

【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11月30日提出
【計算期間】	第8期(自 2020年9月8日至 2021年9月6日)
【ファンド名】	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
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【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】

国内および外国の各株式、国内、外国および新興国の各債券、国内および外国の各不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象[※]とし、信託財産の成長を目的に運用を行なうことを基本とします。

※ ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド」を親投資信託（「マザーファンド」といいます。）とするファミリーファンド方式で運用します。「実質的な主要投資対象」とは、マザーファンドを通じて投資する、主要な投資対象という意味です。

■信託金の限度額■

受益権の信託金限度額は1兆円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該限度額を変更することができません。

<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）

《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単 位 型	国 内	株 式	インデックス型
	海 外	債 券	
追 加 型		不動産投信	特 殊 型
		その他資産 ()	
	内 外	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 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 () 不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、 債券、不動産投 信)資産配分固定 型)) 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回	グローバル (日本を含む)			
	年2回				
	年4回	日本			日経225
	年6回 (隔月)	北米	ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)	
	年12回 (毎月)	欧州			T O P I X
	日々	アジア			
	その他 ()	オセアニア			
		中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 (合成指数)
		アフリカ			
		中近東 (中東)			
		エマージング			

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産による区分]

- (1)株式…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載

があるものをいう。

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1)グローバル…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載が

あるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

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

〔投資形態による属性区分〕

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

〔為替ヘッジによる属性区分〕

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

〔インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分〕

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

〔特殊型〕

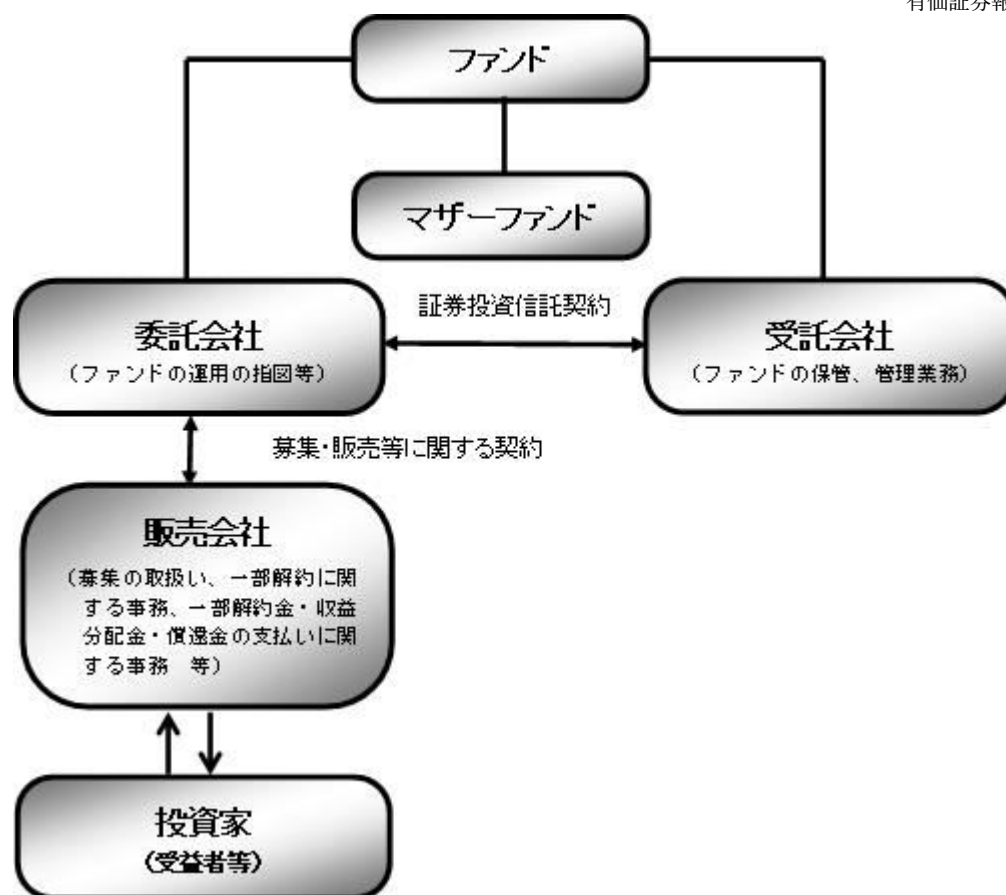
- (1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右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

(2) 【ファンドの沿革】

2013年9月12日

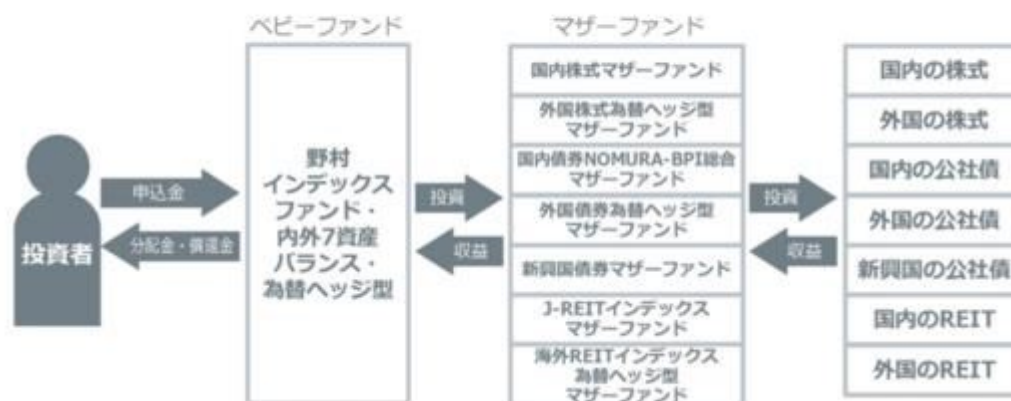
信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



ファンド	野村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
マザーファンド (親投資信託)	国内株式マザーファンド 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド 新興国債券マザーファンド J-REITインデックス マザーファンド 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド
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10月末現在)■

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日

野村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】

〔1〕 ファンドにおける各マザーファンドへの投資比率は、以下を基本（「基本投資割合」といいます。）とし、原則として毎月、リバランスを行ない、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

マザーファンド名	基本投資割合	主要投資対象	対象指数
①国内株式マザーファンド	1/6	わが国の株式	東証株価指数 (TOPIX)
②外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	1/6	外国の株式	MSCI-KOKUSAI 指数 (円ベース・為替ヘッジあり)
③国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	1/9	わが国の公社債	NOMURA-BPI総合
④外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	1/9	外国の公社債	FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)
⑤新興国債券マザーファンド	1/9	新興国の公社債	JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円ヘッジベース) *
⑥J-REITインデックス マザーファンド	1/6	J-REIT ^{※1}	東証REIT指数 (配当込み)
⑦海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	1/6	日本を除く世界各国のREIT ^{※2}	S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円ヘッジ)

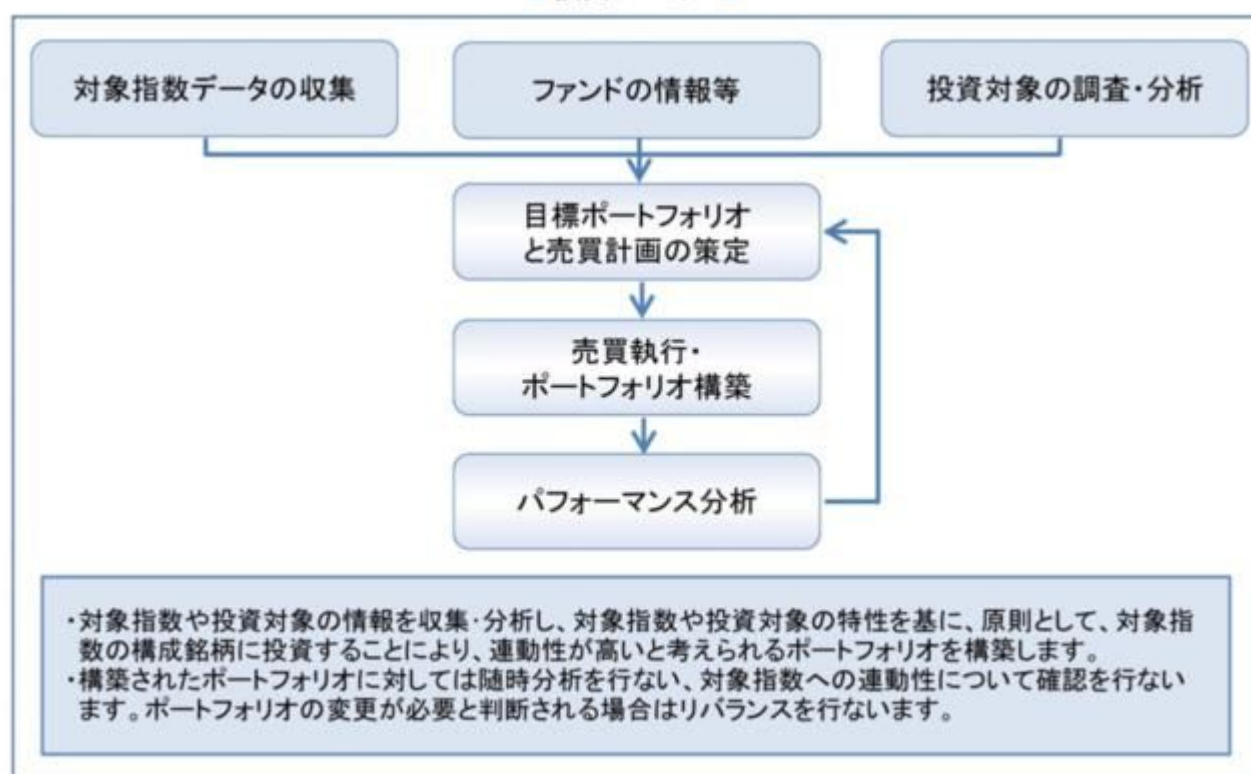
※1 わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。

※2 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。

* JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus (USドルベース) をもとに、委託会社が為替ヘッジコストを考慮して算出したものです。

（新興国債券マザーファンドは「JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（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が、ファンドにおいては、原則として基本投資割合の範囲で為替予約取引等を行ない、「JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジベース）」に連動する投資成果を目指します。）

■投資プロセス■



* 上記の投資プロセスは、今後変更となる場合があります。

[2] 合成指数の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、有価証券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。

[3] 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないます。

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。

■各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について■

○東証株価指数 (TOPIX)

- ①TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱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㈱東京証券取引所が有します。
- ②㈱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。
- ③㈱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。
- ④㈱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㈱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。
- ⑤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。
- ⑥本ファンドは、㈱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ありません。
- ⑦㈱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。
- ⑧㈱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。
- ⑨以上の項目に限らず、㈱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 (円ベース・為替ヘッジあり)

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

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

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

○NOMURA-BPI総合

NOMURA-BPI 総合は、野村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、円ヘッジ・円ベース）

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）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・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジベース）

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・エー、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REIT指数（配当込み）

- ①東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「**㈱東京証券取引所**」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利及び東証REIT指数の商標に関するすべての権利は**㈱東京証券取引所**が有します。
- ②**㈱東京証券取引所**は、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができるものとします。
- ③**㈱東京証券取引所**は、東証REIT指数の商標の使用もしくは東証REIT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。
- ④**㈱東京証券取引所**は、東証REIT指数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**㈱東京証券取引所**は、東証REIT指数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。
- ⑤本ファンドは、東証REIT指数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REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。
- ⑥本ファンドは、**㈱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ありません。**㈱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。
- ⑦**㈱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REIT指数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。
- ⑧以上の項目に限らず、**㈱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（除く日本、配当込み、円ヘッジ）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

（２）【投資対象】

国内および外国の各株式、国内、外国および新興国の各債券、国内および外国の各不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド」各受益証券を主要投資対象とします。

■各マザーファンドの主要投資対象■

マザーファンド名	主要投資対象
国内株式マザーファンド	わが国の株式
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	外国の株式
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	わが国の公社債
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	外国の公社債
新興国債券マザーファンド	新興国の公社債
J-REITインデックス マザーファンド	J-REIT
海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	日本を除く世界各国のREIT

① 投資の対象とする資産の種類(信託約款)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ 有価証券

ロ デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後述の「（５）投資制限④、⑤、⑧および⑩」に定めるものに限ります。）に係る権利

ハ 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ 金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

- 2 次に掲げる特定資産以外の資産

イ 為替手形

ロ 次に掲げるものをすべてみだす資産

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

② 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親投資信託である国内株式マザーファンド、外国株式為替ヘッジ型マザーファンド、国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド、外国債券為替ヘッジ型マザーファンド、新興国債券マザーファンド、J-REITインデックス マザーファンド、および海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド（以下「各マザーファンド」といいます。）受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資するこ

とを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。)
6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 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。

③ 金融商品の指図範囲等(信託約款)

委託者は、信託金を、上記「②有価証券の指図範囲等」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②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②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②第13号に定める証券または証書を除きます。なお、上記②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②各号以外のもの

④ その他の投資対象

1 先物取引等

2 スワップ取引

3 金利先渡取引^{※1}

4 為替先渡取引^{※2}

5 直物為替先渡取引^{※3}

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

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

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

(参考)各マザーファンドの概要**（国内株式マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針**

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法**(1) 投資対象**

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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

- ① 株式への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資は行ないません。
- ③ 同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ④ 有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。
- ⑤ スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。
- ⑥ 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。
- ⑦ 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。

**（外国株式為替ヘッジ型マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針**

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法**(1) 投資対象**

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① 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・為替ヘッジあり）の動きに連動する投資成果を目指します。
- ② 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないます。
- ③ MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、株価指数先物取引等のデリバティブ取引ならびに為替予約取引をヘッジ目的外の利用も含め活用する場合があります。
- ④ 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

- ① 株式への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③ 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。
- ④ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ⑤ 外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
- ⑥ 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。
- ⑦ 同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ⑧ 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。
- ⑨ 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。
※転換社債型新株予約権付社債とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）をいいます。
- ⑩ 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。
- ⑪ 前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 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。

② 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

① 株式への投資は行ないません。

② 外貨建資産への投資は行ないません。

③ 有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

④ スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的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。

⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（外国債券為替ヘッジ型マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

② 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないます。

③ 効率的な運用を行なうため、債券先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用を含め活用する場合があります。

④ 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

① 株式への投資は行ないません。

② 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

- ③ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ④ 外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（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

新興国の公社債を主要投資対象とします。

（2）投資態度

- ① 新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（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、一部ローンに投資する場合があります。
- ② 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。
- ③ 投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）を含む市況動向や、その他資金動向等によっては、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

- ① 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ② デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ③ 外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。
- ④ 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。
- ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(J-REITインデックス マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

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

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

(2) 投資態度

① 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。

② 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

① 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

② 外貨建資産への直接投資は行ないません。

③ 株式への直接投資は行ないません。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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。

⑦ 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インデックス為替ヘッジ型マザーファンド)

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ)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

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

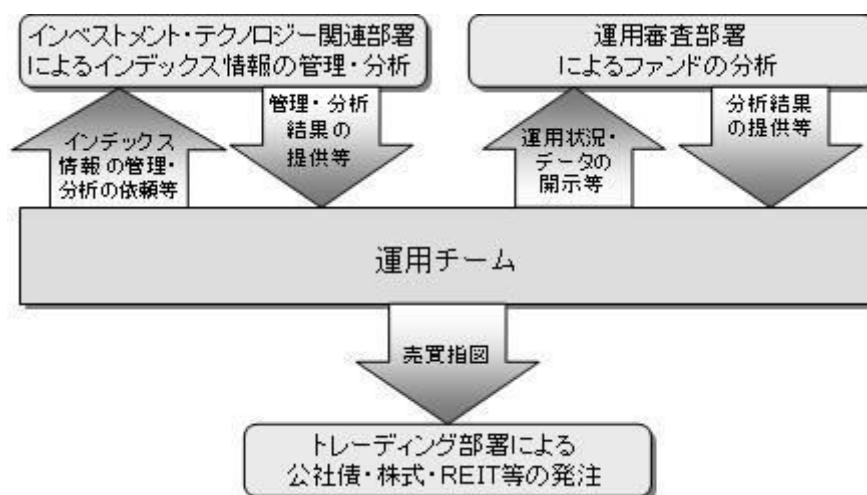
- ① 日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
- ② 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないます。
- ③ 効率的な運用を行なうため、REIT指数先物取引、株価指数先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用を含め活用する場合があります。
- ④ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

