINSHENG BANKING-H	374,800	3.72	1,394,256.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	137,000	3.15	431,550.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,061,000	5.00	20,305,000.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	556,000	5.23	2,907,880.00	
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	7.91	1,218,140.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	525,000	15.38	8,074,500.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	198,000	24.25	4,801,500.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	12.94	1,338,927.68	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	59,100	26.25	1,551,375.00	
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	587,000	2.77	1,625,990.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	550,420	7.29	4,012,561.80	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	455,500	76.05	34,640,775.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	35,800	41.10	1,471,380.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	66,000	16.46	1,086,360.00	
CHINA YOUZAN LIMITED	888,000	1.56	1,385,280.00	
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	187,000	28.05	5,245,350.00	
KINGSOFT CORP LTD	67,000	47.95	3,212,650.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS	27,000	39.45	1,065,150.00	
WEIMOB INC	125,000	18.26	2,282,500.00	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	51,500	52.30	2,693,450.00	
ZTE CORP-H	47,252	22.85	1,079,708.20	
LENOVO GROUP LTD	520,000	8.73	4,539,600.00	
XIAOMI CORPORATION	1,033,000	27.95	28,872,350.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	52,000	58.20	3,026,400.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	43,000	41.70	1,793,100.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	65,000	16.60	1,079,000.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	51,500	226.80	11,680,200.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	28,000	27.20	761,600.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	46,000	42.05	1,934,300.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	348,000	15.62	5,435,760.00	
CHINA TOWER CORP LTD	2,790,000	1.08	3,013,200.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	27.80	1,000,800.00	

CHINA GAS HOLDINGS LTD	216,000	24.60	5,313,600.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	64,000	49.25	3,152,000.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	56,500	148.30	8,378,950.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	316,000	6.98	2,205,680.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	405,000	2.94	1,190,700.00	
GUANGDONG INVESTMENT	240,000	11.72	2,812,800.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	1.59	985,800.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	48,000	9.09	436,320.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	4.58	1,218,280.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	592,000	1.02	603,840.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H	102,800	20.75	2,133,100.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	162,000	19.54	3,165,480.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	10.12	835,912.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	173,600	6.84	1,187,424.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	102,000	11.40	1,162,800.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	46,000	14.46	665,160.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS	65,000	18.00	1,170,000.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CO.LTD	108,000	7.26	784,080.00	
CGN POWER CO LTD-H	627,000	1.70	1,065,900.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	240,000	12.56	3,014,400.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	240,000	1.63	391,200.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	150,000	9.40	1,410,000.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	238,000	2.92	694,960.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	290,000	17.02	4,935,800.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	36,600	88.00	3,220,800.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	78,000	32.45	2,531,100.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	8,000	167.70	1,341,600.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD	9,600	204.20	1,960,320.00	
WUXI APPTec CO LTD	24,100	167.50	4,036,750.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	242,500	137.40	33,319,500.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	94,000	9.99	939,060.00	

CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD	98,000	6.69	655,620.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	143,000	10.80	1,544,400.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	410,000	2.65	1,086,500.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	286,000	18.86	5,393,960.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	85,000	7.40	629,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	228,444	33.15	7,572,918.60	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	23,800	47.55	1,131,690.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	128,000	24.55	3,142,400.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	236,000	5.89	1,390,040.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	574,380	8.93	5,129,213.40	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	56,000	9.40	526,400.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	143,200	8.69	1,244,408.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	48,000	35.10	1,684,800.00	
KAISA GROUP HLDS LTD	200,428	3.16	633,352.48	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	92,000	10.26	943,920.00	
LOGAN GROUP CO LTD	128,000	11.44	1,464,320.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	135,000	42.90	5,791,500.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD	7,400	55.50	410,700.00	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	101,000	6.92	698,920.00	
SEAZEN GROUP LTD	168,000	7.32	1,229,760.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	176,000	2.44	429,440.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	103,000	20.20	2,080,600.00	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	41,000	22.95	940,950.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	190,000	27.45	5,215,500.00	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	43,000	24.80	1,066,400.00	
WHARF(HOLDING)	94,000	28.25	2,655,500.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	100,000	8.26	826,000.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	67,000	4.60	308,200.00	
CHINA LITERATURE LTD	28,400	90.85	2,580,140.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	870,000	1.08	939,600.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	19,000	193.20	3,670,800.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	414,300	590.50	244,644,150.00	
小計銘柄数：214			1,231,364,897.97	
			(17,485,381,551)	
組入時価比率：25.0%			27.4%	

リンギ	DIALOG GROUP BHD	313,044	2.95	923,479.80	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	14,500	19.20	278,400.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	190,000	7.95	1,510,500.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	248,000	4.75	1,178,000.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	7.81	263,978.00	
	SIME DARBY BERHAD	220,000	2.21	486,200.00	
	MISC BHD	99,960	7.00	699,720.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	56,460	6.30	355,698.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	51,400	4.25	218,450.00	
	GENTING BHD	187,000	5.06	946,220.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	229,000	2.94	673,260.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	7,700	26.16	201,432.00	
	IOI CORP	162,000	3.88	628,560.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG	26,400	21.50	567,600.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	4,400	134.60	592,240.00	
	PPB GROUP BERHAD	51,740	18.40	952,016.00	
	QL RESOURCES BHD	60,000	5.81	348,600.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	4.15	598,845.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,000	8.38	980,460.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES BERHAD	80,000	3.63	290,400.00	
	SUPERMAX CORP BHD	111,831	3.65	408,183.15	
	TOP GLOVE CORP BHD	428,000	4.67	1,998,760.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	156,000	5.76	898,560.00	
	AMMB HOLDING	125,000	2.98	372,500.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	508,000	4.59	2,331,720.00	
	HONG LEONG BANK	37,460	18.86	706,495.60	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	18.00	241,596.00	
	MALAYAN BANKING	291,000	8.18	2,380,380.00	
	PUBLIC BANK BHD	1,052,000	4.18	4,397,360.00	
	RHB BANK BHD	125,023	5.39	673,873.97	
	TELEKOM MALAYSIA	62,000	6.07	376,340.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	195,000	3.98	776,100.00	
	DIGI.COM BERHAD	186,000	4.32	803,520.00	
	MAXIS BHD	146,200	4.52	660,824.00	
	TENAGA NASIONAL	182,000	10.00	1,820,000.00	

	PETRONAS GAS BERHAD	63,000	15.76	992,880.00	
小計	銘柄数：36			32,533,151.52 (865,863,321)	
	組入時価比率：1.2%			1.4%	
パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	113,000	117.00	13,221,000.00	
	PTT PCL-NVDR	764,000	39.75	30,369,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	83,000	55.00	4,565,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	110,967	40.50	4,494,163.50	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	151,994	57.75	8,777,653.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	58,700	418.00	24,536,600.00	
	SCG PACKAGING PLC-NVDR	89,700	56.75	5,090,475.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	476,000	9.75	4,641,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	294,000	65.75	19,330,500.00	
	BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	447,100	8.55	3,822,705.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	700,000	4.62	3,234,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	270,978	32.00	8,671,296.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	155,025	36.25	5,619,656.25	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	354,597	14.60	5,177,116.20	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	258,000	30.75	7,933,500.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	35.25	2,597,925.00	
	CP ALL PCL-NVDR	421,000	61.50	25,891,500.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	20,900	134.50	2,811,050.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	112,000	37.25	4,172,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	279,000	27.00	7,533,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	199,800	18.50	3,696,300.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	56,000	41.50	2,324,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	655,000	22.70	14,868,500.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,200	130.50	4,202,100.00	
	BANGKOK BANK(F)	48,000	117.00	5,616,000.00	
	KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	10.80	2,884,140.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	50,800	98.75	5,016,500.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	20,100	536.00	10,773,600.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	920,000	3.34	3,072,800.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	85,700	172.00	14,740,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR	140,000	65.00	9,100,000.00	

	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	68,000	67.00	4,556,000.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	58.25	2,854,250.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	63,000	72.25	4,551,750.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSET-NVDR	154,000	19.10	2,941,400.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	34,000	43.75	1,487,500.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	17,300	182.50	3,157,250.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	95,000	60.75	5,771,250.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	59,000	75.50	4,454,500.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	181,500	34.50	6,261,750.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	43,000	52.25	2,246,750.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	108,000	55.50	5,994,000.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	620,000	8.35	5,177,000.00	
小計	銘柄数：43			318,236,880.45	
				(1,107,464,343)	
	組入時価比率：1.6%			1.7%	
フィリピン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	42.20	6,161,200.00	
	AYALA CORPORATION	21,102	795.00	16,776,090.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,465	596.00	3,257,140.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	255,005	60.55	15,440,552.75	
	SM INVESTMENTS CORP	17,100	984.00	16,826,400.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	69,000	158.00	10,902,000.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	24,400	202.20	4,933,680.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	67,000	139.00	9,313,000.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	145,999	87.75	12,811,412.25	
	BDO UNIBANK INC	124,998	114.40	14,299,771.20	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	127,695	48.50	6,193,207.50	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	3.95	2,953,810.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,070	1,819.00	3,765,330.00	
	PLDT INC	4,970	1,278.00	6,351,660.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	275.80	4,661,020.00	
	AYALA LAND LTD	608,000	36.50	22,192,000.00	
	SM PRIME HLDGS	773,975	36.55	28,288,786.25	
小計	銘柄数：17			185,127,059.95	
				(419,257,252)	
	組入時価比率：0.6%			0.7%	