- ① 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ② 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ④ 外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。
- ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的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。
- ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(3) 【運用体制】

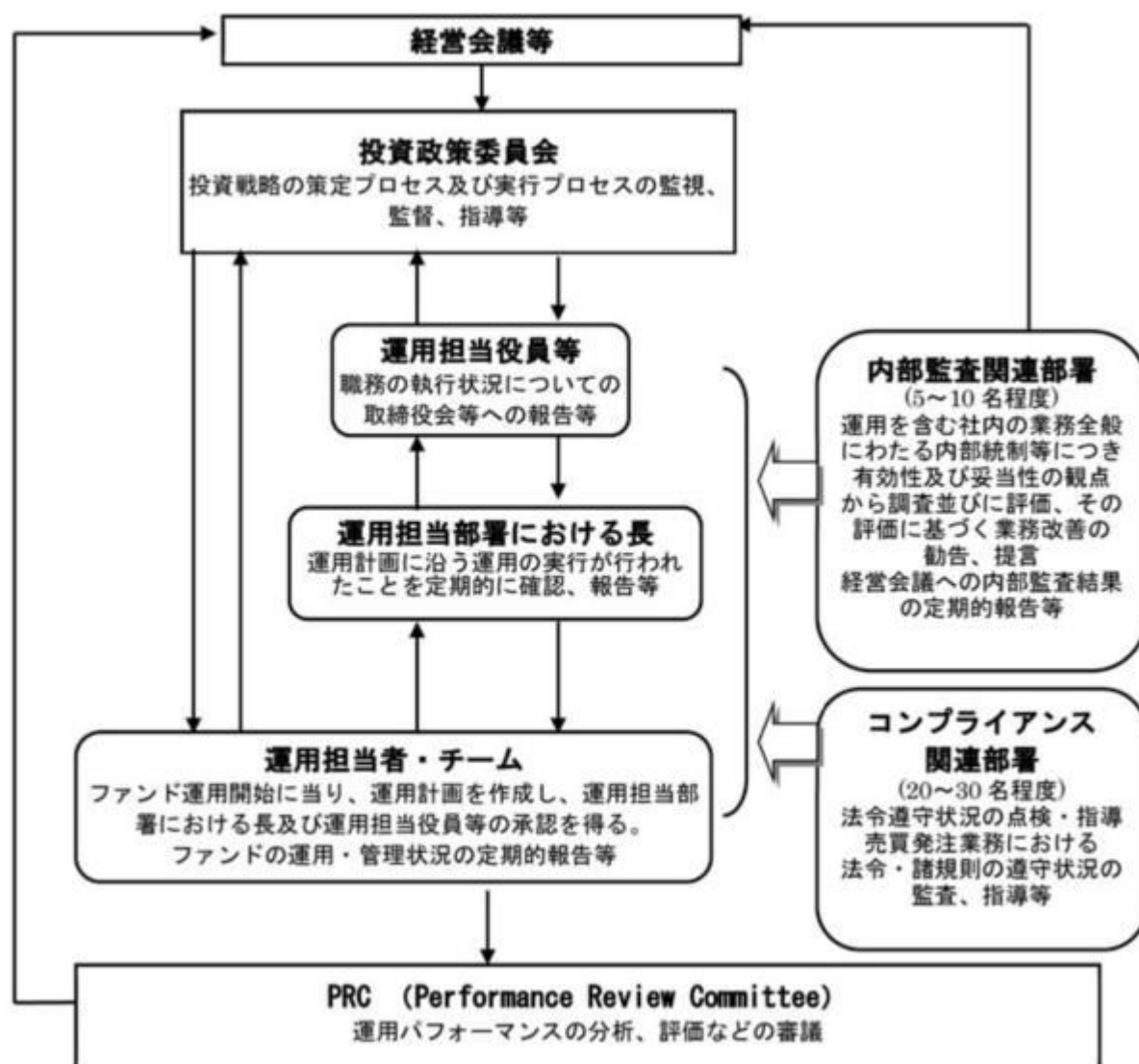
ファンドの運用体制は以下の通りです。



※運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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



《委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等》

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

- ① 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。
- ② 収益分配金額は、利子・配当等収益等を中心として基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。

- ③ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

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

◆ファンドの決算日

原則として毎年9月6日（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

（５）【投資制限】

①運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限(信託約款)

- ・ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 外国為替予約取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ・ 同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ・ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ・ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。
- ・ 前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一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。

②投資する株式等の範囲(信託約款)

(i) 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。

(ii) 上記(i)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。

③信用取引の指図範囲(信託約款)

(i) 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。

(ii) 上記(i)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

④先物取引等の運用指図(信託約款)

(i) 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。）。

(ii) 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。

(iii) 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。

⑤スワップ取引の運用指図(信託約款)

(i) 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（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。

(ii) 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。

(iii) 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。

(iv) 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。

⑥有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

(i) 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。

(ii) 上記(i)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。

(iii) 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。

⑦公社債の借入れ(信託約款)

(i) 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。

(ii) 上記(i)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。

(iii) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ii)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。

(iv) 上記(i)の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

⑧金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

(i) 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。

(ii) 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。

(iii) 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。

(iv) 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。

⑨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。）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。

⑩直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

(i) 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。

(ii) 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。

(iii) 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。

(iv) 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。

⑪資金の借入れ(信託約款)

(i) 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。

(ii)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。

(iii)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。

(iv)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑫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(i)の数が(ii)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。

(i)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

(ii)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。

[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により為替変動リスクの低減を図ることを基本としますが、為替変動リスクを完全に排除できるわけではありません。また、円金利がヘッジ対象通貨の金利より低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかるため、基準価額の変動要因となります。

※ 基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

《その他の留意点》

- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
 - 資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。
 - ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。
 - 有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。
 - ファンドの基準価額と対象指数（合成指数）は、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。また、ファンドの投資成果が合成指数に連動または上回ることを保証するものではありません。
 - 投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
 - ファンドが実質的な投資対象とするREITの中には、流動性の低いものもあり、こうしたREITへの投資は、流動性の高い株式等に比べて制約を受けることが想定されます。
 - REITに関する法律（税制度、会計制度等）、不動産を取り巻く規制が変更となった場合、REITの価格や配当に影響が及ぶことが想定されます。
 - ファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国においては、政治、経済、社会情勢の変化が金融市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、当局による海外からの投資規制などが緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により、金融市場が著しい悪影響を被る可能性や運用上の制約を大きく受ける可能性があります。
 - 金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、投資信託約款の規定に従い、委託会社の判断でファンドの購入・換金の各受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた購入・換金の各受け付けを取り消す場合があります。
 - ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。
- 投資者の個別元本（追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本）の状況によっては、分配金額の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。
- 分配金は、預貯金の利息とは異なりファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後の純資産はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中に運用収益があった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行なった場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

《委託会社におけるリスクマネジメント体制》

リスク管理関連の委員会

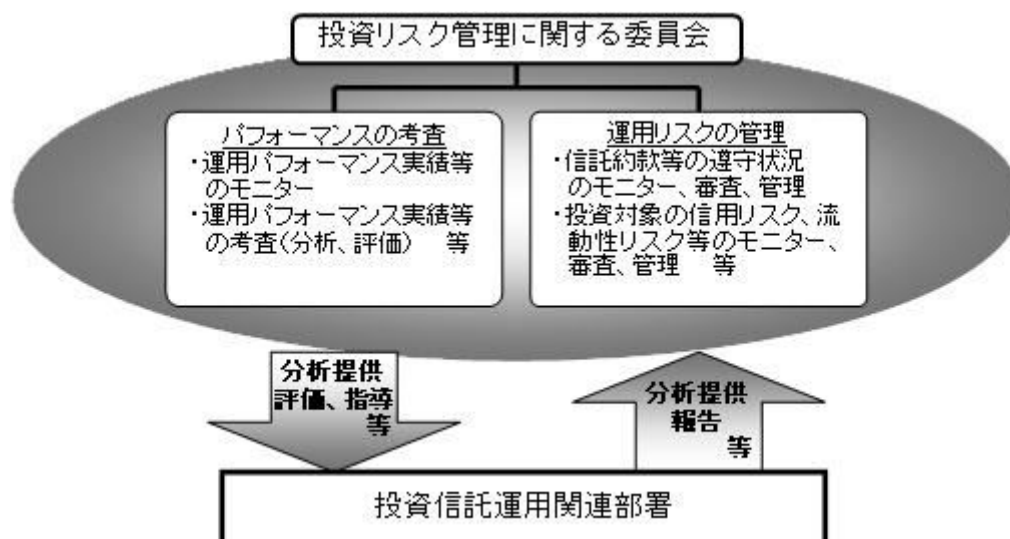
◆パフォーマンスの考査

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

◆運用リスクの管理

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

リスク管理体制図



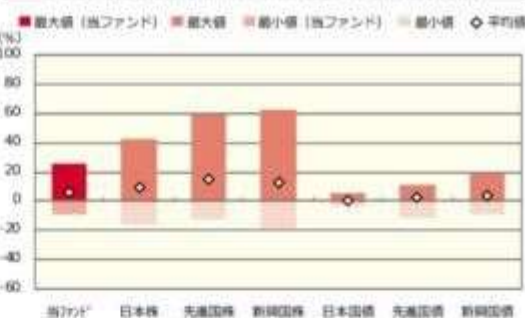
※投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

■ リスクの定量的比較（2016年10月末～2021年9月末：月次）

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	25.2	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	9.1	16.0	12.4	19.4	4.0	11.4	9.4
平均値 (%)	5.5	9.5	14.4	13.2	0.3	2.7	3.8

- * 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。2016年10月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2016年10月から2021年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- * 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10月から2021年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

＜代表的な資産クラスの指数＞

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

■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
- MSCI-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
- JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）」（ここでは「指数」と呼びます）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パレーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを予測するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあります。また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMS LLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての提供、保障または販売促進を行います。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
- JPMS LLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JP Morgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPMI, 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】

- ① 取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率）（税抜2.0%）以内[※]で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。
- ※詳しくは、販売会社にお問い合わせ下さい。なお、販売会社については、「サポートダイヤル」までお問い合わせ下さい。
- ② 収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.55%(税抜年0.50%)以内(2021年11月30日現在 年0.55%(税抜年0.50%))の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り(税抜)とします。

＜委託会社＞	＜販売会社＞	＜受託会社＞
年0.23%	年0.23%	年0.04%

※上記配分は、2021年11月30日現在の信託報酬率における配分です。

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。

《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】

- ① 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信託財産から支払われます。
- ② ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（信託財産に属する資産のデフォルト等の発生に伴う債権回収に要する弁護士費用等を含みます。）および受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。
- ③ 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信託財産から支払われます。
- ④ 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信託財産中から支払われます。

- ⑤ ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額[※]をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.2%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

■個人、法人別の課税について■

◆個人の投資家に対する課税

<収益分配金に対する課税>

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

なお、配当控除は適用されません。

<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》
^(注1) ・特定公社債の利子 ・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

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。

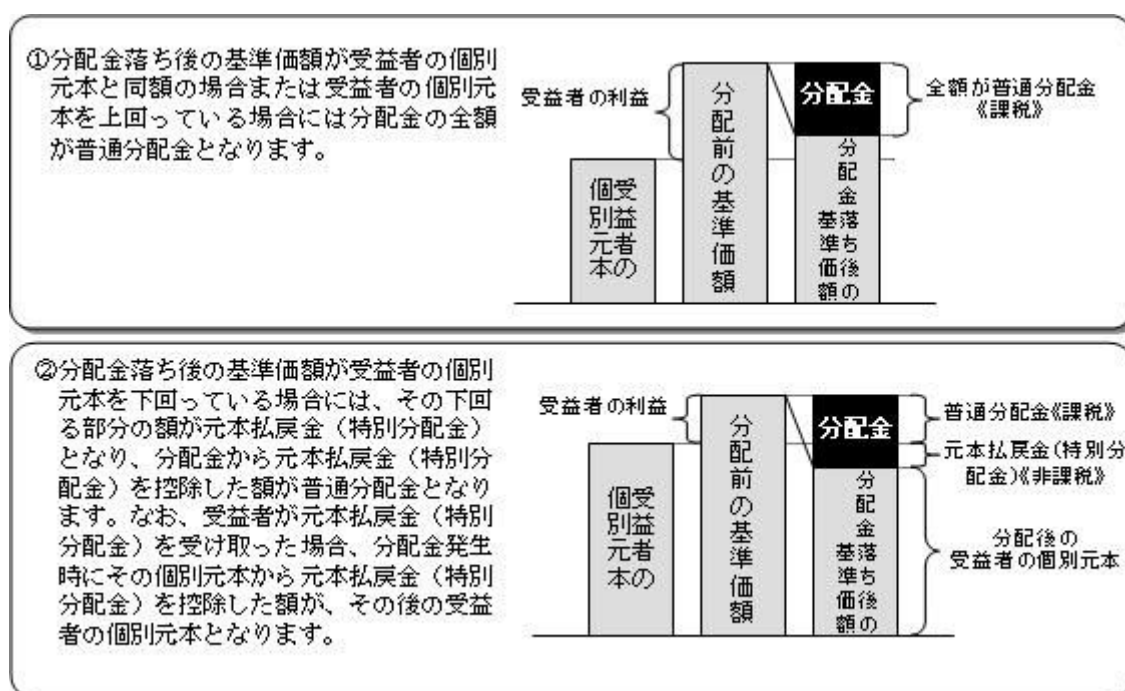
■個別元本について■

◆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。

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9月末現在）が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は2021年9月30日現在の運用状況であります。

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

（１）【投資状況】

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

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	17,122,551,086	99.92
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	12,908,974	0.07
合計（純資産総額）		17,135,460,060	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	405,693,587,950	96.63
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	14,141,635,146	3.36
合計（純資産総額）		419,835,223,096	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	10,964,700,000	2.61

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	60,370,710,375	68.85
	カナダ	2,917,430,945	3.32
	ドイツ	2,397,646,859	2.73

	イタリア	636,522,351	0.72
	フランス	2,870,333,877	3.27
	オランダ	1,328,899,117	1.51
	スペイン	631,694,120	0.72
	ベルギー	214,549,083	0.24
	オーストリア	55,932,910	0.06
	ルクセンブルグ	43,373,474	0.04
	フィンランド	271,490,249	0.30
	アイルランド	188,164,322	0.21
	ポルトガル	49,887,511	0.05
	イギリス	3,728,501,088	4.25
	スイス	2,504,024,614	2.85
	スウェーデン	954,889,024	1.08
	ノルウェー	171,806,664	0.19
	デンマーク	694,585,583	0.79
	オーストラリア	1,651,133,873	1.88
	ニュージーランド	61,765,610	0.07
	香港	709,594,862	0.80
	シンガポール	233,035,191	0.26
	イスラエル	99,601,726	0.11
	小計	82,785,573,428	94.42
投資証券	アメリカ	1,647,697,479	1.87
	カナダ	9,524,894	0.01
	フランス	39,840,931	0.04
	イギリス	50,725,537	0.05
	オーストラリア	120,949,081	0.13
	香港	31,453,374	0.03
	シンガポール	35,772,496	0.04
	小計	1,935,963,792	2.20
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	2,952,455,272	3.36
合計（純資産総額）		87,673,992,492	100.00

その他の資産の投資状況

※その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,772,886,155	4.30
	買建	カナダ	168,890,241	0.19
	買建	ドイツ	527,621,174	0.60
	買建	イギリス	234,144,293	0.26
	買建	スイス	153,467,976	0.17
	買建	オーストラリア	86,607,144	0.09

（参考）国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	642,679,400,150	80.13
地方債証券	日本	54,135,572,868	6.75
特殊債券	日本	63,739,466,763	7.94
社債券	日本	34,443,276,800	4.29
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	6,950,901,446	0.86
合計（純資産総額）		801,948,618,027	100.00

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	39,354,533,145	45.93
	カナダ	1,724,791,527	2.01
	メキシコ	613,457,363	0.71
	ドイツ	5,883,283,417	6.86
	イタリア	8,477,256,247	9.89
	フランス	8,420,298,639	9.82
	オランダ	1,609,070,272	1.87
	スペイン	5,556,016,575	6.48
	ベルギー	1,930,176,602	2.25
	オーストリア	1,240,283,615	1.44
	フィンランド	539,156,153	0.62
	アイルランド	749,563,512	0.87
	イギリス	5,140,457,793	6.00
	スウェーデン	257,831,935	0.30
	ノルウェー	151,220,908	0.17
	デンマーク	419,949,662	0.49
	ポーランド	470,853,946	0.54
	オーストラリア	1,577,846,529	1.84
	シンガポール	709,426,049	0.82
	イスラエル	402,732,360	0.47
	小計	85,228,206,249	99.48
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	442,706,153	0.51
合計（純資産総額）		85,670,912,402	100.00

（参考）新興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	26,288,257,929	98.19
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	484,245,401	1.80
合計（純資産総額）		26,772,503,330	100.00

（参考）J－R E I T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	43,596,794,200	97.09
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,303,913,915	2.90
合計（純資産総額）		44,900,708,115	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	1,300,320,000	2.89

（参考）海外R E I Tインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	5,256,302,074	74.89
	カナダ	137,872,116	1.96
	ドイツ	18,170,660	0.25
	イタリア	2,164,376	0.03
	フランス	136,018,065	1.93
	オランダ	11,988,337	0.17
	スペイン	28,866,814	0.41
	ベルギー	92,586,154	1.31
	アイルランド	7,659,143	0.10
	シンガポール	3,916,578	0.05
	イギリス	396,277,327	5.64
	オーストラリア	471,805,243	6.72
	ニュージーランド	28,266,428	0.40
	香港	100,092,852	1.42
	シンガポール	228,491,915	3.25
	韓国	11,621,110	0.16

	イスラエル	5,005,094	0.07
	小計	6,937,104,286	98.84
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	80,836,467	1.15
合計（純資産総額）		7,017,940,753	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	207,734,712	2.96

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

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

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	1,402,937,591	2.1377	2,999,059,689	2.1426	3,005,934,082	17.54
2	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	1,020,549,707	2.8635	2,922,382,073	2.7505	2,807,021,969	16.38
3	日本	親投資信託受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	1,006,313,717	2.8889	2,907,181,815	2.7777	2,795,237,611	16.31
4	日本	親投資信託受益証券	海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	1,613,108,317	1.8366	2,962,640,069	1.7322	2,794,226,226	16.30
5	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	1,450,586,194	1.3320	1,932,314,691	1.3296	1,928,699,403	11.25
6	日本	親投資信託受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	1,563,071,691	1.2330	1,927,367,234	1.2186	1,904,759,162	11.11
7	日本	親投資信託受益証券	新興国債券マザーファンド	899,186,271	2.1215	1,907,623,674	2.0982	1,886,672,633	11.01

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	99.92
合 計	99.92

（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	7,384,700	1,712.44	12,645,927,780	2,000.00	14,769,400,000	3.51
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	913,300	10,789.70	9,854,233,010	12,455.00	11,375,151,500	2.70

3	日本	株式	キーエンス	電気機器	143,100	53,684.02	7,682,183,262	67,000.00	9,587,700,000	2.28
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,135,200	10,020.45	11,375,214,840	6,480.00	7,356,096,000	1.75
5	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	997,900	5,280.19	5,269,101,601	6,832.00	6,817,652,800	1.62
6	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,836,300	608.08	5,981,263,636	657.90	6,471,301,770	1.54
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,673,300	2,856.61	4,779,965,513	3,085.00	5,162,130,500	1.22
8	日本	株式	信越化学工業	化学	264,000	18,564.06	4,900,911,840	18,900.00	4,989,600,000	1.18
9	日本	株式	HOYA	精密機器	284,500	13,261.08	3,772,777,260	17,475.00	4,971,637,500	1.18
10	日本	株式	日立製作所	電気機器	700,900	5,422.88	3,800,896,592	6,640.00	4,653,976,000	1.10
11	日本	株式	ダイキン工業	機械	185,700	23,063.62	4,282,914,234	24,460.00	4,542,222,000	1.08
12	日本	株式	任天堂	その他製品	83,400	62,231.71	5,190,124,614	54,310.00	4,529,454,000	1.07
13	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,212,900	3,729.21	4,523,158,809	3,699.00	4,486,517,100	1.06
14	日本	株式	日本電産	電気機器	350,900	12,490.95	4,383,074,355	12,420.00	4,358,178,000	1.03
15	日本	株式	村田製作所	電気機器	428,300	8,692.42	3,722,963,486	9,960.00	4,265,868,000	1.01
16	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	85,400	49,845.63	4,256,816,802	49,670.00	4,241,818,000	1.01
17	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,147,200	3,446.95	3,954,341,040	3,691.00	4,234,315,200	1.00
18	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,147,900	3,431.73	3,939,282,867	3,455.00	3,965,994,500	0.94
19	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	995,100	3,965.32	3,945,889,932	3,944.00	3,924,674,400	0.93
20	日本	株式	第一三共	医薬品	1,145,700	2,897.19	3,319,310,583	2,979.50	3,413,613,150	0.81
21	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,004,300	3,547.47	3,562,724,121	3,277.00	3,291,091,100	0.78
22	日本	株式	ファナック	電気機器	127,900	26,512.26	3,390,918,054	24,565.00	3,141,863,500	0.74
23	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,953,900	1,622.75	3,170,691,225	1,584.50	3,095,954,550	0.73
24	日本	株式	三菱商事	卸売業	874,200	3,014.45	2,635,232,190	3,536.00	3,091,171,200	0.73
25	日本	株式	SMC	機械	42,700	65,275.79	2,787,276,233	70,080.00	2,992,416,000	0.71
26	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	561,700	4,719.39	2,650,881,363	5,085.00	2,856,244,500	0.68
27	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	473,600	5,463.06	2,587,305,216	6,021.00	2,851,545,600	0.67
28	日本	株式	三井物産	卸売業	1,114,900	2,535.65	2,826,996,185	2,464.00	2,747,113,600	0.65
29	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	148,200	15,308.55	2,268,727,110	18,130.00	2,686,866,000	0.63
30	日本	株式	富士通	電気機器	131,200	16,905.89	2,218,052,768	20,310.00	2,664,672,000	0.63

種類別及び業種別投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.19
		建設業	2.23
		食料品	3.31
		繊維製品	0.45
		パルプ・紙	0.21
		化学	6.81
		医薬品	4.98
		石油・石炭製品	0.39

	ゴム製品	0.69
	ガラス・土石製品	0.74
	鉄鋼	0.78
	非鉄金属	0.64
	金属製品	0.58
	機械	5.18
	電気機器	17.96
	輸送用機器	7.43
	精密機器	2.87
	その他製品	2.12
	電気・ガス業	1.10
	陸運業	3.18
	海運業	0.46
	空運業	0.47
	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	8.15
	卸売業	4.60
	小売業	4.34
	銀行業	4.84
	証券、商品先物取引業	0.71
	保険業	1.95
	その他金融業	1.10
	不動産業	1.93
	サービス業	5.82
合 計		96.63

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

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	232,860	14,544.33	3,386,793,963	15,985.53	3,722,391,354	4.24
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェ ア	99,820	28,240.18	2,818,935,521	31,785.28	3,172,806,650	3.61
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信販 売	6,335	369,060.98	2,338,001,355	369,461.35	2,340,537,655	2.66
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	33,430	35,630.83	1,191,138,975	38,009.15	1,270,645,925	1.44
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	4,199	263,128.62	1,104,877,109	300,736.87	1,262,794,136	1.44

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	4,066	267,835.75	1,089,020,168	301,111.80	1,224,320,605	1.39
7	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	11,434	75,336.10	861,393,060	87,444.21	999,837,157	1.14
8	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	34,800	16,659.97	579,767,000	22,962.62	799,099,399	0.91
9	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	42,260	18,032.55	762,055,580	18,573.12	784,900,220	0.89
10	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	36,780	18,870.40	694,053,425	18,357.11	675,174,815	0.77
11	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	23,640	25,924.47	612,854,502	25,370.02	599,747,405	0.68
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	13,141	46,724.36	614,004,836	44,813.88	588,899,292	0.67
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	18,540	32,539.62	603,284,570	31,034.29	575,375,863	0.65
14	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	14,910	37,933.04	565,581,710	37,709.20	562,244,256	0.64
15	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	40,260	13,082.52	526,702,398	13,481.70	542,773,435	0.61
16	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	34,100	15,142.77	516,368,661	15,894.87	542,015,353	0.61
17	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	107,610	4,717.42	507,642,427	4,820.39	518,722,641	0.59
18	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	5,862	70,582.01	413,751,767	84,110.32	493,054,708	0.56
19	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	25,390	20,665.68	524,701,688	19,326.34	490,695,915	0.55
20	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	12,360	41,926.93	518,216,909	39,529.02	488,578,747	0.55
21	アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	情報技術サービス	15,600	28,350.01	442,260,158	28,987.28	452,201,568	0.51
22	アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア	6,681	54,799.29	366,114,094	64,656.18	431,967,965	0.49
23	アメリカ	株式	NETFLIX INC	娯楽	6,200	56,366.89	349,474,730	67,046.79	415,690,130	0.47
24	アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア	13,580	24,327.68	330,369,927	30,274.36	411,125,809	0.46
25	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	64,100	6,501.69	416,758,455	6,259.68	401,245,847	0.45
26	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	9,821	36,391.01	357,396,179	40,525.43	398,000,287	0.45
27	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	59,210	6,969.64	412,672,957	6,701.76	396,811,778	0.45
28	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	78,260	4,438.06	347,322,990	4,871.87	381,273,141	0.43
29	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	58,930	5,980.34	352,421,721	6,209.32	365,915,322	0.41
30	アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	ライフサイエンス・ツール/サービス	5,454	52,389.75	285,733,708	64,868.83	353,794,610	0.40

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	4.71
		メディア	1.07
		娯楽	1.50
		不動産管理・開発	0.38
		エネルギー設備・サービス	0.14
		石油・ガス・消耗燃料	3.10

化学	1.99
建設資材	0.24
容器・包装	0.27
金属・鉱業	1.27
紙製品・林産品	0.10
航空宇宙・防衛	1.44
建設関連製品	0.60
建設・土木	0.21
電気設備	0.85
コングロマリット	1.08
機械	1.61
商社・流通業	0.31
商業サービス・用品	0.43
航空貨物・物流サービス	0.59
旅客航空輸送業	0.05
海運業	0.08
陸運・鉄道	0.99
運送インフラ	0.12
自動車部品	0.24
自動車	1.81
家庭用耐久財	0.34
レジャー用品	0.06
繊維・アパレル・贅沢品	1.40
ホテル・レストラン・レジャー	1.84
販売	0.09
インターネット販売・通信販売	3.28
複合小売り	0.48
専門小売り	1.70
食品・生活必需品小売り	1.35
飲料	1.51
食品	1.49
タバコ	0.64
家庭用品	1.05
パーソナル用品	0.59
ヘルスケア機器・用品	3.00
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.86
バイオテクノロジー	1.71
医薬品	4.44
銀行	6.02
各種金融サービス	0.87
保険	2.93
情報技術サービス	4.41

		ソフトウェア	7.62
		通信機器	0.67
		コンピュータ・周辺機器	4.51
		電子装置・機器・部品	0.53
		半導体・半導体製造装置	4.50
		各種電気通信サービス	1.32
		無線通信サービス	0.26
		電力	1.61
		ガス	0.13
		総合公益事業	0.76
		水道	0.10
		消費者金融	0.50
		資本市場	3.19
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.08
		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	1.16
		専門サービス	0.78
投資証券	—	—	2.20
合 計			96.63

（参考）国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 62回	9,800,000,000	100.28	9,827,670,000	100.47	9,846,158,000	0.1	2031/3/20	1.22
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	100.90	9,585,500,000	0.1	2026/6/20	1.19
3	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	100.87	8,624,727,000	0.1	2026/3/20	1.07
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 51回	8,500,000,000	100.90	8,576,500,000	101.01	8,585,935,000	0.1	2028/6/20	1.07
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	100.32	8,527,455,000	0.1	2023/3/20	1.06
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	100.59	8,450,148,000	0.1	2030/12/20	1.05
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	100.71	7,956,564,000	0.1	2030/9/20	0.99
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	101.71	7,425,268,000	0.3	2025/12/20	0.92
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 50回	7,150,000,000	100.97	7,219,860,000	101.03	7,224,217,000	0.1	2028/3/20	0.90
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 44回	6,900,000,000	100.99	6,968,310,000	100.92	6,963,687,000	0.1	2026/9/20	0.86

11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第42 7回	6,800,000,000	100.26	6,817,956,000	100.23	6,816,184,000	0.005	2023/8/1	0.84
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 52回	6,700,000,000	100.96	6,764,658,000	101.01	6,767,871,000	0.1	2028/9/20	0.84
13	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	101.96	6,729,558,000	0.6	2024/6/20	0.83
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (40年)第1 3回	7,020,000,000	93.56	6,568,409,500	92.26	6,476,722,200	0.5	2060/3/20	0.80
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 57回	6,440,000,000	98.57	6,347,908,000	99.14	6,385,195,600	0.2	2036/6/20	0.79
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 63回	6,350,000,000	100.62	6,389,931,500	100.33	6,371,399,500	0.1	2031/6/20	0.79
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 56回	6,150,000,000	101.40	6,236,170,500	102.16	6,283,147,500	0.4	2036/3/20	0.78
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 3回	6,070,000,000	100.87	6,123,123,200	100.73	6,114,311,000	0.1	2025/3/20	0.76
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	6,000,000,000	102.08	6,124,860,000	101.57	6,094,440,000	0.8	2023/6/20	0.75
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 76回	6,020,000,000	101.04	6,082,701,300	101.16	6,090,193,200	0.5	2041/3/20	0.75
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	5,900,000,000	102.02	6,019,180,000	101.59	5,993,810,000	0.6	2023/12/20	0.74
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 5回	5,900,000,000	100.94	5,955,622,000	100.81	5,948,203,000	0.1	2025/9/20	0.74
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 55回	5,350,000,000	110.10	5,890,403,500	110.60	5,917,207,000	1	2035/12/20	0.73
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 48回	5,800,000,000	100.94	5,854,520,000	101.04	5,860,842,000	0.1	2027/9/20	0.73
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 8回	5,700,000,000	100.53	5,730,670,000	100.42	5,724,282,000	0.005	2026/6/20	0.71
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 59回	5,600,000,000	100.32	5,617,920,000	100.78	5,643,848,000	0.1	2030/6/20	0.70
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 75回	5,500,000,000	100.42	5,523,385,000	101.33	5,573,260,000	0.5	2040/12/20	0.69
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 8回	5,500,000,000	100.66	5,536,795,000	100.48	5,526,895,000	0.1	2023/12/20	0.68
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 7回	5,500,000,000	100.56	5,531,285,000	100.43	5,523,870,000	0.1	2023/9/20	0.68
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 58回	5,470,000,000	100.40	5,491,934,700	100.84	5,516,276,200	0.1	2030/3/20	0.68