ルピア	ADARO ENERGY PT	839,200	1,285.00	1,078,372,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	147,050	21,600.00	3,176,280,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,660,000	835.00	1,386,100,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	127,000	10,825.00	1,374,775,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	176,000	10,000.00	1,760,000,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	760,000	2,200.00	1,672,000,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	635,000	2,890.00	1,835,150,000.00	
	INDAH KIAT PULP&PAPER	240,000	7,750.00	1,860,000,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,335,000	4,920.00	6,568,200,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	178,000	7,925.00	1,410,650,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	266,200	6,025.00	1,603,855,000.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	499,000	6,325.00	3,156,175,000.00	
	GUDANG GARAM TBK	29,200	36,225.00	1,057,770,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	523,500	5,100.00	2,669,850,000.00	
	KALBE FARMA PT	1,540,000	1,480.00	2,279,200,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	823,000	31,250.00	25,718,750,000.00	
	BANK MANDIRI	1,330,000	6,025.00	8,013,250,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	499,000	4,970.00	2,480,030,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,110,000	3,940.00	16,193,400,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,479,000	1,185.00	1,752,615,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,800,000	3,300.00	12,540,000,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	553,000	3,190.00	1,764,070,000.00	
小計	銘柄数：22			101,350,492,000.00	
	組入時価比率：1.1%			(780,398,788)	1.2%
ウォン	GS HOLDINGS CORP	3,600	46,150.00	166,140,000.00	
	S-OIL CORPORATION	3,930	100,500.00	394,965,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,900	275,500.00	1,074,450,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	7,320	46,800.00	342,576,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	1,490	214,000.00	318,860,000.00	
	LG CHEM LTD - PREFERRED	630	372,000.00	234,360,000.00	
	LG CHEMICALS LTD	3,383	822,000.00	2,780,826,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,050	269,000.00	282,450,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	600	269,000.00	161,400,000.00	
	SKC CO LTD	1,450	144,500.00	209,525,000.00	

POSCO CHEMICAL CO LTD	2,241	147,500.00	330,547,500.00	
HYUNDAI STEEL CO	7,399	51,500.00	381,048,500.00	
KOREA ZINC CO LTD	592	423,500.00	250,712,000.00	
POSCO	5,510	335,500.00	1,848,605,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	4,520	33,900.00	153,228,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,220	41,300.00	174,286,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	6,900	54,900.00	378,810,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,520	24,100.00	205,332,000.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	16,000	25,800.00	412,800,000.00	
CJ CORP	1,100	106,500.00	117,150,000.00	
LG CORP	6,554	104,000.00	681,616,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	5,700	133,000.00	758,100,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	2,510	275,000.00	690,250,000.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,900	36,000.00	104,400,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	3,350	45,300.00	151,755,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	2,985	70,500.00	210,442,500.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING	3,210	136,000.00	436,560,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	30,700	6,800.00	208,760,000.00	
S-1 CORPORATION	1,450	80,400.00	116,580,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,140	204,500.00	233,130,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	12,600	32,000.00	403,200,000.00	
HMM COMPANY LIMITED	18,000	43,400.00	781,200,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	14,890	7,110.00	105,867,900.00	
CJ LOGISTICS	780	177,500.00	138,450,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	5,320	53,500.00	284,620,000.00	
HANON SYSTEMS	11,650	18,450.00	214,942,500.00	
HYUNDAI MOBIS	4,950	284,500.00	1,408,275,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	10,260	233,000.00	2,390,580,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,640	114,000.00	300,960,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	113,500.00	166,845,000.00	
KIA CORP	18,170	87,400.00	1,588,058,000.00	
COWAY CO LTD	3,340	78,400.00	261,856,000.00	
LG ELECTRONICS INC	7,410	160,500.00	1,189,305,000.00	
HLB INC	7,400	35,050.00	259,370,000.00	

FILA HOLDINGS CORP	2,930	55,500.00	162,615,000.00	
KANGWON LAND INC	7,900	27,400.00	216,460,000.00	
CJ ENM CO LTD	657	174,300.00	114,515,100.00	
LOTTE SHOPPING CO	800	116,000.00	92,800,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	427	281,000.00	119,987,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,960	95,500.00	187,180,000.00	
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	179,500.00	87,057,500.00	
E-MART CO	1,181	159,500.00	188,369,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	510	441,500.00	225,165,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,800	118,500.00	213,300,000.00	
KT & G CORP	8,020	84,400.00	676,888,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,460	278,000.00	683,880,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	74,000.00	112,480,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	670	1,714,000.00	1,148,380,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	747,000.00	77,688,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	5,814	122,800.00	713,959,200.00	
ALTEOGEN INC	2,130	78,800.00	167,844,000.00	
CELLTRION INC	7,050	280,500.00	1,977,525,000.00	
GREEN CROSS CORP	410	320,500.00	131,405,000.00	
SEEGENE, INC.	2,720	74,700.00	203,184,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,050	166,700.00	175,035,000.00	
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	490	324,500.00	159,005,000.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,330	78,100.00	181,973,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,770	123,500.00	218,595,000.00	
YUHAN CORPORATION	3,801	63,200.00	240,223,200.00	
HANA FINANCIAL HOLDINGS	20,100	44,500.00	894,450,000.00	
INDUSTRIAL BK OF KOREA	15,040	10,350.00	155,664,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	28,500	55,100.00	1,570,350,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP	32,400	39,800.00	1,289,520,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	42,300	11,300.00	477,990,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	2,850	48,850.00	139,222,500.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	2,510	210,500.00	528,355,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,640	78,300.00	363,312,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,570	184,500.00	474,165,000.00	
DUZONBIZON CO., LTD.	1,240	84,500.00	104,780,000.00	

	KMW CO.LTD.	1,140	57,000.00	64,980,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS	344,520	79,900.00	27,527,148,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	60,080	73,500.00	4,415,880,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	860	226,000.00	194,360,000.00	
	LG.DISPLAY CO LTD	16,200	24,450.00	396,090,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	4,070	174,000.00	708,180,000.00	
	SAMSUNG SDI CO,LTD	4,010	681,000.00	2,730,810,000.00	
	SK HYNIX INC	39,790	122,000.00	4,854,380,000.00	
	LG UPLUS CORP	13,300	15,000.00	199,500,000.00	
	SK TELECOM CO LTD	2,700	321,000.00	866,700,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER	19,600	25,050.00	490,980,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,140	101,500.00	318,710,000.00	
	MERITZ SECURITIES	24,500	4,405.00	107,922,500.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	24,737	9,370.00	231,785,690.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	12,600.00	97,398,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES	3,565	43,750.00	155,968,750.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,189	854,000.00	1,015,406,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,900	24,000.00	141,600,000.00	
	HYBE CO LTD	660	308,000.00	203,280,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,128	820,000.00	924,960,000.00	
	NETMARBLE CORP	1,470	134,500.00	197,715,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	1,550	64,700.00	100,285,000.00	
	KAKAO CORP	22,850	155,000.00	3,541,750,000.00	
	NAVER CORP	8,730	397,000.00	3,465,810,000.00	
小計	銘柄数：103			90,728,114,840.00	
				(8,836,918,385)	
	組入時価比率：12.6%			13.8%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	88,360	103.50	9,145,260.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	247,998	82.80	20,534,234.40	
	FORMOSA PLASTIC	273,424	100.00	27,342,400.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	360,726	81.40	29,363,096.40	
	ASIA CEMENT	152,980	50.00	7,649,000.00	
	TAIWAN CEMENT	334,294	50.70	16,948,705.80	
	CHINA STEEL	825,544	34.30	28,316,159.20	
	FAR EASTERN NEW CENTURY	234,454	30.75	7,209,460.50	

CORPORATION				
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	10,000	998.00	9,980,000.00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	18,050	392.00	7,075,600.00	
EVERGREEN MARINE	202,375	152.00	30,761,000.00	
WAN HAI LINES LIMITED	39,000	249.00	9,711,000.00	
YANG MING MARINE TRANSPORT	110,000	158.50	17,435,000.00	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	143,000	29.45	4,211,350.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	142,036	44.30	6,292,194.80	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	390.50	3,905,000.00	
GIANT MANUFACTURING	18,752	317.50	5,953,760.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	14,443	619.00	8,940,217.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	26,815	234.50	6,288,117.50	
POU CHEN CORP	135,468	35.90	4,863,301.20	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	20,000	571.00	11,420,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	37,816	262.50	9,926,700.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	337,836	72.60	24,526,893.60	
ONENESS BIOTECH CO LTD	13,000	212.00	2,756,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	355,459	15.95	5,669,571.05	
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,400,212	22.25	31,154,717.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	820,897	25.45	20,891,828.65	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	762,320	22.35	17,037,852.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	668,720	18.10	12,103,832.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	761,380	32.50	24,744,850.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	759,549	13.50	10,253,911.50	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	680,155	14.80	10,066,294.00	
TAIWAN BUSINESS BANK	336,646	9.36	3,151,006.56	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	728,451	20.90	15,224,625.90	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	291,574	43.50	12,683,469.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	83,973	200.50	16,836,586.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	759,152	25.05	19,016,757.60	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	552,035	52.00	28,705,820.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	1,089,789	12.15	13,240,936.35	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	187,359	24.15	4,524,719.85	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	479,541	70.00	33,567,870.00	

SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	708,228	9.34	6,614,849.52	
ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION	36,000	298.00	10,728,000.00	
ACER INC	256,767	31.55	8,100,998.85	
ADVANTECH CO.,LTD.	26,750	332.00	8,881,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	49,805	383.00	19,075,315.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	45,840	178.00	8,159,520.00	
COMPAL ELECTRONICS	354,590	22.60	8,013,734.00	
INVENTEC CO.,LTD	251,911	25.50	6,423,730.50	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	145,897	64.50	9,410,356.50	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	52,000	178.50	9,282,000.00	
PEGATRON CORP	159,692	74.40	11,881,084.80	
QUANTA COMPUTER INC	188,684	87.10	16,434,376.40	
WISTRON CORP	212,457	30.30	6,437,447.10	
WIWYNN CORP	5,000	978.00	4,890,000.00	
AU OPTRONICS CORP	572,008	23.10	13,213,384.80	
DELTA ELECTRONICS INC	138,681	294.00	40,772,214.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,834	64.20	3,520,342.80	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	911,649	108.50	98,913,916.50	
INNOLUX CORP	660,322	20.75	13,701,681.50	
LARGAN PRECISION CO LTD	7,040	2,950.00	20,768,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORPORATION	16,000	358.50	5,736,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	77,566	49.85	3,866,665.10	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	78,000	131.00	10,218,000.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	18,000	207.00	3,726,000.00	
WPG HOLDINGS CO LTD	120,387	50.20	6,043,427.40	
YAGEO CORPORATION	25,377	527.00	13,373,679.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	36,410	99.90	3,637,359.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	248,658	113.00	28,098,354.00	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,450.00	2,900,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	15,000	865.00	12,975,000.00	
MEDIATEK INC	108,538	918.00	99,637,884.00	
NANYA TECHNOLOGY CO	100,000	74.70	7,470,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	40,058	483.00	19,348,014.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	9,306	475.00	4,420,350.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	46,147	105.50	4,868,508.50	

	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	32,417	499.50	16,192,291.50	
	SILERGY CORP	6,000	3,375.00	20,250,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,773,000	583.00	1,033,659,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	849,500	51.20	43,494,400.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	69,000	121.00	8,349,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	24,000	363.00	8,712,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	33.10	8,010,200.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	287,065	113.50	32,581,877.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	105,000	64.60	6,783,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	128,200	101.50	13,012,300.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	46,509	53.90	2,506,835.10	
小計	銘柄数：87			2,334,521,195.73	
				(9,215,288,968)	
	組入時価比率：13.2%			14.5%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	70,000	475.05	33,253,500.00	
	COAL INDIA LTD	76,900	147.50	11,342,750.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	34,380	302.40	10,396,512.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	113,000	112.65	12,729,450.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	157,000	120.95	18,989,150.00	
	PETRONET LNG LTD	34,980	228.00	7,975,440.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	207,200	2,237.25	463,558,200.00	
	ASIAN PAINTS LTD	26,200	3,068.55	80,396,010.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	19,000	827.75	15,727,250.00	
	PI INDUSTRIES LTD	7,000	2,809.55	19,666,850.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,400	2,150.90	26,671,160.00	
	UPL LTD	32,100	772.20	24,787,620.00	
	ACC LIMITED	6,000	2,028.10	12,168,600.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	57,000	344.75	19,650,750.00	
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	17,700	1,496.65	26,490,705.00	
	SHREE CEMENT LIMITED	880	28,225.35	24,838,308.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	8,130	6,775.50	55,084,815.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	117,000	367.60	43,009,200.00	
	JSW STEEL LTD	66,000	672.95	44,414,700.00	
	TATA STEEL LIMITED	40,100	1,106.15	44,356,615.00	
	VEDANTA LTD	64,000	254.35	16,278,400.00	

BHARAT ELECTRONICS LTD	84,800	149.20	12,652,160.00	
LARSEN&TOUBRO LIMITED	47,100	1,467.05	69,098,055.00	
HAVELLS INDIA LTD	17,700	982.95	17,398,215.00	
SIEMENS LIMITED	3,100	2,003.55	6,211,005.00	
ADANI ENTERPRISES LTD	19,100	1,540.00	29,414,000.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	5,010	1,719.00	8,612,190.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,380	683.65	8,463,587.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,600	731.05	31,142,730.00	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,000	2,245.10	15,715,700.00	
BHARAT FORGE LIMITED	12,700	729.60	9,265,920.00	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	106,000	236.50	25,069,000.00	
MRF LTD	200	81,777.05	16,355,410.00	
BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	4,182.65	23,381,013.50	
EICHER MOTORS LTD	8,200	2,698.45	22,127,290.00	
HERO MOTOCORP LTD	9,300	2,894.85	26,922,105.00	
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	62,200	776.85	48,320,070.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,660	6,899.90	66,653,034.00	
TATA MOTORS LTD	134,000	334.30	44,796,200.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	340	29,682.85	10,092,169.00	
TITAN CO LTD	26,900	1,742.85	46,882,665.00	
JUBILANT FOODWORKS LIMITED	4,700	3,248.35	15,267,245.00	
TRENT LTD	15,000	853.25	12,798,750.00	
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,500	3,311.00	38,076,500.00	
UNITED SPIRITS LTD	22,600	671.15	15,167,990.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	7,600	3,648.85	27,731,260.00	
NESTLE INDIA LIMITED	2,360	17,649.15	41,651,994.00	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	45,300	742.55	33,637,515.00	
ITC LTD	221,100	204.45	45,203,895.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	58,200	2,514.35	146,335,170.00	
COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)	10,200	1,666.95	17,002,890.00	
DABUR INDIA LTD	37,800	571.75	21,612,150.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,200	885.65	24,089,680.00	
MARICO LIMITED	26,340	520.00	13,696,800.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	7,000	3,238.00	22,666,000.00	
BIOCON LTD	18,600	405.75	7,546,950.00	

AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	954.75	17,853,825.00
CIPLA LIMITED	34,500	960.15	33,125,175.00
DR.REDDYS LABORATORIES	9,140	5,282.00	48,277,480.00
IPCA LABORATORIES LTD	6,000	2,009.50	12,057,000.00
LUPIN LTD	14,900	1,156.55	17,232,595.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	61,700	671.35	41,422,295.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,270	2,920.40	9,549,708.00
AXIS BANK LIMITED	162,700	739.55	120,324,785.00
BANDHAN BANK LTD	56,000	341.15	19,104,400.00
ICICI BANK LTD	374,200	631.25	236,213,750.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	37,000	1,772.05	65,565,850.00
YES BANK LTD	839,000	13.90	11,662,100.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,927	2,321.40	18,401,737.80
REC LTD	39,810	147.70	5,879,937.00
BAJAJ FINSERV LTD	2,320	12,156.40	28,202,848.00
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	61,700	718.75	44,346,875.00
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY	16,000	1,527.35	24,437,600.00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	17,100	579.30	9,906,030.00
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	36,500	981.55	35,826,575.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	76,900	982.00	75,515,800.00
INFOSYS LTD	248,200	1,500.30	372,374,460.00
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	4,000	4,078.85	16,315,400.00
TATA CONSULTANCY SVS LTD	67,800	3,273.10	221,916,180.00
TECH MAHINDRA LTD	44,200	1,062.90	46,980,180.00
WIPRO LTD	106,000	542.15	57,467,900.00
INDUS TOWERS LTD	61,000	245.45	14,972,450.00
BHARTI AIRTEL LIMITED	177,500	539.60	95,779,000.00
ADANI TRANSMISSION LTD	19,100	1,302.15	24,871,065.00
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	164,000	234.85	38,515,400.00
ADANI TOTAL GAS LTD	19,000	1,321.35	25,105,650.00
GAIL INDIA LTD	94,600	155.25	14,686,650.00
INDRAPRASTHA GAS LTD	13,500	533.70	7,204,950.00
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	124,900	2,516.40	314,298,360.00
BAJAJ FINANCE LTD	20,040	6,116.00	122,564,640.00

	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	28,600	543.50	15,544,100.00	
	MUTHOOT FINANCE LTD	10,000	1,486.75	14,867,500.00	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	13,100	999.45	13,092,795.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	15,700	1,382.90	21,711,530.00	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,800	2,973.25	14,271,600.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	28,000	1,120.90	31,385,200.00	
	NTPC LIMITED	322,000	118.00	37,996,000.00	
	DIVIS LABORATORIES LTD	9,700	4,229.10	41,022,270.00	
	DLF LIMITED	58,000	302.60	17,550,800.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	4,860	4,977.70	24,191,622.00	
小計	銘柄数：100			4,512,435,360.30	
				(6,768,653,040)	
	組入時価比率：9.7%			10.6%	
パキスタン ピー	LUCKY CEMENT	9,000	912.75	8,214,750.00	
	HABIB BANK LTD	35,600	130.38	4,641,528.00	
	MCB BANK LIMITED	34,000	159.59	5,426,060.00	
	小計 銘柄数：3			18,282,338.00	
				(12,797,636)	
	組入時価比率：0.0%			0.0%	
カタールリヤル	QATAR FUEL CO	34,700	17.81	618,007.00	
	QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	220,000	3.04	668,800.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING	305,000	1.88	575,535.00	
	INDUSTRIES QATAR	143,000	13.26	1,896,180.00	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	117,900	5.29	624,280.50	
	MASRAF AL RAYAN	237,000	4.45	1,054,650.00	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	47,000	9.59	450,730.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	83,900	17.10	1,434,690.00	
	QATAR NATIONAL BANK	325,000	17.80	5,785,000.00	
	OOREDOO QSC	43,100	7.03	302,993.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	34,400	16.65	572,760.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	113,000	3.08	348,379.00	
	小計 銘柄数：12			14,332,004.50	
				(428,383,614)	
	組入時価比率：0.6%			0.7%	
エジプトポンド	EASTERN TOBACCO	51,525	12.02	619,330.50	

小計	COMMERICAL INTERNATIONAL BANK	91,300	50.73	4,631,649.00	
	FAWRY FOR BANKING & PAYMENT	37,000	19.17	709,290.00	
	銘柄数：3			5,960,269.50	
	組入時価比率：0.1%			(41,953,144)	0.1%
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	15,000	156.54	2,348,100.00	
	SASOL LTD	43,800	208.00	9,110,400.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,000	237.15	1,660,050.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,110	1,529.97	6,288,176.70	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	31,000	270.60	8,388,600.00	
	GOLD FIELDS LTD	59,600	132.35	7,888,060.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	40,800	58.59	2,390,472.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	55,700	229.98	12,809,886.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,900	575.52	2,244,528.00	
	NORTHAM PLATINUM LTD	26,700	209.24	5,586,708.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	205,000	58.35	11,961,750.00	
	BIDVEST GROUP LTD	17,200	189.97	3,267,484.00	
	NASPERS LTD-N SHS	31,600	3,040.00	96,064,000.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	61,610	54.35	3,348,503.50	
	MR PRICE GROUP LTD	16,700	212.45	3,547,915.00	
	BID CORP LTD	22,800	307.08	7,001,424.00	
	CLICKS GROUP LTD	18,300	242.50	4,437,750.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	39,600	154.33	6,111,468.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	15,300	183.31	2,804,643.00	
	TIGER BRANDS LTD	12,800	211.73	2,710,144.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	31,500	159.48	5,023,620.00	
	ABSA GROUP LTD	55,200	131.36	7,251,072.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	5,420	1,639.66	8,886,957.20	
	NEDBANK GROUP LTD	31,900	166.09	5,298,271.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	91,100	125.42	11,425,762.00	
	FIRSTRAND LTD	377,000	52.16	19,664,320.00	
	REMGRO LTD	33,200	113.88	3,780,816.00	
	DISCOVERY LTD	25,800	126.85	3,272,730.00	
	OLD MUTUAL LTD	294,000	13.00	3,822,000.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	40,350	30.67	1,237,534.50	

		SANLAM LIMITED	149,000	61.18	9,115,820.00	
		MTN GROUP LTD	119,000	105.48	12,552,120.00	
		VODACOM GROUP	51,700	132.66	6,858,522.00	
		REINET INVESTMENTS SCA	8,790	276.78	2,432,896.20	
		NEPI ROCKCASTLE PLC	26,281	99.26	2,608,652.06	
		MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	117.13	3,122,685.80	
		小計 銘柄数：36			306,323,840.96	
		組入時価比率：3.4%			(2,377,073,005)	3.7%
	U A E ディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	179,000	4.32	773,280.00	
		ABU DHABI COMMERCIAL BANK	173,870	6.87	1,194,486.90	
		ABU DHABI ISLAMIC BANK	128,000	5.58	714,240.00	
		DUBAI ISLAMIC BANK	102,029	4.88	497,901.52	
		EMIRATES NBD PJSC	197,000	13.90	2,738,300.00	
		FIRST ABU DHABI BANK PJSC	307,000	16.42	5,040,940.00	
		EMIRATES TELECOM CORPORATION	118,200	22.18	2,621,676.00	
		ALDAR PROPERTIES PJSC	277,000	3.81	1,055,370.00	
		EMAAR PROPERTIES PJSC	290,000	4.12	1,194,800.00	
		小計 銘柄数：9			15,830,994.42	
		組入時価比率：0.7%			(476,038,002)	0.7%
	クウェートディナール	AGILITY	79,200	0.94	74,606.40	
		BOUBAYAN BANK K.S.C	71,400	0.71	51,122.40	
		KUWAIT FINANCE HOUSE	343,200	0.77	266,666.40	
		NATIONAL BANK OF KUWAIT	498,300	0.84	420,565.20	
		MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	139,000	0.58	81,454.00	
		MABANEE CO SAKC	38,160	0.73	28,009.44	
		小計 銘柄数：6			922,423.84	
		組入時価比率：0.5%			(338,179,028)	0.5%
	サウジアラビアリヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	9,600	21.98	211,008.00	
		SAUDI ARABIAN OIL CO	156,900	35.30	5,538,570.00	
		ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,020	74.50	671,990.00	
		NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	28,000	19.00	532,000.00	

SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	16,600	117.00	1,942,200.00	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	29,300	27.60	808,680.00	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	66,500	121.20	8,059,800.00	
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	18,700	35.15	657,305.00	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	47,000	17.38	816,860.00	
SAUDI NATIONAL PETROCHEMICAL COMPANY	8,400	44.50	373,800.00	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	19,900	70.60	1,404,940.00	
SAUDI CEMENT	6,400	64.00	409,600.00	
SAUDI ARABIAN MINING CO	28,200	56.80	1,601,760.00	
JARIR MARKETING CO	3,730	222.00	828,060.00	
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,700	127.40	471,380.00	
ALMARAI CO	18,000	62.40	1,123,200.00	
SAVOLA	16,600	43.00	713,800.00	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	3,000	163.00	489,000.00	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,400	183.00	622,200.00	
AL RAJHI BANK	86,800	110.60	9,600,080.00	
ALINMA BANK	81,000	20.14	1,631,340.00	
ARAB NATIONAL BANK	47,800	22.20	1,061,160.00	
BANK AL - JAZIRA	34,100	18.60	634,260.00	
BANK ALBILAD	23,300	36.65	853,945.00	
BANQUE SAUDI FRANSI	37,400	38.60	1,443,640.00	
RIYAD BANK	97,500	26.55	2,588,625.00	
SAUDI BRITISH BANK	61,100	31.55	1,927,705.00	
THE SAUDI NATIONAL BANK	161,900	55.30	8,953,070.00	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	3,900	130.80	510,120.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,700	84.10	227,070.00	
SAUDI TELECOM CO	43,600	133.60	5,824,960.00	
ETIHAD ETISALAT CO	23,900	33.00	788,700.00	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS COMPANY	29,000	14.56	422,240.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	58,200	24.02	1,397,964.00	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	23,000	10.34	237,820.00	
EMAAR ECONOMIC CITY	35,000	11.78	412,300.00	
小計銘柄数：36			65,791,152.00	
			(1,938,207,337)	

		組入時価比率：2.8%			3.0%	
合計					63,937,419,593	(63,937,419,593)

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(2021年6月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	3,929,400	25,000,807.50	
	小計	銘柄数：1	3,929,400	25,000,807.50	
		組入時価比率：3.9%		(2,757,089,051)	97.9%
	合計			2,757,089,051	(2,757,089,051)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	208,100	4,802,948.00	
	小計	銘柄数：1	208,100	4,802,948.00	
		組入時価比率：0.0%		(25,804,798)	0.9%
	ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	300,000	4,446,000.00	
	小計	銘柄数：1	300,000	4,446,000.00	
		組入時価比率：0.0%		(34,500,960)	1.2%
合計				60,305,758	(60,305,758)
合計				2,817,394,809	(2,817,394,809)

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

	2021年 6月22日現在
--	---------------

種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	3,125,785,252	-	3,086,133,968	39,651,284
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	252,753,231	-	253,638,960	885,729
米ドル	252,753,231	-	253,638,960	885,729
合計	-	-	-	38,765,555

（注）時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

J - R E I T インデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2021年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,215,456,861
投資証券	46,276,432,140
派生商品評価勘定	2,689,260
未収入金	132,185,023
未収配当金	186,567,600
差入委託証拠金	90,248,600
流動資産合計	47,903,579,484

(2021年 6月22日現在)

資産合計	47,903,579,484
負債の部	
流動負債	
未払解約金	193,634,019
未払利息	1,066
流動負債合計	193,635,085
負債合計	193,635,085
純資産の部	
元本等	
元本	16,978,856,832
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	30,731,087,567
元本等合計	47,709,944,399
純資産合計	47,709,944,399
負債純資産合計	47,903,579,484

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	投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 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。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2021年 6月22日現在

1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.8100円
(10,000口当たり純資産額)	(28,100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 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、REITの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。 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