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	80.13
地方債証券	6.75
特殊債券	7.94

社債券	4.29
合 計	99.13

(参考) 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,400,000	12,392.51	669,195,896	12,188.34	658,170,894	2.625	2029/2/15	0.76
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,762.81	638,140,700	12,556.89	627,844,955	3.125	2028/11/15	0.73
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,455.18	572,759,330	11,435.07	571,753,785	1.375	2023/9/30	0.66
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	10,589.11	582,401,506	10,394.57	571,701,350	0.625	2030/8/15	0.66
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,438.13	571,906,779	11,412.77	570,638,949	1.375	2023/6/30	0.66
6	イギリス	国債証券	UK TREASURY	2,180,000	25,623.92	558,601,483	24,388.03	531,659,261	4.25	2046/12/7	0.62
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	3,450,000	15,026.57	518,416,685	14,619.11	504,359,377	3.75	2043/11/15	0.58
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	11,033.73	496,518,178	10,818.64	486,838,872	1.125	2031/2/15	0.56
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	11,651.04	489,343,957	11,540.00	484,680,029	1.625	2026/5/15	0.56
10	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,700,000	13,220.79	489,169,595	13,056.64	483,095,822	0	2029/11/25	0.56
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,124.95	484,998,292	12,047.57	481,903,032	2.875	2025/4/30	0.56
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,099.60	483,984,028	12,023.96	480,958,696	2.75	2025/6/30	0.56
13	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,290,000	21,080.38	482,740,737	20,713.62	474,342,029	4.75	2035/4/25	0.55
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,110,000	11,488.84	472,191,730	11,477.91	471,742,502	2	2023/2/15	0.55
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,763.84	470,553,627	11,724.93	468,997,223	2.375	2024/2/29	0.54
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,697.82	467,913,031	11,659.78	466,391,591	2	2024/6/30	0.54
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,030,000	11,904.61	479,755,975	11,545.68	465,291,064	2.25	2046/8/15	0.54
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,650.17	466,006,900	11,529.50	461,180,328	1.625	2026/9/30	0.53
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,511.58	460,463,323	11,397.04	455,881,632	1.375	2026/8/31	0.53
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,180,000	21,071.08	459,349,622	20,897.07	455,556,152	4.75	2044/9/1	0.53
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	12,115.77	460,399,507	11,964.50	454,651,376	2.375	2027/5/15	0.53
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,447.75	457,910,160	11,246.64	449,865,932	1.5	2030/2/15	0.52
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,340.64	453,625,728	11,167.95	446,718,160	1.25	2028/4/30	0.52
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,520,000	13,075.84	460,269,595	12,690.24	446,696,468	2.75	2047/8/15	0.52
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,169.70	446,788,132	11,159.21	446,368,432	0.125	2023/9/15	0.52
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,165.33	446,613,223	11,152.65	446,106,091	0.125	2023/10/15	0.52
27	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,400,000	13,122.35	446,160,002	13,102.87	445,497,716	0.45	2022/10/31	0.52
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,006.19	440,247,795	10,927.50	437,100,023	0.25	2025/10/31	0.51
29	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,720,000	16,075.17	437,244,749	15,861.91	431,443,970	2.5	2030/5/25	0.50
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,800,000	15,769.35	441,541,863	15,354.89	429,937,174	4.25	2040/11/15	0.50

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.48

合 計	99.48
-----	-------

（参考）新興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	RUSSIAN FEDERATION	4,400,000	13,969.51	614,658,820	14,262.80	627,563,420	5.25	2047/6/23	2.34
2	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	14,537,686	3,527.32	512,791,683	3,721.45	541,012,995	1.125	2035/7/9	2.02
3	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	3,600,000	12,529.19	451,051,030	12,494.35	449,796,854	4.25	2027/6/23	1.68
4	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	10,365,309	4,020.41	416,727,988	4,161.29	431,331,345	0.5	2030/7/9	1.61
5	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	3,200,000	12,048.34	385,547,030	11,894.18	380,613,955	7.375	2025/2/5	1.42
6	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	2,800,000	13,264.72	371,412,339	13,479.64	377,430,054	5.1	2035/3/28	1.40
7	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	3,100,000	12,164.58	377,102,129	11,316.79	350,820,515	5.625	2047/2/21	1.31
8	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,900,000	11,760.86	341,065,009	11,498.56	333,458,242	6.375	2025/10/14	1.24
9	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,700,000	12,132.57	327,579,544	11,935.02	322,245,694	7.625	2029/4/26	1.20
10	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,600,000	12,522.08	325,574,161	12,391.44	322,177,612	5	2051/4/27	1.20
11	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,700,000	11,551.46	311,889,479	11,469.33	309,672,120	2.875	2025/6/6	1.15
12	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000	16,308.16	309,855,164	16,280.31	309,326,053	6.75	2044/1/15	1.15
13	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	2,000,000	15,079.09	301,581,815	15,367.62	307,352,466	5.625	2050/11/18	1.14
14	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	1,750,000	17,662.37	309,091,563	17,404.33	304,575,854	9.5	2030/2/2	1.13
15	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,400,000	12,628.71	303,089,209	12,651.49	303,635,826	4.15	2027/3/28	1.13
16	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	6,886,159	4,290.33	295,439,593	4,373.72	301,181,428	2	2038/1/9	1.12
17	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,750,000	16,813.60	294,238,172	16,688.59	292,050,371	7.75	2038/1/17	1.09
18	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	2,000,000	14,226.20	284,524,143	14,577.06	291,541,303	5.625	2042/4/4	1.08
19	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	2,600,000	11,344.38	294,953,968	11,117.34	289,051,083	2.783	2031/1/23	1.07
20	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000	15,098.86	286,878,493	15,186.48	288,543,156	5.95	2046/1/8	1.07
21	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,400,000	12,192.62	292,622,955	11,833.13	283,995,210	4.625	2028/1/13	1.06
22	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,200,000	12,617.46	277,584,320	12,620.37	277,648,338	4.5	2029/4/22	1.03
23	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,010,000	13,898.51	279,360,059	13,765.71	276,690,818	6.05	2040/1/11	1.03
24	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000	14,344.72	272,549,823	14,445.24	274,459,649	5.35	2049/2/11	1.02
25	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,500,000	11,937.96	298,449,230	10,968.38	274,209,596	5	2045/6/15	1.02
26	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	2,200,000	12,574.36	276,636,021	12,224.35	268,935,701	4.5	2056/4/1	1.00
27	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,600,000	10,571.50	274,859,202	10,309.29	268,041,752	6.625	2045/2/17	1.00

28	アメリカ	国債証券	UKRAINE GOVERNMENT	2,000,000	13,107.26	262,145,292	13,163.35	263,267,178	9.75	2028/11/1	0.98
29	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,300,000	11,340.29	260,826,762	11,176.04	257,048,925	6	2027/3/25	0.96
30	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	2,000,000	12,612.69	252,253,802	12,708.00	254,160,023	4.375	2029/3/21	0.94

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.19
合 計	98.19

（参考）J－R E I Tインデックス マザーファンド

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,350	728,729	3,169,973,977	725,000	3,153,750,000	7.02
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	3,838	686,885	2,636,267,239	668,000	2,563,784,000	5.70
3	日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	12,431	188,268	2,340,364,977	183,200	2,277,359,200	5.07
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	6,081	356,191	2,165,998,261	372,500	2,265,172,500	5.04
5	日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	19,365	115,295	2,232,692,709	107,300	2,077,864,500	4.62
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	12,412	182,425	2,264,266,547	160,600	1,993,367,200	4.43
7	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,763	326,862	1,883,711,296	326,500	1,881,619,500	4.19
8	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	7,647	213,524	1,632,818,257	194,000	1,483,518,000	3.30
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	3,838	367,654	1,411,058,700	362,000	1,389,356,000	3.09
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	8,640	160,961	1,390,704,163	150,800	1,302,912,000	2.90
11	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	5,449	206,122	1,123,161,284	202,700	1,104,512,300	2.45
12	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,289	92,778	1,047,378,744	92,400	1,043,103,600	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	2,522	448,762	1,131,778,293	405,000	1,021,410,000	2.27

14	日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,045	504,501	1,031,706,283	457,000	934,565,000	2.08
15	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,187	807,380	958,360,285	767,000	910,429,000	2.02
16	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,699	181,203	851,476,327	187,500	881,062,500	1.96
17	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	1,427	590,117	842,098,186	590,000	841,930,000	1.87
18	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	2,508	323,376	811,028,362	331,000	830,148,000	1.84
19	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	1,325	651,385	863,085,959	625,000	828,125,000	1.84
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	11,758	70,236	825,846,175	67,100	788,961,800	1.75
21	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	16,893	46,390	783,676,405	43,900	741,602,700	1.65
22	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,513	164,239	741,212,547	151,000	681,463,000	1.51
23	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,514	158,339	714,746,534	149,800	676,197,200	1.50
24	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,346	520,174	700,154,890	489,000	658,194,000	1.46
25	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	811	794,533	644,366,725	752,000	609,872,000	1.35
26	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	1,728	356,827	616,597,747	343,500	593,568,000	1.32
27	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,374	185,024	624,271,549	175,500	592,137,000	1.31
28	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	2,621	233,304	611,491,671	217,200	569,281,200	1.26
29	日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	5,078	119,521	606,931,455	111,800	567,720,400	1.26
30	日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	3,467	165,998	575,516,903	153,400	531,837,800	1.18

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.09
合 計	97.09

（参考）海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	30,320	15,555.76	471,650,668	14,151.16	429,063,317	6.11
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	3,684	98,788.47	363,936,752	89,712.83	330,502,079	4.70
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	6,268	37,014.80	232,008,777	33,835.65	212,081,882	3.02
4	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	13,440	15,193.13	204,195,801	14,980.49	201,337,812	2.86
5	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	11,600	18,756.19	217,571,854	16,425.37	190,534,399	2.71
6	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	17,350	9,710.89	168,483,953	9,377.77	162,704,427	2.31
7	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,710	26,060.57	148,805,866	25,182.00	143,789,220	2.04
8	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	13,990	9,579.23	134,013,467	9,127.07	127,687,793	1.81
9	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,680	23,317.18	132,441,584	21,582.65	122,589,468	1.74
10	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	68,900	1,860.23	128,170,205	1,710.57	117,858,934	1.67
11	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	15,940	8,074.22	128,703,220	7,392.31	117,833,517	1.67
12	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,480	21,680.02	118,806,527	19,251.35	105,497,448	1.50
13	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	23,520	4,693.52	110,391,643	4,359.28	102,530,360	1.46
14	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	16,149	6,302.67	101,781,839	6,313.40	101,955,213	1.45
15	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,750	21,941.79	104,223,541	21,259.20	100,981,219	1.43
16	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	4,730	23,371.27	110,546,140	21,145.04	100,016,066	1.42
17	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,669	37,558.11	100,242,605	36,254.24	96,762,581	1.37
18	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	49,100	1,949.57	95,724,025	1,814.18	89,076,523	1.26
19	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	22,170	4,068.29	90,194,033	3,806.39	84,387,870	1.20
20	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	15,430	6,001.15	92,597,751	5,441.55	83,963,123	1.19
21	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	25,100	3,555.64	89,246,790	3,231.13	81,101,373	1.15
22	香港	投資証券	LINK REIT	85,400	1,023.13	87,375,900	938.29	80,130,393	1.14
23	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	5,850	12,745.44	74,560,880	12,447.74	72,819,293	1.03
24	アメリカ	投資証券	UDR INC	11,530	6,197.01	71,451,530	5,991.07	69,077,125	0.98
25	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	4,090	17,169.73	70,224,215	16,798.07	68,704,118	0.97
26	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	7,550	8,866.93	66,945,328	8,276.48	62,487,454	0.89
27	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,010	9,863.40	69,142,442	8,888.68	62,309,692	0.88
28	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	25,000	2,475.06	61,876,543	2,400.68	60,017,100	0.85
29	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	11,950	5,525.79	66,033,270	4,959.17	59,262,144	0.84
30	アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	24,400	2,423.10	59,123,643	2,314.50	56,473,937	0.80

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.84
合 計	98.84

②【投資不動産物件】

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

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）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券NOMURA－B P I 総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

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インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

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

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12月限)	買建	540	日本円	11,161,040,100	10,964,700,000	2.61

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

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12月限)	買建	155	米ドル	34,340,247.5	3,843,360,501	33,710,562.5	3,772,886,155	4.30
	カナダ	モントリ オール取 引所	S&P TSX60株価指 数先物(2021年12 月限)	買建	8	カナダド ル	1,954,788	171,649,935	1,923,360	168,890,241	0.19

	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	ユーロ50株価指数先物(2021年12月限)	買建	100	ユーロ	4,138,505	537,426,258	4,063,000	527,621,174	0.60
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200株価指数先物(2021年12月限)	買建	6	豪ドル	1,106,175	89,002,841	1,076,400	86,607,144	0.09
	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12月限)	買建	22	英ポンド	1,548,470	232,936,343	1,556,500	234,144,293	0.26
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SMI株価指数先物(2021年12月限)	買建	11	スイスフラン	1,315,170	157,662,580	1,280,180	153,467,976	0.17

（参考）国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

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

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12月限)	買建	630	日本円	1,349,084,340	1,300,320,000	2.89

（参考）海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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12月限)	買建	46	米ドル	1,903,410	213,029,649	1,856,100	207,734,712	2.96
----------	------	---------------	------------------------------	----	----	-----	-----------	-------------	-----------	-------------	------

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

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

2021年9月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2014年 9月 8日)	643	643	1.1364	1.1364
第2計算期間	(2015年 9月 7日)	1,879	1,879	1.1491	1.1491
第3計算期間	(2016年 9月 6日)	2,813	2,813	1.2795	1.2795
第4計算期間	(2017年 9月 6日)	4,900	4,900	1.3162	1.3162
第5計算期間	(2018年 9月 6日)	7,472	7,472	1.3695	1.3695
第6計算期間	(2019年 9月 6日)	10,413	10,413	1.4703	1.4703
第7計算期間	(2020年 9月 7日)	15,149	15,149	1.4419	1.4419
第8計算期間	(2021年 9月 6日)	17,564	17,564	1.7425	1.7425
	2020年 9月末日	15,288	—	1.4337	—
	10月末日	15,009	—	1.4047	—
	11月末日	15,732	—	1.5009	—
	12月末日	15,602	—	1.5339	—
	2021年 1月末日	15,571	—	1.5458	—
	2月末日	15,536	—	1.5667	—
	3月末日	15,824	—	1.6065	—
	4月末日	16,094	—	1.6397	—
	5月末日	16,215	—	1.6529	—
	6月末日	16,702	—	1.6834	—
	7月末日	17,010	—	1.7007	—
	8月末日	17,311	—	1.7227	—
	9月末日	17,135	—	1.6949	—

②【分配の推移】

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

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2013年 9月12日～2014年 9月 8日	0.0000円
第2計算期間	2014年 9月 9日～2015年 9月 7日	0.0000円

第3計算期間	2015年 9月 8日～2016年 9月 6日	0.0000円
第4計算期間	2016年 9月 7日～2017年 9月 6日	0.0000円
第5計算期間	2017年 9月 7日～2018年 9月 6日	0.0000円
第6計算期間	2018年 9月 7日～2019年 9月 6日	0.0000円
第7計算期間	2019年 9月 7日～2020年 9月 7日	0.0000円
第8計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	0.0000円

③【収益率の推移】

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

	計算期間	収益率
第1計算期間	2013年 9月12日～2014年 9月 8日	13.6%
第2計算期間	2014年 9月 9日～2015年 9月 7日	1.1%
第3計算期間	2015年 9月 8日～2016年 9月 6日	11.3%
第4計算期間	2016年 9月 7日～2017年 9月 6日	2.9%
第5計算期間	2017年 9月 7日～2018年 9月 6日	4.0%
第6計算期間	2018年 9月 7日～2019年 9月 6日	7.4%
第7計算期間	2019年 9月 7日～2020年 9月 7日	△1.9%
第8計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	20.8%

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

（４）【設定及び解約の実績】

野村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

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2013年 9月12日～2014年 9月 8日	664,849,801	98,191,649	566,658,152
第2計算期間	2014年 9月 9日～2015年 9月 7日	1,605,724,941	536,415,481	1,635,967,612
第3計算期間	2015年 9月 8日～2016年 9月 6日	1,024,082,214	461,295,091	2,198,754,735
第4計算期間	2016年 9月 7日～2017年 9月 6日	2,316,145,480	791,558,944	3,723,341,271
第5計算期間	2017年 9月 7日～2018年 9月 6日	2,702,679,152	969,694,777	5,456,325,646
第6計算期間	2018年 9月 7日～2019年 9月 6日	3,211,652,592	1,585,250,907	7,082,727,331
第7計算期間	2019年 9月 7日～2020年 9月 7日	5,953,915,625	2,530,429,290	10,506,213,666
第8計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	2,362,386,528	2,788,397,143	10,080,203,051

※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9月30日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次：設定来）



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2021年9月	0 円
2020年9月	0 円
2019年9月	0 円
2018年9月	0 円
2017年9月	0 円
設定来累計	0 円

■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

銘柄	投資比率（％）
国内株式マザーファンド	17.5
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	16.3
国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド	11.3
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	11.1
新興国債券マザーファンド	11.0
J－REITインデックス マザーファンド	16.4
海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	16.3

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（％）
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.6
2	ソニーグループ	電気機器	0.5
3	キーエンス	電気機器	0.4
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.3
5	リクルートホールディングス	サービス業	0.3

・「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（％）
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.7
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.6
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.4
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

・「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	0.1
2	国庫債券 利付（10年）第343回	国債証券	0.1
3	国庫債券 利付（10年）第342回	国債証券	0.1
4	国庫債券 利付（10年）第351回	国債証券	0.1
5	国庫債券 利付（5年）第135回	国債証券	0.1

・「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

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

・「新興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	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.3
2	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.2
3	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.2
4	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.2
5	TURKEY GLOBAL	国債証券	0.2

・「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	1.1
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	0.9
3	G L P 投資法人 投資証券	投資証券	0.8
4	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	投資証券	0.8
5	日本都市ファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.8

・「海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	1.0
2	EQUINIX INC	投資証券	0.8
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.5
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.5
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	0.4

■ 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。
- ・2012年は対象指数（合成指数）の年間収益率。（出所：MSCI他）
- ・2013年は設定日（2013年9月12日）から年末までのファンドの収益率。
- ・2021年は年初から運用実績作成基準日までのファンドの収益率。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1)受益権の募集

申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。

(2)申込締切時間

午後3時までに取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。

(3)申込不可日

販売会社の営業日であっても、下記の条件に該当する日（「申込不可日」といいます。）には、原則として取得の申込みができません。（申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。）

※申込日当日あるいは申込日の翌営業日が、以下のいずれかの休業日と同日の場合

・ニューヨーク証券取引所 ・ニューヨークの銀行

(4)販売単位

1万口以上1万口単位(当初元本1口＝1円)または1万円以上1円単位（分配金を再投資する場合には1口単位）とします。

(5)販売価額

取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

(6)申込代金の支払い

販売会社の定める期日までに支払うものとします。

(7)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。

(8)申込受け付けの中止および取り消し

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取り消す場合があります。

(9)申込手続等に関する照会先

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

※購入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】

(1)解約の請求

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。

(2)解約請求の締切時間

一部解約の実行の請求の受付については、午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、かつ、その解約請求のお申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。

(3)申込不可日

販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として受益権の一部解約の実行の請求ができません。（申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。）

(4)換金単位

1万口単位、1口単位または1円単位で一部解約の実行を請求することができます。

(5)換金価額

解約申込みの受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額を差し引いた価額となります。

(6)換金制限

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。

(7)換金代金の支払い

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。

ただし、金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）により、有価証券の売却や売却代金の入金が遅延したとき等は、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

(8)解約請求の受け付けの中止および取り消し

金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

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

(9)換金手続等に関する照会先

ファンドの換金（解約）手続等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/>

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<基準価額の計算方法>

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 ^{※1} の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 ^{※1} における以下のいずれかの価額で評価します。 ^{※2} ①日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) ②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） ③価格情報会社の提供する価額
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】

無期限とします(2013年9月12日設定)。

（4）【計算期間】

原則として、毎年9月7日から翌年9月6日までとします。

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

ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

（a）ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託期間中において、信託契約締結日から3年を経過した日以降において、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が30億口を下回った場合、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

（b）信託期間の終了

(i) 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。

(ii) 上記(i)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。以下本項において同じ。)は

受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

(iii) 上記(i)の書面決議は議決権を行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。

(iv) 上記(i)から(iii)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(i)から(iii)までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。

(v) 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。

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

(c) 運用報告書

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

(d) 信託約款の変更

(i) 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。

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

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

(iv) 上記(ii)の書面決議は議決権を行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。

(v) 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。

(vi) 上記(ii)から(v)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。

- (vii) 上記(i)から(vi)の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、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

- (i) 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」に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- (ii) 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請求を行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。

① 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計算期間の末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下さい。

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。

② 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。

③ 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8期計算期間(2020年9月8日から2021年9月6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) 【貸借対照表】

(単位：円)		
	第7期 (2020年 9月 7日現在)	第8期 (2021年 9月 6日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	90,901,578	83,594,737
親投資信託受益証券	15,137,205,340	17,540,713,170
派生商品評価勘定	-	5,945,982
未収入金	16,400,957	2,183,646
流動資産合計	15,244,507,875	17,632,437,535
資産合計	15,244,507,875	17,632,437,535
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	11,957,784	-
未払金	-	9,099,221
未払解約金	45,114,345	13,635,628
未払受託者報酬	3,048,015	3,610,280
未払委託者報酬	35,052,099	41,518,138
未払利息	129	65
その他未払費用	228,535	270,705
流動負債合計	95,400,907	68,134,037
負債合計	95,400,907	68,134,037
純資産の部		
元本等		
元本	10,506,213,666	10,080,203,051
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,642,893,302	7,484,100,447
（分配準備積立金）	1,001,607,365	3,075,027,722
元本等合計	15,149,106,968	17,564,303,498
純資産合計	15,149,106,968	17,564,303,498
負債純資産合計	15,244,507,875	17,632,437,535

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7日	第8期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6日
営業収益		
有価証券売買等損益	△271,357,139	3,186,228,375
為替差損益	△4,707,232	△63,364,887
営業収益合計	△276,064,371	3,122,863,488
営業費用		
支払利息	24,709	16,366
受託者報酬	5,814,084	7,020,872
委託者報酬	66,861,859	80,739,865
その他費用	446,732	532,387
営業費用合計	73,147,384	88,309,490
営業利益又は営業損失（△）	△349,211,755	3,034,553,998
経常利益又は経常損失（△）	△349,211,755	3,034,553,998
当期純利益又は当期純損失（△）	△349,211,755	3,034,553,998
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（△）	△109,995,249	314,985,975
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,330,968,868	4,642,893,302
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,751,726,222	1,368,193,694
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,751,726,222	1,368,193,694
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,200,585,282	1,246,554,572
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,200,585,282	1,246,554,572
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,642,893,302	7,484,100,447

(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	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。 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。
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。
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 9月 8日から2021年 9月 6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7期 2020年 9月 7日現在	第8期 2021年 9月 6日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 10,506,213,666口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 10,080,203,051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 1.4419円 (10,000口当たり純資産額) (14,419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 1.7425円 (10,000口当たり純資産額) (17,425円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7日	第8期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6日																														
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>298,980,360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>3,641,285,937円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>702,627,005円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	298,980,360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	3,641,285,937円	分配準備積立金額	D	702,627,005円	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>399,821,510円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>1,910,894,197円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>4,409,072,725円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>764,312,015円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	399,821,510円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,910,894,197円	収益調整金額	C	4,409,072,725円	分配準備積立金額	D	764,312,015円
項目																															
費用控除後の配当等収益額	A	298,980,360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	3,641,285,937円																													
分配準備積立金額	D	702,627,005円																													
項目																															
費用控除後の配当等収益額	A	399,821,510円																													
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,910,894,197円																													
収益調整金額	C	4,409,072,725円																													
分配準備積立金額	D	764,312,015円																													

当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,642,893,302円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,484,100,447円
当ファンドの期末残存口数	F	10,506,213,666口	当ファンドの期末残存口数	F	10,080,203,051口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,419円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,424円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

第7期 自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7日	第8期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6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、(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。 当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 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7期 2020年 9月 7日現在	第8期 2021年 9月 6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。	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。	2. 時価の算定方法 同左
派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係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。	

（関連当事者との取引に関する注記）

第7期 自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7日	第8期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6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7期 自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7日	第8期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6日
期首元本額 7,082,727,331円	期首元本額 10,506,213,666円
期中追加設定元本額 5,953,915,625円	期中追加設定元本額 2,362,386,528円
期中一部解約元本額 2,530,429,290円	期中一部解約元本額 2,788,397,143円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第7期 自 2019年 9月 7日 至 2020年 9月 7日	第8期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6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	△178,059,321	2,866,821,856

合計	△178,059,321	2,866,821,856
----	--------------	---------------

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第7期(2020年 9月 7日現在)				第8期(2021年 9月 6日現在)			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引 為替予約取引								
売建	1,689,757,608	—	1,701,715,392	△11,957,784	1,911,019,902	—	1,905,073,920	5,945,982
米ドル	1,689,757,608	—	1,701,715,392	△11,957,784	1,911,019,902	—	1,905,073,920	5,945,982
合計	1,689,757,608	—	1,701,715,392	△11,957,784	1,911,019,902	—	1,905,073,920	5,945,982

(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。

① 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。

② 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。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年9月6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9月6日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	1,407,840,719	3,009,259,536	

親投資信託受益証券		国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド	1,444,431,221	1,924,271,272	
		J－REITインデックス マザーファンド	1,017,828,787	2,915,061,645	
		外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	1,001,946,537	2,895,224,713	
		新興国債券マザーファンド	908,665,498	1,928,188,186	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	1,556,273,232	1,919,196,149	
		海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	1,605,263,780	2,949,511,669	
	小計	銘柄数：7 組入時価比率：99.9%	8,942,249,774	17,540,713,170 100.0%	
合計				17,540,713,170	

(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

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

(参考)

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

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2021年 9月 6日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,389,299,825
株式	416,079,355,380
派生商品評価勘定	42,122,650
未収入金	295,933,844
未収配当金	229,359,993
未収利息	799,602
その他未収収益	7,397,389
流動資産合計	429,044,268,683
資産合計	429,044,268,683
負債の部	
流動負債	
前受金	66,735,700
未払解約金	582,886,041
未払利息	9,717
有価証券貸借取引受入金	7,097,493,758
流動負債合計	7,747,125,216

(2021年 9月 6日現在)

負債合計	7,747,125,216
純資産の部	
元本等	
元本	197,102,127,251
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	224,195,016,216
元本等合計	421,297,143,467
純資産合計	421,297,143,467
負債純資産合計	429,044,268,683

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(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 9月 6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	2.1375円
(10,000口当たり純資産額)	(21,375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	
	6,923,118,100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 9月 8日 至 2021年 9月 6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なっております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2021年 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2020年 9月 8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	271,147,518,306円
同期中における追加設定元本額	26,699,290,036円

同期中における一部解約元本額	100,744,681,091円
期末元本額	197,102,127,251円
期末元本額の内訳※	
バランスセレクト３０	133,842,367円
バランスセレクト５０	319,587,867円
バランスセレクト７０	453,805,692円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	2,288,876,285円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	2,956,989,329円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	7,725,618,646円
野村資産設計ファンド２０１５	38,382,554円
野村資産設計ファンド２０２０	38,560,673円
野村資産設計ファンド２０２５	68,287,428円
野村資産設計ファンド２０３０	95,984,495円
野村資産設計ファンド２０３５	83,341,414円
野村資産設計ファンド２０４０	158,481,386円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	14,633,339,664円
のむラップ・ファンド（保守型）	2,385,248,046円
のむラップ・ファンド（普通型）	10,412,770,355円
のむラップ・ファンド（積極型）	3,289,755,168円
野村資産設計ファンド２０４５	26,580,957円
野村インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ	1,757,073,270円
マイ・ロード	3,331,516,506円
ネクストコア	35,212,100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	1,407,840,719円
野村ＴＯＰＩＸインデックス（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	2,768,832,472円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	1,310,031,944円
野村資産設計ファンド２０５０	39,416,242円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	12,716,465円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	6,512,243円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	5,151,311円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	4,324,731円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	355,559,542円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	439,108,008円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	3,055,426円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	3,418,484円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	23,326,764円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	6,112,019円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	25,083,590円
野村６資産均等バランス	2,251,444,570円
世界６資産分散ファンド	77,361,708円
野村資産設計ファンド２０６０	20,271,882円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	1,215,083,605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）	306,694,772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）	145,444,956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）	473,394,790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）	457,614,240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）	3,312,627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）	7,421,045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）	1,101,892円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	2,401,143,536円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	6,846,117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）	65,863,519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）	65,720,370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）	22,890,194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）	92,499,178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）	205,271,490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）	4,279,822,550円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	56,184,953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）	410,350,346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）	1,655,916,502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）	161,618,213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）	84,780,816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）	2,428,640円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	5,939,268円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	27,094,680円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	32,389,178円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	119,238,880円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	9,014,725,939円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	24,718,937,132円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	28,270,958,498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）	33,675,634,572円
マイバランスDC30	3,216,359,667円
マイバランスDC50	5,463,534,480円
マイバランスDC70	5,549,934,358円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,215,606,032円
野村DC運用戦略ファンド	832,334,712円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	70,855,905円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	1,246,038,325円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	963,879,816円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	865,343,389円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	10,127,976円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	4,585,657円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	73,617,556円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	20,566,194円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	19,129,574円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	15,138,860円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	438,374,823円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	370,178,603円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	233,400,793円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	308,572,674円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	10,328,182円
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	58,492,625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）	136,582,230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9月6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	6,600	3,060.00	20,196,000	
		日本水産	187,600	625.00	117,250,000	
		マルハニチロ	31,600	2,485.00	78,526,000	
		雪国まいたけ	16,600	1,626.00	26,991,600	貸付有価証券 2,200株
		カネコ種苗	6,100	1,487.00	9,070,700	
		サカタのタネ	24,100	3,650.00	87,965,000	貸付有価証券 200株
		ホクト	16,900	1,995.00	33,715,500	貸付有価証券 1,500株（200株）
		ホクリヨウ	3,100	779.00	2,414,900	貸付有価証券 200株
		住石ホールディングス	35,400	135.00	4,779,000	
		日鉄鉱業	4,600	6,630.00	30,498,000	
		三井松島ホールディングス	8,400	1,298.00	10,903,200	貸付有価証券 300株
		I N P E X	810,400	763.00	618,335,200	貸付有価証券 28,000株
		石油資源開発	26,400	1,896.00	50,054,400	
		K & O エナジーグループ	9,800	1,360.00	13,328,000	
		ヒノキヤグループ	4,400	2,341.00	10,300,400	貸付有価証券 300株
		ショーボンドホールディングス	28,800	5,020.00	144,576,000	貸付有価証券 7,300株
		ミライト・ホールディングス	70,000	2,285.00	159,950,000	貸付有価証券 500株
		タマホーム	12,200	2,616.00	31,915,200	貸付有価証券 3,000株
		サンヨーホームズ	2,300	720.00	1,656,000	
		日本アクア	8,000	576.00	4,608,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）

ファーストコーポレーション	6,200	781.00	4,842,200	
ベステラ	3,900	1,511.00	5,892,900	
Robot Home	33,700	215.00	7,245,500	貸付有価証券 3,700株（2,500株）
キャンディル	3,500	643.00	2,250,500	貸付有価証券 1,600株
スペースバリューホールディングス	24,600	836.00	20,565,600	
ダイセキ環境ソリューション	3,900	1,306.00	5,093,400	
第一カッター興業	5,000	1,273.00	6,365,000	
安藤・間	129,500	844.00	109,298,000	貸付有価証券 49,700株
東急建設	59,200	792.00	46,886,400	
コムシスホールディングス	71,600	3,120.00	223,392,000	
ビーアールホールディングス	27,000	514.00	13,878,000	貸付有価証券 200株
高松コンストラクショングループ	12,600	2,118.00	26,686,800	
東建コーポレーション	6,200	10,910.00	67,642,000	
ソネック	2,100	1,136.00	2,385,600	貸付有価証券 900株
ヤマウラ	8,800	965.00	8,492,000	貸付有価証券 4,100株
オリエンタル白石	67,900	273.00	18,536,700	
大成建設	145,200	3,605.00	523,446,000	
大林組	466,500	948.00	442,242,000	
清水建設	437,000	815.00	356,155,000	
飛島建設	13,400	1,127.00	15,101,800	
長谷工コーポレーション	152,800	1,573.00	240,354,400	
松井建設	18,400	798.00	14,683,200	
銭高組	2,000	4,090.00	8,180,000	
鹿島建設	341,800	1,493.00	510,307,400	
不動テトラ	11,400	1,773.00	20,212,200	
大末建設	5,900	995.00	5,870,500	
鉄建建設	9,400	1,838.00	17,277,200	
西松建設	33,400	3,605.00	120,407,000	貸付有価証券 500株