2021年 6月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 6月22日現在	
期首	2020年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	16,726,361,153円
同期中における追加設定元本額	5,210,803,187円
同期中における一部解約元本額	4,958,307,508円
期末元本額	16,978,856,832円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,709,234,492円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,208,873,761円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	802,041,820円
野村資産設計ファンド2015	14,378,924円
野村資産設計ファンド2020	14,393,797円
野村資産設計ファンド2025	18,124,101円
野村資産設計ファンド2030	18,583,563円
野村資産設計ファンド2035	20,794,453円
野村資産設計ファンド2040	35,772,624円
野村資産設計ファンド2045	3,489,750円
野村インデックスファンド・J-REIT	3,357,086,539円
ネクストコア	20,474,065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	1,000,550,518円
野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）	2,169,588,900円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	844,896,999円
野村資産設計ファンド2050	4,465,459円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	848,457円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	970,876円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,764,255円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,060,462円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,467,102円
野村6資産均等バランス	1,499,703,599円
野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	91,100,273円
野村資産設計ファンド2060	2,031,772円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	162,185,833円
ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT（適格機関投資家専用）	85,364,097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）	152,288,111円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,704,684,727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）	540,233,168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）	449,484円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信（適格機関投資家専用）	2,107,611円
野村DC運用戦略ファンド	422,144,431円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	36,224,951円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	6,954,461円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	3,221,883円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	7,381,577円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	3,613,807円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	3,788,759円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	1,603,752円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	902,403円

多資産分散投資ファンド（バランス１０）（確定拠出年金向け）

11,216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(2021年6月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年6月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	653	90,309,900	
		サンケイリアルエステート投資法 人 投資証券	978	126,651,000	
		S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	1,051	159,646,900	
		東海道リート投資法人 投資証券	91	9,555,000	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	1,378	855,738,000	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,696	771,083,200	
		産業ファンド投資法人 投資証券	5,651	1,180,493,900	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,797	1,372,615,500	
		ケネディクス・レジデンシャル・ネ クスト投資法人 投資証券	2,725	645,007,500	
		アクティブ・プロパティーズ投資 法人 投資証券	2,003	1,033,548,000	
		G L P 投資法人 投資証券	12,493	2,359,927,700	
		コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	1,797	617,269,500	
		日本プロロジスリート投資法人 投 資証券	6,321	2,243,955,000	
		星野リゾート・リート投資法人 投 資証券	608	411,616,000	
		O n e リート投資法人 投資証券	623	195,933,500	

イオンリート投資法人 投資証券	4,055	644,745,000	
ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,314	615,078,400	
日本リート投資法人 投資証券	1,299	587,148,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	25,406	575,191,840	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,759	1,080,652,100	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	884	121,638,400	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,590	468,732,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	853	123,343,800	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	770	95,172,000	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,928	2,283,084,800	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	699	69,131,100	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,836	878,701,200	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	4,108	244,426,000	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	375	51,075,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,395	804,915,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	645	54,051,000	
投資法人みらい 投資証券	4,318	217,195,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	866	120,547,200	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,006	480,868,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,279	235,719,700	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	613	74,969,900	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,201	145,561,200	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス	1,551	231,874,500	

投資法人 投資証券			
日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,499	3,162,797,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3,998	2,750,624,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	19,914	2,375,740,200	
オリックス不動産投資法人 投資証券	7,966	1,734,994,800	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,489	1,106,360,500	
N T T都市開発リート投資法人	3,611	588,231,900	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,680	536,804,000	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,776	352,274,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,550	1,391,085,000	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,857	448,549,000	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	16,717	748,921,600	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,327	692,694,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	2,583	449,700,300	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,612	852,818,000	
福岡リート投資法人 投資証券	2,068	381,546,000	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,237	964,860,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	3,276	322,030,800	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	852	662,856,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,806	282,639,000	
スターツプロシード投資法人 投資証券	623	146,342,700	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,704	1,916,544,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	12,880	905,464,000	

有価証券報告書（内国投資信託）					
	小計	大和証券リビング投資法人 投資証券	5,221	625,475,800	
		ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,710	599,907,000	
		銘柄数：62	250,571	46,276,432,140	
		組入時価比率：97.0%		100.0%	
合計				46,276,432,140	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2021年 6月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	1,426,453,600	-	1,429,217,000	2,689,260
合計	1,426,453,600	-	1,429,217,000	2,689,260

（注）時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

海外REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2021年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	140,426,268
コール・ローン	390,135,519
投資証券	41,323,543,389
派生商品評価勘定	1,313,418
未収入金	70,508,285
未収配当金	65,537,288
差入委託証拠金	166,221,879
流動資産合計	42,157,686,046
資産合計	42,157,686,046
負債の部	

(2021年 6月22日現在)

流動負債	
派生商品評価勘定	4,102,416
未払金	473,286,466
未払解約金	5,900,835
未払利息	342
その他未払費用	120,700
流動負債合計	483,410,759
負債合計	483,410,759
純資産の部	
元本等	
元本	14,458,368,180
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	27,215,907,107
元本等合計	41,674,275,287
純資産合計	41,674,275,287
負債純資産合計	42,157,686,046

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2021年 6月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.8824円
(10,000口当たり純資産額)	(28,824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 2020年 6月23日 至 2021年 6月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、REITの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

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

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 6月22日現在	
期首	2020年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	13,168,369,904円
同期中における追加設定元本額	4,660,973,588円
同期中における一部解約元本額	3,370,975,312円
期末元本額	14,458,368,180円
期末元本額の内訳＊	
野村世界 6 資産分散投信（安定コース）	1,675,314,676円
野村世界 6 資産分散投信（分配コース）	2,165,044,178円
野村世界 6 資産分散投信（成長コース）	786,127,201円
野村資産設計ファンド 2 0 1 5	14,093,142円
野村資産設計ファンド 2 0 2 0	14,108,101円
野村資産設計ファンド 2 0 2 5	17,763,891円
野村資産設計ファンド 2 0 3 0	18,214,799円
野村資産設計ファンド 2 0 3 5	20,381,672円
野村資産設計ファンド 2 0 4 0	35,061,967円
野村資産設計ファンド 2 0 4 5	3,420,431円
野村インデックスファンド・外国 R E I T	1,665,571,026円
ネクストコア	14,155,829円
野村インデックスファンド・海外 5 資産バランス	380,670,789円
野村世界 6 資産分散投信（配分変更コース）	850,239,308円
野村資産設計ファンド 2 0 5 0	4,376,852円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,022,466円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,257,092円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	5,444,795円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,701,766円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	5,525,367円
野村 6 資産均等バランス	1,469,945,439円
野村資産設計ファンド 2 0 6 0	1,991,458円
N E X T F U N D S 外国 R E I T ・ S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信	2,842,328,042円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア） R E I T	1,382,216,859円
ノムラ海外 R E I T インデックス・ファンド V A（適格機関投資家専用）	663,211,420円
ノムラ F O F s 用インデックスファンド・外国 R E I T（適格機関投資家専用）	75,690,970円
野村 F O F s 用・ターゲット・リターン・8 資産バランス（2 % コース向け）（適格機関投資家専用）	440,471円
野村 D C 運用戦略ファンド	292,581,430円

野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	23,537,843円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	6,816,464円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	3,157,929円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	7,235,108円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	3,542,089円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	3,713,580円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	1,571,901円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	884,500円
多資産分散投資ファンド（バランス１０）（確定拠出年金向け）	7,329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(2021年6月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年6月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	22,000	478,720.00	
		AGREE REALTY CORP	15,700	1,104,338.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	17,200	327,832.00	
		ALEXANDERS INC	500	137,835.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	33,970	6,334,046.20	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	12,200	462,136.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	34,200	1,669,302.00	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	28,000	236,320.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	68,000	2,666,960.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	61,900	2,349,724.00	
		APARTMENT INCOME REIT CO	38,300	1,854,486.00	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	36,800	275,264.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	51,300	819,774.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	14,200	199,368.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	34,560	7,330,176.00	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	7,000	69,440.00	

BOSTON PROPERTIES	35,200	4,210,976.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	43,200	624,240.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	73,600	1,711,200.00	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	33,700	840,478.00	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	9,200	171,028.00	
BRT APARTMENTS CORP	2,400	43,128.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	24,170	3,273,584.80	
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	23,800	552,398.00	
CENTERSPACE	3,100	240,808.00	
CHATHAM LODGING TRUST	10,800	145,800.00	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,600	23,920.00	
CIM COMMERCIAL TRUST-RIGHTS	2,600	0.00	
CITY OFFICE REIT INC	10,700	135,141.00	
CLIPPER REALTY INC	2,400	18,000.00	
COLONY CAPITAL INC	119,000	1,011,500.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	29,000	510,690.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	5,400	262,170.00	
COREPOINT LODGING INC	8,900	92,204.00	
CORESITE REALTY CORP	10,720	1,419,220.80	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	28,500	832,200.00	
COUSINS PROPERTIES INC	37,200	1,415,832.00	
CTO REALTY GROWTH INC	1,200	63,816.00	
CUBESMART	50,000	2,360,500.00	
CYRUSONE INC	30,400	2,122,832.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	53,000	540,600.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	69,670	10,846,225.60	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	60,000	241,800.00	
DOUGLAS EMMETT INC	41,100	1,466,448.00	
DUKE REALTY CORP	92,900	4,528,875.00	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	100,000	0.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	19,800	426,294.00	
EASTGROUP PROPERTIES	9,850	1,670,954.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	34,600	428,694.00	
EPR PROPERTIES	18,400	978,696.00	

EQUINIX INC	22,150	18,218,375.00	
EQUITY COMMONWEALTH	30,600	850,986.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	42,100	3,231,175.00	
EQUITY RESIDENTIAL	85,200	6,761,472.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	28,700	792,120.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	16,000	4,930,720.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	33,120	5,420,419.20	
FARMLAND PARTNERS INC	6,800	85,136.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	17,580	2,104,853.40	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	31,600	1,687,756.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	19,300	560,472.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	25,000	132,750.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	53,700	2,502,957.00	
GEO GROUP INC/THE	30,100	235,382.00	
GETTY REALTY CORP	8,900	291,831.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,300	188,410.00	
GLADSTONE LAND CORP	5,800	143,840.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	13,500	206,010.00	
GLOBAL NET LEASE INC	24,200	446,248.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	35,400	1,092,090.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	54,300	1,547,550.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	133,500	4,517,640.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9,600	111,648.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	26,100	1,220,697.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	174,700	3,079,961.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	37,100	1,072,561.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	25,900	478,114.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	16,400	430,828.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	5,900	1,112,799.00	
INVITATION HOMES INC	140,600	5,276,718.00	
IRON MOUNTAIN INC	71,600	3,247,776.00	
JBG SMITH PROPERTIES	27,800	939,084.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	160,000	121,600.00	
KILROY REALTY CORP	26,300	1,899,912.00	

KIMCO REALTY CORP	107,700	2,263,854.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	21,300	469,878.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	68,500	854,880.00	
LIFE STORAGE INC	19,100	2,070,822.00	
LTC PROPERTIES INC	9,500	364,040.00	
MACERICH CO /THE	38,000	675,260.00	
MACK-CALI REALTY CORP	20,900	354,046.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	343,515	264,506.55	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	145,900	2,957,393.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	28,360	4,848,992.80	
MONMOUTH REIT-CLASS A	24,300	463,644.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	43,000	2,060,560.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	17,300	872,266.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	11,400	752,172.00	
NETSTREIT CORP	5,800	136,938.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	18,000	125,100.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5,500	308,220.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	12,200	361,486.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	57,900	2,124,930.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,200	121,002.00	
PARAMOUNT GROUP INC	41,000	444,030.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	59,300	1,271,985.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	32,900	777,098.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	15,000	37,500.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	53,800	1,026,504.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	30,300	589,638.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	6,400	129,024.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	12,400	129,704.00	
PRIME US REIT	110,000	95,150.00	
PROLOGIS INC	182,940	22,426,614.60	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4,950	756,855.00	
PUBLIC STORAGE	37,660	11,431,693.00	
QTS REALTY TRUST INC CL A	16,600	1,281,520.00	
REALTY INCOME CORP	92,500	6,295,550.00	

REGENCY CENTERS CORP	38,800	2,539,460.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	30,000	539,700.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	54,000	642,600.00	
RETAIL VALUE INC	4,401	94,665.51	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	33,300	1,960,704.00	
RLJ LODGING TRUST	40,100	626,763.00	
RPT REALTY	19,000	253,270.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	13,700	1,134,771.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	53,000	943,930.00	
SAFEHOLD INC	3,500	274,470.00	
SAUL CENTERS INC	3,400	159,800.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	9,300	174,747.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	39,900	543,837.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	81,290	10,689,635.00	
SITE CENTERS CORP	40,500	611,550.00	
SL GREEN REALTY CORP	17,300	1,384,173.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	28,100	1,365,660.00	
STAG INDUSTRIAL INC	39,700	1,549,094.00	
STORE CAPITAL CORP	59,900	2,094,104.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	27,000	263,790.00	
SUN COMMUNITIES INC	27,710	4,882,224.90	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	54,200	707,852.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	24,100	445,368.00	
TERRENO REALTY CORP	17,000	1,130,670.00	
UDR INC	73,000	3,617,150.00	
UMH PROPERTIES INC	9,900	218,295.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,200	199,776.00	
URBAN EDGE PROPERTIES	27,400	539,780.00	
URSTADT BIDDLE-CL A	6,900	135,654.00	
VENTAS INC	92,900	5,352,898.00	
VEREIT INC	56,200	2,649,830.00	
VICI PROPERTIES INC	133,100	4,263,193.00	
VORNADO REALTY TRUST	38,900	1,872,257.00	
WASHINGTON REAL ESTATE INV	21,100	486,355.00	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	29,400	945,210.00	

小計	WELLTOWER INC	103,300	8,323,914.00	
	WHITESTONE REIT	9,600	79,968.00	
	WP CAREY INC	44,100	3,390,849.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	28,800	563,616.00	
	銘柄数：157	6,155,916	281,260,304.36	
	組入時価比率：74.4%		(31,017,386,364)	75.0%
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	15,400	710,556.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	16,000	187,680.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST	4,000	49,480.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,600	235,648.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	21,100	1,250,175.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	40,100	587,866.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	22,000	237,380.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	10,900	195,655.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	12,800	217,088.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	21,600	327,672.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,700	160,465.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	26,800	478,916.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	8,100	688,500.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	35,800	587,478.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	17,300	297,387.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	12,900	267,675.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,000	96,000.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,600	77,464.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	24,000	310,320.00	
	PLAZA RETAIL REIT	12,000	56,280.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	38,700	855,657.00	
	SLATE GROCERY REIT	4,300	55,599.00	
	SLATE OFFICE REIT	8,000	43,120.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	17,900	534,852.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	19,900	351,633.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	10,000	74,800.00	

小計	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	10,600	242,952.00	
	銘柄数：27	431,100	9,178,298.00	
	組入時価比率：2.0%		(817,327,436)	2.0%
ユーロ	AEDIFICA	8,220	932,970.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	43,300	681,542.00	
	ALTAREA	940	170,704.00	
	BEFIMMO S.C.A.	6,500	223,275.00	
	CARE PROPERTY INVEST	6,000	161,100.00	
	CARMILA	11,400	143,412.00	
	COFINIMMO	7,360	965,632.00	
	COVIVIO	12,000	909,600.00	
	CROMWELL REIT EUR	72,000	169,200.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	9,711	212,282.46	
	GECINA SA	13,300	1,768,235.00	
	HAMBORNER REIT AG	17,600	159,491.20	
	HIBERNIA REIT PLC	160,000	199,360.00	
	ICADE	7,700	571,340.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	14,000	62,090.00	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	62,800	559,234.00	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	6,000	139,500.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	110,000	168,080.00	
	KLEPIERRE	50,200	1,141,548.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,000	71,400.00	
	MERCIALYS	9,200	94,944.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	84,000	768,768.00	
	MONTEA	2,540	259,080.00	
	NSI NV	4,300	148,780.00	
	RETAIL ESTATES	2,600	182,000.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	34,300	2,697,009.00	
	VASTNED RETAIL NV	4,600	118,450.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	33,900	1,111,242.00	
	WERELDHAVE NV	10,000	152,300.00	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	4,080	207,264.00	
小計	銘柄数：30	822,551	15,149,832.66	
			(1,989,173,028)	

	組入時価比率：4.8%		4.8%	
英ボンド	AEW UK REIT PLC	32,000	30,016.00	
	ASSURA PLC	650,000	494,975.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	40,700	521,774.00	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	190,000	167,200.00	
	BRITISH LAND	233,000	1,149,855.00	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	218,000	369,074.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	162,000	190,512.00	
	CUSTODIAN REIT PLC	97,000	95,448.00	
	DERWENT LONDON PLC	27,900	965,340.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	146,000	125,852.00	
	GCP STUDENT LIVING PLC	118,000	195,408.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	62,000	457,250.00	
	HAMMERSON PLC	1,020,000	402,186.00	
	HOME REIT PLC	60,000	68,400.00	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	74,000	81,548.00	
	INTU PROPERTIES PLC	184,000	3,267.84	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	184,000	1,246,784.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	225,000	534,600.00	
	LXI REIT PLC	159,000	225,144.00	
	NEWRIVER REIT PLC	80,000	68,080.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	131,000	114,494.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	330,000	512,820.00	
	REGIONAL REIT LTD	100,000	87,000.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	52,900	499,905.00	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	160,000	75,520.00	
	SEGRO PLC	297,000	3,246,210.00	
	SHAFTESBURY PLC	75,000	448,125.00	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	110,000	80,300.00	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	198,000	233,640.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	96,000	100,800.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	424,000	836,552.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	176,000	137,456.00	
	UNITE GROUP PLC	97,400	1,082,114.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	32,800	281,916.00	

小計	銘柄数：34	6,242,700	15,129,565.84 (2,320,875,399)	
	組入時価比率：5.6%		5.6%	
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	96,000	302,400.00	
	APN INDUSTRIA REIT	38,000	121,600.00	
	ARENA REIT	87,000	299,280.00	
	AVENTUS GROUP	96,000	292,800.00	
	BWP TRUST	119,000	515,270.00	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	120,000	318,000.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	119,000	445,060.00	
	CENTURIA OFFICE REIT	88,000	205,920.00	
	CHARTER HALL GROUP	114,900	1,737,288.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	143,610	690,764.10	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	130,000	507,000.00	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	82,000	283,720.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	470,000	427,700.00	
	DEXUS	266,000	2,862,160.00	
	GDI PROPERTY GROUP	130,000	146,900.00	
	GOODMAN GROUP	416,200	8,706,904.00	
	GPT GROUP	477,000	2,299,140.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	70,000	282,800.00	
	HOME CONSORTIUM	44,000	255,200.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	120,000	171,000.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	40,000	130,800.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	74,000	448,440.00	
	IRONGATE GROUP	125,000	181,250.00	
	MIRVAC GROUP	965,000	2,817,800.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	242,000	491,260.00	
	NATIONAL STORAGE REIT-RTS	38,596	1,157.88	
	RURAL FUNDS GROUP	80,000	198,400.00	
	SCENTRE GROUP	1,274,000	3,592,680.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	273,000	696,150.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	585,000	2,726,100.00	
	VICINITY CENTRES	950,000	1,553,250.00	
	WAYPOINT REIT LTD	195,000	516,750.00	