三井住友建設	112,700	483.00	54,434,100	
大豊建設	10,200	3,860.00	39,372,000	貸付有価証券 3,300株（200株）
前田建設工業	116,800	833.00	97,294,400	
佐田建設	10,800	482.00	5,205,600	
ナカノフドー建設	11,200	369.00	4,132,800	
奥村組	25,600	3,100.00	79,360,000	
東鉄工業	20,000	2,504.00	50,080,000	
イチケン	3,400	1,922.00	6,534,800	
富士ピー・エス	6,000	580.00	3,480,000	貸付有価証券 2,800株
浅沼組	5,600	4,640.00	25,984,000	
戸田建設	193,700	830.00	160,771,000	
熊谷組	21,600	2,761.00	59,637,600	
北野建設	2,800	2,184.00	6,115,200	
植木組	4,100	1,512.00	6,199,200	貸付有価証券 900株
矢作建設工業	20,600	769.00	15,841,400	
ピーエス三菱	15,400	666.00	10,256,400	
日本ハウスホールディングス	31,800	432.00	13,737,600	貸付有価証券 7,400株
大東建託	50,900	12,540.00	638,286,000	
新日本建設	19,800	888.00	17,582,400	
N I P P O	38,600	3,515.00	135,679,000	
東亜道路工業	2,900	4,555.00	13,209,500	
前田道路	28,800	1,903.00	54,806,400	貸付有価証券 1,200株
日本道路	4,500	8,200.00	36,900,000	
東亜建設工業	12,500	2,323.00	29,037,500	貸付有価証券 5,800株（5,300株）
日本国土開発	45,400	590.00	26,786,000	貸付有価証券 600株
若築建設	8,400	2,066.00	17,354,400	貸付有価証券 100株
東洋建設	52,300	572.00	29,915,600	
五洋建設	198,100	734.00	145,405,400	貸付有価証券 500株
世紀東急工業	22,400	865.00	19,376,000	
福田組	5,000	4,940.00	24,700,000	

住友林業	119,300	2,175.00	259,477,500	貸付有価証券 29,400株
日本基礎技術	14,200	584.00	8,292,800	
巴コーポレーション	20,700	477.00	9,873,900	
大和ハウス工業	430,800	3,540.00	1,525,032,000	
ライト工業	26,700	1,979.00	52,839,300	
積水ハウス	505,900	2,288.00	1,157,499,200	
日特建設	11,600	740.00	8,584,000	
北陸電気工事	8,100	1,329.00	10,764,900	
ユアテック	26,700	735.00	19,624,500	
日本リーテック	9,800	1,696.00	16,620,800	
四電工	2,500	3,535.00	8,837,500	
中電工	21,500	2,350.00	50,525,000	
関電工	75,800	951.00	72,085,800	
きんでん	94,700	1,914.00	181,255,800	
東京エネシス	15,500	1,095.00	16,972,500	
トーエネック	4,700	3,785.00	17,789,500	
住友電設	13,200	2,288.00	30,201,600	貸付有価証券 100株
日本電設工業	25,600	1,846.00	47,257,600	
協和エクシオ	70,700	2,844.00	201,070,800	
新日本空調	12,300	2,487.00	30,590,100	貸付有価証券 100株
九電工	32,700	4,130.00	135,051,000	
三機工業	33,100	1,553.00	51,404,300	
日揮ホールディングス	155,600	970.00	150,932,000	貸付有価証券 1,700株
中外炉工業	5,000	1,813.00	9,065,000	
ヤマト	14,900	771.00	11,487,900	
太平電業	10,300	2,757.00	28,397,100	
高砂熱学工業	42,200	2,188.00	92,333,600	
三晃金属工業	1,800	2,274.00	4,093,200	
朝日工業社	3,500	3,385.00	11,847,500	
明星工業	30,200	755.00	22,801,000	
大気社	22,700	3,585.00	81,379,500	
ダイダン	10,300	2,793.00	28,767,900	
日比谷総合設備	15,000	1,926.00	28,890,000	

フィル・カンパニー	2,700	2,822.00	7,619,400	
テスホールディングス	8,500	2,113.00	17,960,500	
レイズネクスト	25,000	1,158.00	28,950,000	
ニッポン	43,700	1,648.00	72,017,600	
日清製粉グループ本社	168,700	1,887.00	318,336,900	
日東富士製粉	1,100	6,740.00	7,414,000	
昭和産業	12,900	2,801.00	36,132,900	
鳥越製粉	13,200	792.00	10,454,400	
中部飼料	18,200	1,141.00	20,766,200	貸付有価証券 100株
フィード・ワン	20,100	766.00	15,396,600	
東洋精糖	2,500	1,169.00	2,922,500	
日本甜菜製糖	7,800	1,648.00	12,854,400	
DM三井製糖ホールディ ングス	11,800	1,970.00	23,246,000	
塩水港精糖	17,800	222.00	3,951,600	
日新製糖	7,100	1,704.00	12,098,400	
森永製菓	35,000	3,985.00	139,475,000	貸付有価証券 200株
中村屋	3,600	3,815.00	13,734,000	
江崎グリコ	41,100	4,190.00	172,209,000	
名糖産業	6,600	1,746.00	11,523,600	貸付有価証券 3,100株
井村屋グループ	8,500	2,321.00	19,728,500	
不二家	8,300	2,344.00	19,455,200	
山崎製パン	111,900	1,862.00	208,357,800	
第一屋製パン	2,900	833.00	2,415,700	
モロゾフ	2,400	5,500.00	13,200,000	
亀田製菓	8,500	4,710.00	40,035,000	
寿スピリッツ	14,400	7,140.00	102,816,000	
カルビー	68,000	2,800.00	190,400,000	
森永乳業	27,600	7,150.00	197,340,000	
六甲バター	10,900	1,614.00	17,592,600	貸付有価証券 100株
ヤクルト本社	102,700	6,350.00	652,145,000	
明治ホールディングス	98,700	6,920.00	683,004,000	
雪印メグミルク	35,900	2,291.00	82,246,900	
プリマハム	21,000	3,045.00	63,945,000	貸付有価証券

				100株
日本ハム	57,100	4,420.00	252,382,000	
林兼産業	4,900	586.00	2,871,400	
丸大食品	14,700	1,807.00	26,562,900	貸付有価証券 1,900株
S Foods	13,400	3,145.00	42,143,000	貸付有価証券 600株
柿安本店	5,200	2,571.00	13,369,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	96,100	738.00	70,921,800	貸付有価証券 1,300株
サッポロホールディングス	50,900	2,483.00	126,384,700	貸付有価証券 100株
アサヒグループホールディングス	351,200	5,383.00	1,890,509,600	貸付有価証券 21,400株
麒麟ホールディングス	548,800	2,073.50	1,137,936,800	貸付有価証券 68,200株
宝ホールディングス	110,700	1,517.00	167,931,900	貸付有価証券 1,000株
オエノンホールディングス	42,400	385.00	16,324,000	
養命酒製造	4,600	1,856.00	8,537,600	貸付有価証券 1,400株
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	104,800	1,571.00	164,640,800	貸付有価証券 6,200株
サントリー食品インターナショナル	99,900	4,525.00	452,047,500	貸付有価証券 18,000株
ダイドーグループホールディングス	8,400	5,730.00	48,132,000	貸付有価証券 1,100株（400株）
伊藤園	45,300	7,000.00	317,100,000	
キーコーヒー	14,700	2,240.00	32,928,000	
ユニカフェ	4,500	1,035.00	4,657,500	
ジャパンフーズ	2,100	1,240.00	2,604,000	
日清オイリオグループ	18,700	3,135.00	58,624,500	
不二製油グループ本社	36,400	2,569.00	93,511,600	
かどや製油	1,600	4,045.00	6,472,000	
J-オイルミルズ	13,900	1,838.00	25,548,200	
キッコーマン	107,500	9,030.00	970,725,000	
味の素	355,100	3,425.00	1,216,217,500	貸付有価証券 1,500株
ブルドックソース	6,800	2,097.00	14,259,600	貸付有価証券

				3,100株
キューピー	83,100	2,711.00	225,284,100	貸付有価証券 3,000株
ハウス食品グループ本社	55,800	3,650.00	203,670,000	
カゴメ	56,700	2,983.00	169,136,100	貸付有価証券 100株
焼津水産化学工業	7,200	985.00	7,092,000	
アリアケジャパン	13,600	6,380.00	86,768,000	
ピエトロ	2,000	1,800.00	3,600,000	貸付有価証券 900株
エバラ食品工業	3,300	2,604.00	8,593,200	
やまみ	1,600	1,993.00	3,188,800	
ニチレイ	71,100	2,871.00	204,128,100	
東洋水産	76,800	4,665.00	358,272,000	
イトアンドホールディ ングス	5,200	2,160.00	11,232,000	
大冷	1,700	2,006.00	3,410,200	貸付有価証券 700株
ヨシムラ・フード・ホー ルディングス	8,300	762.00	6,324,600	貸付有価証券 3,000株（200株）
日清食品ホールディン グス	58,600	8,630.00	505,718,000	
永谷園ホールディングス	7,300	2,130.00	15,549,000	
一正蒲鉾	5,800	931.00	5,399,800	貸付有価証券 900株
フジッコ	16,200	1,906.00	30,877,200	
ロック・フィールド	16,100	1,607.00	25,872,700	貸付有価証券 7,400株
日本たばこ産業	800,500	2,180.00	1,745,090,000	貸付有価証券 31,200株
ケンコーマヨネーズ	9,100	1,544.00	14,050,400	
わらべや日洋ホールディ ングス	9,800	2,447.00	23,980,600	
なとり	8,300	1,972.00	16,367,600	
イフジ産業	2,300	959.00	2,205,700	
ピクルスコーポレー ション	7,100	1,937.00	13,752,700	
ファーマフーズ	14,100	2,989.00	42,144,900	貸付有価証券 6,600株（2,200株）
北の達人コーポレーショ ン	52,100	501.00	26,102,100	貸付有価証券

				12,700株（6,500株）
ユーグレナ	76,000	887.00	67,412,000	貸付有価証券 32,800株（17,600株）
紀文食品	8,700	1,275.00	11,092,500	貸付有価証券 200株
ミヨシ油脂	5,700	1,294.00	7,375,800	
理研ビタミン	14,100	1,836.00	25,887,600	
片倉工業	16,300	1,503.00	24,498,900	貸付有価証券 1,900株
グンゼ	10,700	4,540.00	48,578,000	貸付有価証券 100株
東洋紡	57,600	1,385.00	79,776,000	
ユニチカ	42,700	361.00	15,414,700	貸付有価証券 200株
富士紡ホールディングス	7,000	4,345.00	30,415,000	
倉敷紡績	12,500	1,984.00	24,800,000	
シキボウ	8,200	939.00	7,699,800	
日本毛織	43,900	1,044.00	45,831,600	貸付有価証券 1,500株（1,400株）
ダイトウボウ	23,600	101.00	2,383,600	
トーア紡コーポレーショ ン	5,400	434.00	2,343,600	
ダイドーリミテッド	19,200	172.00	3,302,400	貸付有価証券 9,100株
帝国繊維	16,400	2,064.00	33,849,600	貸付有価証券 300株
帝人	137,100	1,620.00	222,102,000	貸付有価証券 2,200株
東レ	1,054,900	752.10	793,390,290	
サカイオーベックス	3,900	3,805.00	14,839,500	貸付有価証券 400株
住江織物	3,200	1,855.00	5,936,000	
日本フェルト	8,200	454.00	3,722,800	
イチカワ	1,900	1,359.00	2,582,100	
日東製網	1,600	1,512.00	2,419,200	
アツギ	11,200	638.00	7,145,600	
ダイニック	5,500	751.00	4,130,500	
セーレン	35,800	2,077.00	74,356,600	貸付有価証券 4,500株（4,500株）
ソトー	5,800	811.00	4,703,800	

東海染工	1,800	1,139.00	2,050,200	
小松マテーレ	23,900	994.00	23,756,600	
ワコールホールディングス	36,300	2,387.00	86,648,100	
ホギメディカル	19,600	3,450.00	67,620,000	
クラウディアホールディングス	3,600	293.00	1,054,800	
T S I ホールディングス	44,200	331.00	14,630,200	
マツオカコーポレーション	4,700	1,466.00	6,890,200	
ワールド	19,100	1,429.00	27,293,900	貸付有価証券 200株
三陽商会	7,600	870.00	6,612,000	貸付有価証券 3,500株
ナイガイ	5,300	363.00	1,923,900	
オンワードホールディングス	87,500	313.00	27,387,500	貸付有価証券 7,600株
ルックホールディングス	4,600	1,353.00	6,223,800	
ゴールドウイン	24,100	7,070.00	170,387,000	
デサント	24,900	3,605.00	89,764,500	貸付有価証券 200株
キング	7,700	526.00	4,050,200	
ヤマトインターナショナル	12,800	329.00	4,211,200	貸付有価証券 3,400株
特種東海製紙	8,900	4,515.00	40,183,500	
王子ホールディングス	655,900	596.00	390,916,400	
日本製紙	64,400	1,221.00	78,632,400	貸付有価証券 4,300株
三菱製紙	20,700	379.00	7,845,300	
北越コーポレーション	104,200	651.00	67,834,200	貸付有価証券 33,400株
中越パルプ工業	5,600	1,219.00	6,826,400	
巴川製紙所	4,800	917.00	4,401,600	
大王製紙	70,300	2,144.00	150,723,200	
阿波製紙	3,800	396.00	1,504,800	
レンゴー	150,200	905.00	135,931,000	貸付有価証券 400株
トーモク	8,900	1,930.00	17,177,000	貸付有価証券 200株
ザ・パック	11,000	3,020.00	33,220,000	貸付有価証券

				300株
クラレ	213,100	1,059.00	225,672,900	貸付有価証券 5,100株
旭化成	965,700	1,157.00	1,117,314,900	
共和レザー	7,900	693.00	5,474,700	
昭和電工	103,700	2,542.00	263,605,400	貸付有価証券 42,000株（4,700株）
住友化学	1,146,800	582.00	667,437,600	貸付有価証券 1,100株
住友精化	7,100	3,610.00	25,631,000	
日産化学	79,800	6,620.00	528,276,000	
ラサ工業	4,800	1,918.00	9,206,400	
クレハ	12,500	7,810.00	97,625,000	
多木化学	5,700	6,490.00	36,993,000	貸付有価証券 2,600株（900株）
テイカ	10,700	1,336.00	14,295,200	
石原産業	26,100	1,171.00	30,563,100	
片倉コープアグリ	3,800	1,209.00	4,594,200	
日本曹達	20,400	3,655.00	74,562,000	
東ソー	225,200	2,104.00	473,820,800	
トクヤマ	43,300	2,248.00	97,338,400	
セントラル硝子	27,800	2,232.00	62,049,600	貸付有価証券 200株
東亜合成	83,000	1,308.00	108,564,000	貸付有価証券 100株
大阪ソーダ	14,800	2,762.00	40,877,600	
関東電化工業	34,500	1,092.00	37,674,000	
デンカ	53,200	4,040.00	214,928,000	
信越化学工業	269,400	19,475.00	5,246,565,000	
日本カーバイド工業	5,400	1,408.00	7,603,200	
堺化学工業	10,200	2,216.00	22,603,200	
第一稀元素化学工業	14,600	1,711.00	24,980,600	
エア・ウォーター	148,600	1,837.00	272,978,200	
日本酸素ホールディングス	120,000	2,883.00	345,960,000	
日本化学工業	4,100	3,450.00	14,145,000	
東邦アセチレン	2,200	1,488.00	3,273,600	貸付有価証券 1,000株
日本パーカライジング	73,500	1,190.00	87,465,000	

高圧ガス工業	23,100	751.00	17,348,100	
チタン工業	1,800	1,837.00	3,306,600	
四国化成工業	19,000	1,420.00	26,980,000	
戸田工業	3,100	3,175.00	9,842,500	
ステラ ケミファ	7,900	2,911.00	22,996,900	
保土谷化学工業	4,300	5,110.00	21,973,000	貸付有価証券 500株
日本触媒	26,400	5,920.00	156,288,000	貸付有価証券 300株
大日精化工業	12,000	2,674.00	32,088,000	
カネカ	37,700	4,615.00	173,985,500	
三菱瓦斯化学	146,000	2,268.00	331,128,000	
三井化学	125,800	3,830.00	481,814,000	
J S R	146,200	3,990.00	583,338,000	
東京応化工業	25,000	7,380.00	184,500,000	
大阪有機化学工業	12,400	4,055.00	50,282,000	
三菱ケミカルホールディ ングス	973,900	986.00	960,265,400	
KHネオケム	24,000	3,090.00	74,160,000	
ダイセル	195,900	898.00	175,918,200	
住友ベークライト	22,900	5,210.00	119,309,000	
積水化学工業	304,900	1,958.00	596,994,200	
日本ゼオン	131,400	1,590.00	208,926,000	
アイカ工業	40,600	3,765.00	152,859,000	
宇部興産	73,600	2,291.00	168,617,600	
積水樹脂	22,000	2,225.00	48,950,000	
タキロンシーアイ	31,500	648.00	20,412,000	
旭有機材	8,200	1,516.00	12,431,200	
ニチバン	7,700	1,833.00	14,114,100	貸付有価証券 1,900株
リケンテクノス	35,500	598.00	21,229,000	
大倉工業	7,500	2,231.00	16,732,500	
積水化成成品工業	19,500	607.00	11,836,500	
群栄化学工業	3,300	2,882.00	9,510,600	
タイガースポリマー	7,700	440.00	3,388,000	
ミライアル	4,700	1,430.00	6,721,000	
ダイキアクシス	5,600	887.00	4,967,200	

ダイキョーニシカワ	30,700	697.00	21,397,900	貸付有価証券 100株
竹本容器	5,200	934.00	4,856,800	
森六ホールディングス	7,800	2,160.00	16,848,000	
恵和	3,700	4,825.00	17,852,500	
日本化薬	90,200	1,258.00	113,471,600	
カーリットホールディングス	14,400	875.00	12,600,000	
日本精化	10,500	2,180.00	22,890,000	
扶桑化学工業	11,500	4,835.00	55,602,500	
トリケミカル研究所	13,500	3,635.00	49,072,500	
A D E K A	67,100	2,590.00	173,789,000	
日油	54,900	6,570.00	360,693,000	
新日本理化学	24,100	285.00	6,868,500	
ハリマ化成グループ	10,800	897.00	9,687,600	
花王	329,100	6,852.00	2,254,993,200	貸付有価証券 9,000株
第一工業製薬	4,900	3,370.00	16,513,000	
石原ケミカル	3,700	2,780.00	10,286,000	貸付有価証券 1,700株
日華化学	4,900	1,071.00	5,247,900	
ニイタカ	3,000	2,301.00	6,903,000	貸付有価証券 600株
三洋化成工業	8,700	5,910.00	51,417,000	
有機合成薬品工業	11,200	340.00	3,808,000	
大日本塗料	16,500	880.00	14,520,000	
日本ペイントホールディングス	547,400	1,399.00	765,812,600	貸付有価証券 29,700株
関西ペイント	163,700	2,938.00	480,950,600	貸付有価証券 500株
神東塗料	11,500	195.00	2,242,500	
中国塗料	35,100	894.00	31,379,400	貸付有価証券 200株
日本特殊塗料	10,900	1,076.00	11,728,400	
藤倉化成	19,600	547.00	10,721,200	貸付有価証券 300株
太陽ホールディングス	10,700	6,120.00	65,484,000	
D I C	61,500	3,235.00	198,952,500	貸付有価証券 1,200株

サカタインクス	28,900	1,139.00	32,917,100	貸付有価証券 100株
東洋インキSCホールディングス	30,800	2,082.00	64,125,600	貸付有価証券 500株
T&K TOKA	10,200	858.00	8,751,600	
富士フイルムホールディングス	261,400	9,549.00	2,496,108,600	貸付有価証券 1,600株
資生堂	277,100	7,764.00	2,151,404,400	貸付有価証券 4,900株
ライオン	179,600	1,903.00	341,778,800	貸付有価証券 2,000株
高砂香料工業	9,300	2,888.00	26,858,400	
マンドム	31,200	1,697.00	52,946,400	
ミルボン	18,400	6,660.00	122,544,000	
ファンケル	54,200	3,820.00	207,044,000	
コーセー	28,000	13,110.00	367,080,000	
コタ	9,400	1,623.00	15,256,200	
シーボン	1,900	1,886.00	3,583,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	63,500	2,494.00	158,369,000	貸付有価証券 1,800株
ノエビアホールディングス	12,600	5,970.00	75,222,000	
アジュバンコスメジャパン	3,300	1,056.00	3,484,800	
新日本製薬	4,000	2,012.00	8,048,000	貸付有価証券 1,800株
エステー	9,600	1,806.00	17,337,600	
アグロ カネショウ	5,000	1,490.00	7,450,000	
コニシ	24,400	1,726.00	42,114,400	
長谷川香料	25,600	2,922.00	74,803,200	
星光PMC	8,500	867.00	7,369,500	
小林製薬	41,700	9,030.00	376,551,000	
荒川化学工業	12,400	1,283.00	15,909,200	
メック	11,100	3,530.00	39,183,000	貸付有価証券 100株
日本高純度化学	4,100	2,918.00	11,963,800	
タカラバイオ	38,900	3,235.00	125,841,500	
JCU	16,700	4,235.00	70,724,500	
新田ゼラチン	9,300	634.00	5,896,200	

OA Tアグリオ	3,100	1,871.00	5,800,100	
デクセリアルズ	41,600	2,190.00	91,104,000	
アース製薬	12,200	6,580.00	80,276,000	
北興化学工業	13,800	1,126.00	15,538,800	
大成ラミック	4,600	2,806.00	12,907,600	
クミアイ化学工業	55,400	920.00	50,968,000	
日本農薬	26,500	555.00	14,707,500	
アキレス	10,300	1,353.00	13,935,900	
有沢製作所	20,700	949.00	19,644,300	
日東電工	89,900	8,830.00	793,817,000	
レック	17,600	1,117.00	19,659,200	
三光合成	15,600	450.00	7,020,000	
きもと	22,800	250.00	5,700,000	
藤森工業	13,300	4,685.00	62,310,500	貸付有価証券 100株
前澤化成工業	9,400	1,275.00	11,985,000	貸付有価証券 3,400株
未来工業	5,300	1,651.00	8,750,300	
ウェーブロックホール ディングス	5,100	679.00	3,462,900	
J S P	8,700	1,637.00	14,241,900	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	27,300	4,275.00	116,707,500	
天馬	11,100	3,020.00	33,522,000	
信越ポリマー	22,900	997.00	22,831,300	
東リ	37,000	237.00	8,769,000	
ニフコ	54,600	3,555.00	194,103,000	
バルカー	12,100	2,208.00	26,716,800	
ユニ・チャーム	286,700	4,900.00	1,404,830,000	貸付有価証券 3,900株
ショーエイコーポレー ション	3,300	841.00	2,775,300	
協和キリン	174,600	3,965.00	692,289,000	
武田薬品工業	1,237,600	3,727.00	4,612,535,200	
アステラス製薬	1,289,800	1,906.50	2,459,003,700	
大日本住友製薬	110,300	2,082.00	229,644,600	貸付有価証券 200株
塩野義製薬	187,100	7,280.00	1,362,088,000	

わかもと製薬	17,700	350.00	6,195,000	貸付有価証券 1,900株
日本新薬	42,200	9,260.00	390,772,000	
中外製薬	465,300	4,447.00	2,069,189,100	貸付有価証券 1,300株
科研製薬	25,500	5,120.00	130,560,000	貸付有価証券 100株
エーザイ	164,400	9,220.00	1,515,768,000	
ロート製薬	70,900	3,520.00	249,568,000	
小野薬品工業	341,600	2,748.50	938,887,600	
久光製薬	43,300	4,600.00	199,180,000	貸付有価証券 1,700株
持田製薬	20,600	3,655.00	75,293,000	
参天製薬	258,900	1,685.00	436,246,500	貸付有価証券 1,200株
扶桑薬品工業	4,800	2,556.00	12,268,800	
日本ケミファ	1,800	2,255.00	4,059,000	
ツムラ	49,600	3,850.00	190,960,000	貸付有価証券 100株
日医工	42,100	911.00	38,353,100	貸付有価証券 200株
キッセイ薬品工業	26,300	2,510.00	66,013,000	
生化学工業	26,200	1,117.00	29,265,400	貸付有価証券 200株
栄研化学	26,100	2,294.00	59,873,400	
日水製薬	5,500	1,027.00	5,648,500	
鳥居薬品	8,000	2,956.00	23,648,000	
J C Rファーマ	41,900	2,920.00	122,348,000	
東和薬品	21,400	3,180.00	68,052,000	
富士製薬工業	9,100	1,161.00	10,565,100	
ゼリア新薬工業	27,000	2,194.00	59,238,000	貸付有価証券 900株
第一三共	1,169,000	2,790.00	3,261,510,000	
キョーリン製薬ホールディングス	32,800	1,866.00	61,204,800	
大幸薬品	22,400	931.00	20,854,400	貸付有価証券 10,100株（500株）
ダイト	9,500	3,735.00	35,482,500	貸付有価証券 300株
大塚ホールディングス	309,200	4,892.00	1,512,606,400	貸付有価証券

				21,000株
大正製薬ホールディングス	36,700	6,600.00	242,220,000	
ペプチドリーム	78,100	4,005.00	312,790,500	貸付有価証券 3,700株
あすか製薬ホールディングス	16,900	1,071.00	18,099,900	
サワイグループホールディングス	32,600	5,230.00	170,498,000	
日本コークス工業	125,700	133.00	16,718,100	貸付有価証券 500株
ニチレキ	17,600	1,330.00	23,408,000	
ユシロ化学工業	8,300	1,203.00	9,984,900	
ビーピー・カストロール	5,300	1,350.00	7,155,000	
富士石油	36,100	247.00	8,916,700	貸付有価証券 300株
MORESCO	5,400	1,160.00	6,264,000	
出光興産	165,100	2,704.00	446,430,400	貸付有価証券 100株
ENEOSホールディングス	2,237,800	439.30	983,065,540	
コスモエネルギーホールディングス	47,000	2,226.00	104,622,000	
横浜ゴム	86,100	1,954.00	168,239,400	貸付有価証券 100株
TOYO TIRE	78,300	2,056.00	160,984,800	貸付有価証券 500株
ブリヂストン	428,500	5,235.00	2,243,197,500	貸付有価証券 31,100株
住友ゴム工業	133,600	1,377.00	183,967,200	貸付有価証券 5,100株
藤倉コンポジット	13,000	710.00	9,230,000	貸付有価証券 1,000株
オカモト	8,800	4,350.00	38,280,000	
フコク	6,500	1,016.00	6,604,000	
ニッタ	15,400	2,882.00	44,382,800	
住友理工	28,800	728.00	20,966,400	
三ツ星ベルト	18,100	2,063.00	37,340,300	
バンドー化学	26,200	957.00	25,073,400	
日東紡績	22,100	3,685.00	81,438,500	
A G C	136,600	5,670.00	774,522,000	

				貸付有価証券 100株
日本板硝子	75,500	575.00	43,412,500	貸付有価証券 500株
石塚硝子	2,500	2,062.00	5,155,000	
日本山村硝子	6,200	925.00	5,735,000	
日本電気硝子	59,800	2,438.00	145,792,400	貸付有価証券 400株
オハラ	5,900	1,390.00	8,201,000	貸付有価証券 300株（300株）
住友大阪セメント	26,800	3,100.00	83,080,000	
太平洋セメント	84,500	2,628.00	222,066,000	
日本ヒューム	13,600	751.00	10,213,600	
日本コンクリート工業	32,000	313.00	10,016,000	
三谷セキサン	6,900	6,300.00	43,470,000	貸付有価証券 100株
アジアパイルホールディ ングス	22,900	493.00	11,289,700	貸付有価証券 100株
東海カーボン	124,700	1,599.00	199,395,300	貸付有価証券 2,700株
日本カーボン	7,700	4,365.00	33,610,500	貸付有価証券 800株
東洋炭素	9,700	2,968.00	28,789,600	貸付有価証券 400株
ノリタケカンパニーリミ テド	8,200	4,240.00	34,768,000	
TOTO	106,300	6,430.00	683,509,000	貸付有価証券 2,100株
日本碍子	163,700	1,901.00	311,193,700	
日本特殊陶業	113,200	1,741.00	197,081,200	
ダントーホールディング ス	9,700	253.00	2,454,100	貸付有価証券 6,300株
MARUWA	5,100	11,230.00	57,273,000	
品川リフラクトリーズ	3,500	4,040.00	14,140,000	
黒崎播磨	2,500	4,990.00	12,475,000	
ヨータイ	10,600	1,300.00	13,780,000	
イソライト工業	6,500	692.00	4,498,000	
東京窯業	18,900	328.00	6,199,200	
ニッカトー	6,700	704.00	4,716,800	
フジミインコーポレー	11,900	6,500.00	77,350,000	

テッド				
クニミネ工業	4,700	1,102.00	5,179,400	
エーアンドエーマテリアル	2,900	1,002.00	2,905,800	
ニチアス	37,600	2,906.00	109,265,600	
ニチハ	20,700	3,325.00	68,827,500	
日本製鉄	702,200	2,313.50	1,624,539,700	貸付有価証券 9,600株
神戸製鋼所	269,200	719.00	193,554,800	貸付有価証券 700株
中山製鋼所	20,400	470.00	9,588,000	貸付有価証券 700株
合同製鐵	7,900	1,546.00	12,213,400	貸付有価証券 600株
ジェイ エフ イー ホールディングス	425,700	1,897.00	807,552,900	貸付有価証券 8,800株
東京製鐵	57,300	1,252.00	71,739,600	貸付有価証券 200株
共英製鋼	16,600	1,513.00	25,115,800	貸付有価証券 100株
大和工業	31,300	4,185.00	130,990,500	
東京鐵鋼	5,600	1,621.00	9,077,600	
大阪製鐵	7,800	1,239.00	9,664,200	
淀川製鋼所	19,300	2,537.00	48,964,100	
丸一鋼管	47,800	2,810.00	134,318,000	
モリ工業	4,300	2,401.00	10,324,300	
大同特殊鋼	24,100	5,140.00	123,874,000	
日本高周波鋼業	5,400	400.00	2,160,000	
日本冶金工業	11,500	2,782.00	31,993,000	
山陽特殊製鋼	17,600	1,850.00	32,560,000	
愛知製鋼	8,300	2,839.00	23,563,700	
日立金属	138,700	2,134.00	295,985,800	貸付有価証券 1,700株
日本金属	3,700	1,060.00	3,922,000	貸付有価証券 800株
大太平洋金属	9,900	1,802.00	17,839,800	
新日本電工	95,000	324.00	30,780,000	貸付有価証券 7,700株
栗本鐵工所	6,700	1,656.00	11,095,200	
虹技	2,000	1,135.00	2,270,000	