小計	銘柄数：32	8,068,306	34,224,943.98	
	組入時価比率：6.8%		(2,838,959,103)	6.9%
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	200,000	310,000.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	270,000	619,650.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	390,000	454,350.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	260,000	403,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	100,000	303,000.00	
小計	銘柄数：5	1,220,000	2,090,000.00	
	組入時価比率：0.4%		(160,825,500)	0.4%
香港ドル	CHAMPION REIT	500,000	2,250,000.00	
	FORTUNE REIT	350,000	2,940,000.00	
	LINK REIT	516,000	40,144,800.00	
	PROSPERITY REIT	300,000	894,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	240,000	1,094,400.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	380,000	1,565,600.00	
小計	銘柄数：6	2,286,000	48,888,800.00	
	組入時価比率：1.7%		(694,220,960)	1.7%
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	110,000	156,200.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	329,869	272,141.92	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	817,762	2,396,042.66	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	479,956	479,956.00	
	CAPITALAND CHINA TRUST	230,279	317,785.02	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,125,694	2,363,957.40	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	180,000	223,200.00	
	EC WORLD REIT	60,000	48,300.00	
	ESR REIT	599,760	245,901.60	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	260,000	153,400.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	356,400	98,010.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	322,838	778,039.58	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	200,000	105,000.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	719,746	993,249.48	

		TRUST			
		IREIT GLOBAL	116,320	76,189.60	
		KEPPEL DC REIT	317,211	815,232.27	
		KEPPEL REIT	490,000	563,500.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	220,000	177,100.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	1,310,000	83,840.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	548,716	1,174,252.24	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	471,900	1,321,320.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	715,008	1,444,316.16	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	500,000	530,000.00	
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	610,216	244,086.40	
		PARKWAY LIFE REAL ESTATE	91,000	401,310.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219,764	94,498.52	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	140,000	130,200.00	
		SPH REIT	250,000	217,500.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	330,000	181,500.00	
		SUNTEC REIT	534,000	779,640.00	
	小計	銘柄数：30	12,656,439	16,865,668.85	
				(1,382,816,189)	
		組入時価比率：3.3%		3.3%	
	ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	24,000	173,280,000.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	7,000	38,500,000.00	
		JR REIT XXVII	28,000	147,000,000.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	9,000	54,450,000.00	
		LOTTE REIT CO LTD	28,257	172,367,700.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	19,000	93,100,000.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	11,000	91,190,000.00	
	小計	銘柄数：7	126,257	769,887,700.00	
				(74,987,061)	
		組入時価比率：0.2%		0.2%	
	新シェケル	REIT 1 LTD	45,000	798,750.00	
	小計	銘柄数：1	45,000	798,750.00	
				(26,972,349)	
		組入時価比率：0.1%		0.1%	
	合計			41,323,543,389	

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2021年 6月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	315,202,296	-	311,099,880	4,102,416
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	369,882,164	-	371,195,582	1,313,418
米ドル	319,913,760	-	320,911,308	997,548
カナダドル	8,828,700	-	8,904,910	76,210
ユーロ	9,142,980	-	9,191,105	48,125
英ポンド	13,672,980	-	13,805,838	132,858
豪ドル	2,475,780	-	2,488,491	12,711
香港ドル	1,132,784	-	1,136,000	3,216
シンガポールドル	14,715,180	-	14,757,930	42,750
合計	-	-	-	2,788,998

（注）時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

2021年7月30日現在

資産総額	149,545,697円
負債総額	109,780円
純資産総額（ - ）	149,435,917円
発行済口数	116,983,359口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2774円

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	790,495,176,773円
負債総額	511,517,388円
純資産総額（ - ）	789,983,659,385円
発行済口数	591,680,610,597口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3352円

（参考）外国債券マザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	606,135,354,992円
負債総額	1,998,952,827円
純資産総額（ - ）	604,136,402,165円
発行済口数	236,160,553,621口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5582円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	9,614,609,527円
負債総額	12,219,279円
純資産総額（ - ）	9,602,390,248円
発行済口数	6,803,765,060口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4113円

（参考）国内株式マザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	412,016,925,186円
負債総額	22,199,696,052円
純資産総額（ - ）	389,817,229,134円
発行済口数	195,875,336,662口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9901円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	1,068,782,200,742円
負債総額	1,674,452,050円
純資産総額（ - ）	1,067,107,748,692円
発行済口数	255,677,123,665口
1口当たり純資産額（ / ）	4.1737円

（参考）新興国株式マザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	68,371,772,646円
負債総額	201,945,927円
純資産総額（ - ）	68,169,826,719円
発行済口数	42,349,189,943口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6097円

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	48,730,685,199円
負債総額	2,216,359,439円
純資産総額（ - ）	46,514,325,760円
発行済口数	16,339,112,964口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8468円

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

2021年7月30日現在

資産総額	42,820,573,609円
負債総額	27,200,279円
純資産総額（ - ）	42,793,373,330円
発行済口数	14,596,336,169口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9318円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

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

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

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取扱い

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

第二部【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

2021年7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。

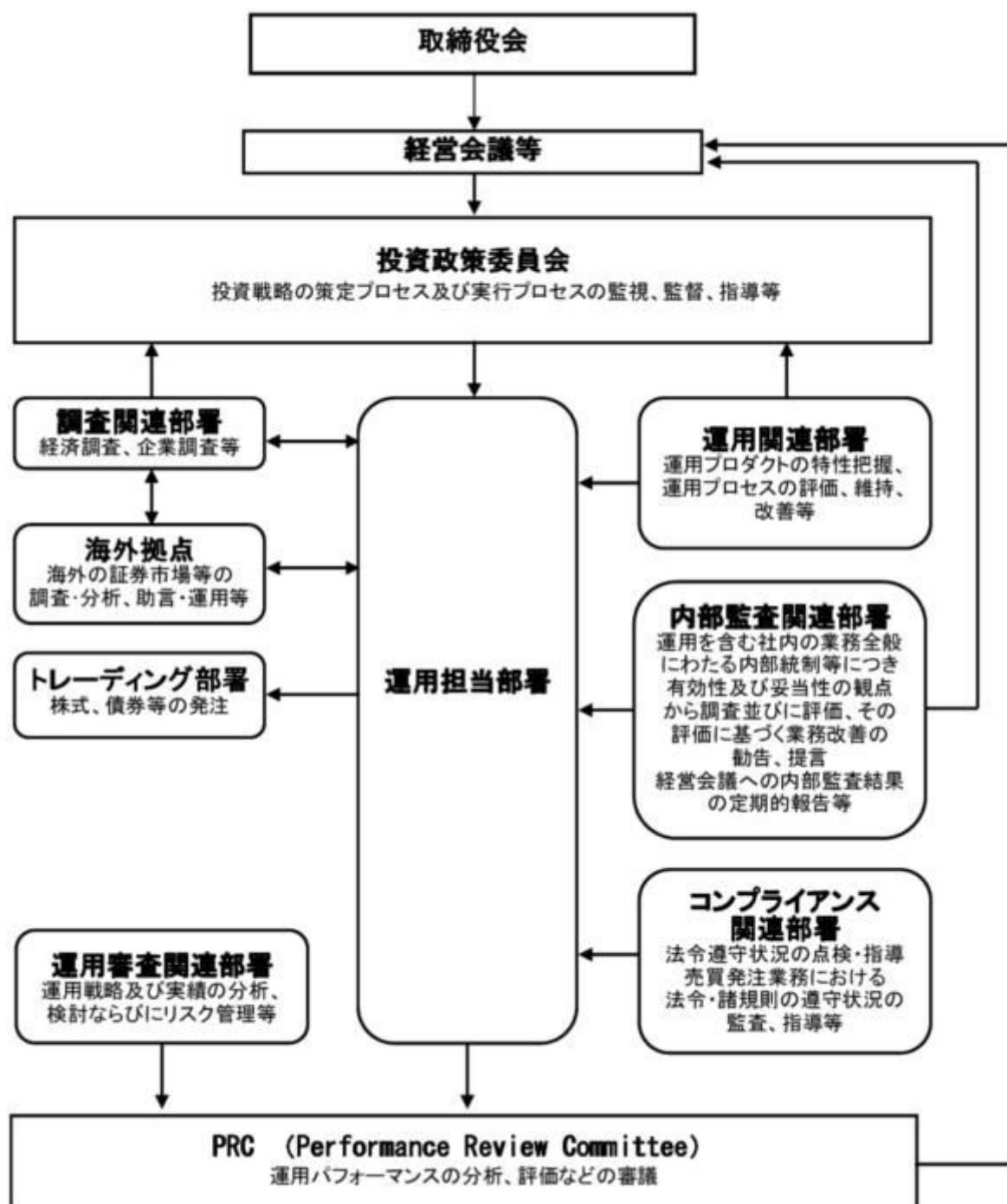
代表取締役・業務執行取締役

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2021年6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	990	38,312,907
単位型株式投資信託	193	814,998
追加型公社債投資信託	14	6,415,715
単位型公社債投資信託	499	1,607,180
合計	1,696	47,150,800

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

		前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
区分	注記 番号	金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		2,626	4,281
金銭の信託		41,524	35,912
有価証券		24,399	30,400
前払費用		106	167
未収入金		522	632
未収委託者報酬		23,936	24,499
未収運用受託報酬		4,336	4,347
その他		71	268
貸倒引当金		14	14
流動資産計		97,509	100,496
固定資産			
有形固定資産		645	2,666
建物	2	295	1,935
器具備品	2	349	731
無形固定資産		5,894	5,429
ソフトウェア		5,893	5,428
その他		0	0
投資その他の資産		16,486	16,487

投資有価証券		1,437		1,767	
関係会社株式		10,171		9,942	
従業員長期貸付金		16		-	
長期差入保証金		329		330	
長期前払費用		19		15	
前払年金費用		1,545		1,301	
繰延税金資産		2,738		3,008	
その他		229		122	
貸倒引当金		0		-	
固定資産計			23,026		24,583
資産合計			120,536		125,080

		前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			157		123
未払金			15,279		16,948
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		3		8	
未払手数料		6,948		7,256	
関係会社未払金		7,262		8,671	
その他未払金		1,063		1,011	
未払費用	1		10,290		9,171
未払法人税等			1,564		2,113
前受収益			26		22
賞与引当金			3,985		3,795
その他			67		-
流動負債計			31,371		32,175
固定負債					
退職給付引当金			3,311		3,299
時効後支払損引当金			572		580
資産除去債務			-		1,371
固定負債計			3,883		5,250
負債合計			35,254		37,425
(純資産の部)					
株主資本			85,270		87,596
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			54,360		56,686
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		53,675		56,001	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		29,069		31,395	
評価・換算差額等			10		57
その他有価証券評価差額金			10		57
純資産合計			85,281		87,654

負債・純資産合計			120,536		125,080
----------	--	--	---------	--	---------

（２）【損益計算書】

		前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
区分	注記 番号	金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		115,736	106,355
運用受託報酬		17,170	16,583
その他営業収益		340	428
営業収益計		133,247	123,367
営業費用			
支払手数料		39,435	34,739
広告宣伝費		1,006	1,005
公告費		-	0
調査費		26,833	24,506
調査費		5,696	5,532
委託調査費		21,136	18,974
委託計算費		1,342	1,358
営業雑経費		5,823	4,149
通信費		75	73
印刷費		958	976
協会費		92	88
諸経費		4,696	3,011
営業費用計		74,440	65,760
一般管理費			
給料		11,418	10,985
役員報酬		109	147
給料・手当		7,173	7,156
賞与		4,134	3,682
交際費		86	35
旅費交通費		391	64
租税公課		1,029	1,121
不動産賃借料		1,227	1,147
退職給付費用		1,486	1,267
固定資産減価償却費		2,348	2,700
諸経費		10,067	10,739
一般管理費計		28,055	28,063
営業利益		30,751	29,542

		前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
区分	注記 番号	金額(百万円)	金額(百万円)

営業外収益					
受取配当金	1	4,936		4,540	
受取利息		0		0	
金銭の信託運用益		-		1,698	
その他		309		447	
営業外収益計			5,246		6,687
営業外費用					
金銭の信託運用損		230		-	
投資事業組合等評価損		146		-	
時効後支払損引当金繰入額		18		13	
為替差損		23		26	
その他		23		32	
営業外費用計			443		72
経常利益			35,555		36,157
特別利益					
投資有価証券等売却益		21		71	
株式報酬受入益		59		48	
移転補償金		-		2,077	
特別利益計			81		2,197
特別損失					
投資有価証券等評価損		119		36	
関係会社株式評価損		1,591		582	
固定資産除却損	2	67		105	
事務所移転費用		-		406	
特別損失計			1,778		1,129
税引前当期純利益			33,858		37,225
法人税、住民税及び事業税			9,896		11,239
法人税等調整額			34		290
当期純利益			23,996		26,276

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月 1 日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株 主 資 本 合 計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金		利 益 剰余金 合 計	
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924
当期変動額									
剰余金の配当							25,650	25,650	25,650
当期純利益							23,996	23,996	23,996

株主資本以外の の項目の当期 変動額（純 額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,653	1,653	1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

[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 6年 附属設備 6～15年 器具備品 4～15年 (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
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。

5．消費税等の会計処理方法 6．連結納税制度の適用	(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。 連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。
---	--

[会計上の見積りに関する注記]

該当事項はありません。

[未適用の会計基準等]

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

(1) 概要

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

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。

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

(1) 概要

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

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2020年3月31日)	当事業年度末 (2021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 1,296百万円	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 1,256百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 761百万円 器具備品 2,347 合計 3,109	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 346百万円 器具備品 643 合計 990

損益計算書関係

前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021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 4,931百万円	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,334百万円
2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソ フ ト ウ エ 59 ア 合計 67	2. 固定資産除却損 器具備品 2百万円 ソ フ ト ウ エ 102 ア 合計 105

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リ

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を

目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	4,281	4,281	-
(2)金銭の信託	35,912	35,912	-
(3)未収委託者報酬	24,499	24,499	-
(4)未収運用受託報酬	4,347	4,347	-
(5)有価証券及び投資有価証券	30,400	30,400	-
その他有価証券	30,400	30,400	-
資産計	99,441	99,441	-
(6)未払金	16,948	16,948	-
未払収益分配金	0	0	-

未払償還金	8	8	-
未払手数料	7,256	7,256	-
関係会社未払金	8,671	8,671	-
その他未払金	1,011	1,011	-
(7)未払費用	9,171	9,171	-
(8)未払法人税等	2,113	2,113	-
負債計	28,233	28,233	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度（自 2019年4月 1 日 至 2020年3月31日）

1．売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2020年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月 1 日 至 2021年3月31日）

1．売買目的有価証券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2021年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2021年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 2019年4月 1 日 至 2020年3月31日)
1．採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。 2．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	57%
株式	24%
生保一般勘定	12%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.6%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、206百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2020年3月31日)	当事業年度末 (2021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 繰延税金資産 百万円 賞与引当金 1,235 退職給付引当金 1,026 関係会社株式評価減 762 未払事業税 285 投資有価証券評価減 462 減価償却超過額 171 時効後支払損引当金 177 関係会社株式売却損 148 ゴルフ会員権評価減 167 未払社会保険料 97 その他 219 繰延税金資産小計 4,754 評価性引当額 1,532 繰延税金資産合計 3,222 繰延税金負債 その他有価証券評価差額金 4 前払年金費用 478 繰延税金負債合計 483 繰延税金資産の純額 2,738	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 繰延税金資産 百万円 賞与引当金 1,176 退職給付引当金 1,022 関係会社株式評価減 784 未払事業税 430 投資有価証券評価減 428 減価償却超過額 223 時効後支払損引当金 179 関係会社株式売却損 148 ゴルフ会員権評価減 135 未払社会保険料 95 その他 341 繰延税金資産小計 4,968 評価性引当額 1,530 繰延税金資産合計 3,437 繰延税金負債 その他有価証券評価差額金 25 前払年金費用 403 繰延税金負債合計 429 繰延税金資産の純額 3,008
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% (調整) 交際費等永久に損金に算入されない項目 0.0% 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 4.4% タックスヘイブン税制 2.6% 外国税額控除 0.7% 外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税 0.2% その他 0.4% 税効果会計適用後の法人税等の負担率 29.1%	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% (調整) 交際費等永久に損金に算入されない項目 0.0% 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 3.5% タックスヘイブン税制 1.9% 外国税額控除 0.5% 外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税 0.2% その他 0.3% 税効果会計適用後の法人税等の負担率 29.4%

資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3．当該資産除去債務の総額の増減

		(単位：百万円)	
		前事業年度	当事業年度
		自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
期首残高		-	-
有形固定資産の取得に伴う増加		-	1,371
時の経過による調整額		-	-
期末残高		-	1,371

セグメント情報等

前事業年度(自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)

1．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

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

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

（イ）子会社等

該当はありません。

（ウ）兄弟会社等

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

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1 株当たり情報

前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
1 株当たり純資産額	16,557円31銭	1 株当たり純資産額	17,018円01銭
1 株当たり当期純利益	4,658円88銭	1 株当たり当期純利益	5,101円61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	23,996百万円	損益計算書上の当期純利益	26,276百万円
普通株式に係る当期純利益	23,996百万円	普通株式に係る当期純利益	26,276百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。		該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

法人等(委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託者

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

* 2021年6月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
株式会社ゆうちょ銀行	3,500,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	

* 2021年6月末現在

2【関係業務の概要】

(1)受託者

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

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1)受託者

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

第3【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
2020年 9月15日	有価証券届出書
2020年 9月15日	有価証券報告書
2021年 3月18日	有価証券届出書の訂正届出書
2021年 3月18日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2021年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀井 純子
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	津村 健二郎
--------------------	-------	--------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	水 永 真太郎
--------------------	-------	---------

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2021年8月6日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 志保

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040の2020年6月23日から2021年6月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040の2021年6月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。