日本鑄鉄管	1,700	1,234.00	2,097,800	
三菱製鋼	10,900	1,296.00	14,126,400	貸付有価証券 700株
日亜鋼業	21,500	296.00	6,364,000	貸付有価証券 100株
日本精線	2,100	5,000.00	10,500,000	
エンビプロ・ホールディングス	6,300	1,594.00	10,042,200	貸付有価証券 600株（200株）
シンニッタン	17,800	251.00	4,467,800	
新家工業	3,600	1,513.00	5,446,800	
大紀アルミニウム工業所	22,200	1,620.00	35,964,000	
日本軽金属ホールディングス	40,100	1,981.00	79,438,100	
三井金属鉱業	39,700	3,445.00	136,766,500	
東邦亜鉛	8,200	2,202.00	18,056,400	貸付有価証券 100株
三菱マテリアル	97,200	2,274.00	221,032,800	
住友金属鉱山	188,000	4,313.00	810,844,000	
DOWAホールディングス	37,200	4,855.00	180,606,000	貸付有価証券 300株
古河機械金属	24,300	1,267.00	30,788,100	貸付有価証券 300株
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,300	817.00	12,500,100	貸付有価証券 3,300株（400株）
東邦チタニウム	26,300	1,166.00	30,665,800	貸付有価証券 700株
UACJ	22,300	2,759.00	61,525,700	
CKサンエツ	3,100	3,355.00	10,400,500	
古河電気工業	45,700	2,392.00	109,314,400	
住友電気工業	513,300	1,518.50	779,446,050	
フジクラ	177,600	657.00	116,683,200	貸付有価証券 2,200株
昭和電線ホールディングス	14,200	2,402.00	34,108,400	
東京特殊電線	1,900	2,778.00	5,278,200	
タツタ電線	25,900	547.00	14,167,300	
カナレ電気	2,200	1,730.00	3,806,000	
平河ヒューテック	8,100	1,199.00	9,711,900	
リョービ	18,100	1,353.00	24,489,300	

アーレスティ	18,100	458.00	8,289,800	
アサヒホールディングス	55,200	2,280.00	125,856,000	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
稲葉製作所	8,300	1,493.00	12,391,900	貸付有価証券 100株
宮地エンジニアリンググループ	4,800	2,682.00	12,873,600	
トーカロ	37,900	1,406.00	53,287,400	
アルファＣｏ	5,200	1,253.00	6,515,600	
SUMCO	187,600	2,511.00	471,063,600	貸付有価証券 53,600株
川田テクノロジーズ	3,000	3,880.00	11,640,000	
RS Technologies	4,800	6,530.00	31,344,000	
ジェイテックコーポレーション	1,600	2,519.00	4,030,400	貸付有価証券 600株（300株）
信和	7,800	734.00	5,725,200	
東洋製罐グループホールディングス	93,700	1,614.00	151,231,800	貸付有価証券 500株
ホッカンホールディングス	7,500	1,453.00	10,897,500	
コロナ	8,100	930.00	7,533,000	
横河ブリッジホールディングス	25,300	2,284.00	57,785,200	
駒井ハルテック	3,000	1,676.00	5,028,000	
高田機工	1,300	2,849.00	3,703,700	貸付有価証券 600株
三和ホールディングス	138,700	1,530.00	212,211,000	貸付有価証券 300株
文化シャッター	43,300	1,173.00	50,790,900	貸付有価証券 15,700株（14,500株）
三協立山	18,900	770.00	14,553,000	
アルインコ	9,700	1,043.00	10,117,100	
東洋シャッター	3,200	654.00	2,092,800	
LIXIL	202,600	3,300.00	668,580,000	
日本ファイルコン	10,200	518.00	5,283,600	
ノーリツ	28,200	1,910.00	53,862,000	貸付有価証券 100株
長府製作所	15,000	2,086.00	31,290,000	
リンナイ	28,600	12,470.00	356,642,000	

ダイニチ工業	7,000	751.00	5,257,000	
日東精工	18,500	658.00	12,173,000	貸付有価証券 1,000株
三洋工業	1,800	1,902.00	3,423,600	
岡部	29,800	681.00	20,293,800	貸付有価証券 100株
ジーテクト	18,300	1,523.00	27,870,900	
東プレ	27,400	1,384.00	37,921,600	
高周波熱錬	28,300	648.00	18,338,400	
東京製綱	10,500	1,033.00	10,846,500	
サンコール	12,600	466.00	5,871,600	
モリテック スチール	11,500	461.00	5,301,500	貸付有価証券 2,000株
パイオラックス	21,800	1,573.00	34,291,400	貸付有価証券 200株
エイチワン	14,400	734.00	10,569,600	
日本発條	146,500	822.00	120,423,000	貸付有価証券 400株
中央発條	7,100	1,132.00	8,037,200	貸付有価証券 100株
アドバネクス	2,100	1,200.00	2,520,000	
立川ブラインド工業	6,500	1,305.00	8,482,500	
三益半導体工業	11,500	2,487.00	28,600,500	貸付有価証券 100株
日本ドライケミカル	3,600	2,125.00	7,650,000	貸付有価証券 1,600株
日本製鋼所	44,600	2,919.00	130,187,400	
三浦工業	63,700	4,975.00	316,907,500	
タクマ	49,800	1,710.00	85,158,000	
ツガミ	30,500	1,828.00	55,754,000	
オークマ	17,100	5,660.00	96,786,000	
芝浦機械	15,200	2,742.00	41,678,400	
アマダ	215,600	1,205.00	259,798,000	
アイダエンジニアリング	38,500	1,130.00	43,505,000	
滝澤鉄工所	4,300	1,109.00	4,768,700	
F U J I	58,700	2,991.00	175,571,700	
牧野フライス製作所	17,200	4,355.00	74,906,000	
オーエスジー	68,000	2,090.00	142,120,000	貸付有価証券 1,900株

ダイジェット工業	1,700	1,175.00	1,997,500	
旭ダイヤモンド工業	38,600	538.00	20,766,800	
DMG森精機	87,300	2,109.00	184,115,700	貸付有価証券 1,500株
ソディック	32,600	936.00	30,513,600	
ディスコ	20,000	33,650.00	673,000,000	
日東工器	7,000	1,983.00	13,881,000	
日進工具	11,600	1,458.00	16,912,800	貸付有価証券 200株（200株）
パンチ工業	12,300	592.00	7,281,600	
富士ダイス	7,400	681.00	5,039,400	
豊和工業	8,100	840.00	6,804,000	
OKK	5,600	388.00	2,172,800	
東洋機械金属	10,500	500.00	5,250,000	
津田駒工業	2,800	856.00	2,396,800	
エンシュウ	3,500	833.00	2,915,500	
島精機製作所	21,500	2,285.00	49,127,500	
オプトラン	18,400	2,377.00	43,736,800	貸付有価証券 100株
NCホールディングス	4,400	1,032.00	4,540,800	
イワキポンプ	9,300	967.00	8,993,100	
フリーー	14,400	1,585.00	22,824,000	貸付有価証券 100株
ヤマシンフィルタ	29,700	661.00	19,631,700	貸付有価証券 5,800株（100株）
日阪製作所	18,100	889.00	16,090,900	
やまびこ	28,500	1,318.00	37,563,000	貸付有価証券 2,600株
野村マイクロ・サイエンス	3,200	5,510.00	17,632,000	貸付有価証券 600株
平田機工	7,000	6,840.00	47,880,000	
ペガサスミシン製造	14,900	420.00	6,258,000	
マルマエ	6,000	2,106.00	12,636,000	貸付有価証券 1,300株（1,200株）
タツモ	6,900	1,736.00	11,978,400	
ナプテスコ	83,900	4,760.00	399,364,000	貸付有価証券 14,700株
三井海洋開発	15,600	1,725.00	26,910,000	
レオン自動機	14,400	1,540.00	22,176,000	

SMC	43,600	76,790.00	3,348,044,000	
ホソカワミクロン	5,200	6,750.00	35,100,000	
ユニオンツール	5,500	4,045.00	22,247,500	
オイレス工業	20,600	1,699.00	34,999,400	貸付有価証券 1,800株
日精エー・エス・ビー機 械	5,000	4,445.00	22,225,000	
サトーホールディングス	19,400	2,790.00	54,126,000	
技研製作所	13,000	4,825.00	62,725,000	
日本エアテック	6,800	1,264.00	8,595,200	貸付有価証券 3,100株（1,300株）
カワタ	4,000	914.00	3,656,000	貸付有価証券 300株
日精樹脂工業	11,300	1,190.00	13,447,000	
オカダアイヨン	4,600	1,324.00	6,090,400	
ワイエイシイホールディ ングス	5,900	959.00	5,658,100	貸付有価証券 500株
小松製作所	674,000	2,859.00	1,926,966,000	
住友重機械工業	85,100	3,075.00	261,682,500	
日立建機	69,500	3,375.00	234,562,500	
日工	22,200	681.00	15,118,200	
巴工業	5,800	2,307.00	13,380,600	
井関農機	13,800	1,743.00	24,053,400	
TOWA	13,900	2,940.00	40,866,000	
丸山製作所	3,000	1,664.00	4,992,000	
北川鉄工所	6,700	1,643.00	11,008,100	
ローツェ	6,500	9,020.00	58,630,000	
タカキタ	5,200	658.00	3,421,600	貸付有価証券 2,400株
クボタ	725,600	2,469.50	1,791,869,200	貸付有価証券 9,900株
荏原実業	6,800	2,659.00	18,081,200	
三菱化工機	4,800	2,490.00	11,952,000	
月島機械	27,400	1,207.00	33,071,800	
帝国電機製作所	10,400	1,349.00	14,029,600	
東京機械製作所	6,000	1,958.00	11,748,000	貸付有価証券 2,800株
新東工業	35,300	800.00	28,240,000	貸付有価証券 100株

澁谷工業	13,000	3,165.00	41,145,000	貸付有価証券 100株
アイチ コーポレーショ ン	25,300	771.00	19,506,300	
小森コーポレーション	37,700	858.00	32,346,600	貸付有価証券 100株
鶴見製作所	11,400	1,779.00	20,280,600	
住友精密工業	2,200	2,429.00	5,343,800	
日本ギア工業	5,900	304.00	1,793,600	
酒井重工業	2,600	2,545.00	6,617,000	
荏原製作所	61,700	6,220.00	383,774,000	貸付有価証券 2,100株
石井鐵工所	2,100	3,005.00	6,310,500	
西島製作所	14,800	952.00	14,089,600	
北越工業	15,300	1,065.00	16,294,500	
ダイキン工業	189,500	29,085.00	5,511,607,500	貸付有価証券 400株
オルガノ	4,800	6,550.00	31,440,000	
トーヨーカネツ	5,600	2,530.00	14,168,000	
栗田工業	80,500	5,390.00	433,895,000	貸付有価証券 2,500株
椿本チエイン	21,200	3,510.00	74,412,000	
大同工業	7,100	1,070.00	7,597,000	
木村化工機	12,400	763.00	9,461,200	貸付有価証券 5,800株
アネスト岩田	25,100	1,055.00	26,480,500	
ダイフク	81,900	10,860.00	889,434,000	貸付有価証券 2,300株
サムコ	3,700	3,175.00	11,747,500	貸付有価証券 700株
加藤製作所	8,100	918.00	7,435,800	
油研工業	2,500	1,788.00	4,470,000	
タダノ	71,800	1,253.00	89,965,400	
フジテック	51,200	2,992.00	153,190,400	
C K D	34,500	2,505.00	86,422,500	
キトー	12,500	1,741.00	21,762,500	
平和	41,500	2,027.00	84,120,500	貸付有価証券 300株
理想科学工業	10,900	2,355.00	25,669,500	貸付有価証券

				100株
SANKYO	35,400	2,824.00	99,969,600	貸付有価証券 200株
日本金銭機械	16,400	601.00	9,856,400	
マースグループホールディングス	9,400	1,703.00	16,008,200	貸付有価証券 100株
フクシマガリレイ	10,200	4,930.00	50,286,000	
オーイズミ	6,200	384.00	2,380,800	
ダイコク電機	6,800	1,193.00	8,112,400	貸付有価証券 500株（500株）
竹内製作所	24,900	2,766.00	68,873,400	
アマノ	38,900	2,872.00	111,720,800	
JUKI	20,700	793.00	16,415,100	
蛇の目ミシン工業	13,500	725.00	9,787,500	貸付有価証券 2,400株
マックス	19,900	1,959.00	38,984,100	
グローリー	38,200	2,378.00	90,839,600	
新晃工業	13,800	2,212.00	30,525,600	
大和冷機工業	21,500	1,259.00	27,068,500	貸付有価証券 1,300株
セガサミーホールディングス	135,200	1,558.00	210,641,600	
日本ピストンリング	5,400	1,453.00	7,846,200	
リケン	6,900	2,950.00	20,355,000	
T P R	20,000	1,520.00	30,400,000	
ツバキ・ナカシマ	32,600	1,586.00	51,703,600	貸付有価証券 4,300株
ホシザキ	43,500	10,670.00	464,145,000	貸付有価証券 100株
大豊工業	12,100	870.00	10,527,000	
日本精工	305,500	771.00	235,540,500	貸付有価証券 4,300株
NTN	344,300	254.00	87,452,200	貸付有価証券 44,900株
ジェイテクト	142,700	980.00	139,846,000	貸付有価証券 100株
不二越	12,700	4,555.00	57,848,500	
日本トムソン	40,700	595.00	24,216,500	
THK	86,500	2,704.00	233,896,000	貸付有価証券 7,300株

ユーシン精機	9,900	852.00	8,434,800	
前澤給装工業	10,400	1,068.00	11,107,200	
イーグル工業	18,400	1,283.00	23,607,200	
前澤工業	8,900	804.00	7,155,600	
日本ピラー工業	15,000	2,636.00	39,540,000	貸付有価証券 400株
キッツ	50,100	841.00	42,134,100	
マキタ	194,000	6,790.00	1,317,260,000	貸付有価証券 4,900株
日立造船	117,900	854.00	100,686,600	貸付有価証券 3,200株
三菱重工業	233,700	2,999.50	700,983,150	
I H I	100,000	2,609.00	260,900,000	
スター精密	22,900	1,609.00	36,846,100	
日清紡ホールディングス	91,000	948.00	86,268,000	貸付有価証券 4,800株
イビデン	71,600	6,530.00	467,548,000	
コニカミノルタ	301,800	594.00	179,269,200	
ブラザー工業	181,700	2,433.00	442,076,100	
ミネベアミツミ	256,400	2,971.00	761,764,400	貸付有価証券 4,000株
日立製作所	715,200	6,607.00	4,725,326,400	
東芝	294,400	4,750.00	1,398,400,000	貸付有価証券 15,000株
三菱電機	1,487,500	1,535.50	2,284,056,250	
富士電機	89,600	4,955.00	443,968,000	
東洋電機製造	5,800	1,110.00	6,438,000	
安川電機	160,100	5,880.00	941,388,000	貸付有価証券 9,500株
シンフォニアテクノロジー	19,300	1,234.00	23,816,200	
明電舎	25,200	2,522.00	63,554,400	
オリジン	4,000	1,298.00	5,192,000	
山洋電気	7,200	7,350.00	52,920,000	
デンヨー	12,700	2,079.00	26,403,300	
東芝テック	16,000	4,850.00	77,600,000	貸付有価証券 100株
芝浦メカトロニクス	2,600	7,330.00	19,058,000	
マブチモーター	34,800	3,935.00	136,938,000	貸付有価証券

				400株
日本電産	358,000	13,040.00	4,668,320,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,700	828.00	6,375,600	貸付有価証券 2,500株（600株）
トレックス・セミコンダクター	8,000	2,776.00	22,208,000	
東光高岳	7,500	1,531.00	11,482,500	
ダブル・スコープ	42,800	885.00	37,878,000	貸付有価証券 20,000株（2,700株）
ダイヘン	16,300	4,925.00	80,277,500	
ヤーマン	24,300	1,128.00	27,410,400	
JVCケンウッド	128,800	216.00	27,820,800	
ミマキエンジニアリング	13,300	926.00	12,315,800	
IPEX	6,900	2,098.00	14,476,200	
日新電機	34,900	1,281.00	44,706,900	貸付有価証券 500株
大崎電気工業	29,600	570.00	16,872,000	
オムロン	123,800	11,270.00	1,395,226,000	
日東工業	21,800	1,764.00	38,455,200	
IDEC	19,900	2,333.00	46,426,700	
正興電機製作所	4,700	1,472.00	6,918,400	貸付有価証券 200株
不二電機工業	2,500	1,273.00	3,182,500	
ジーエス・ユアサコーポレーション	53,500	2,630.00	140,705,000	
サクサホールディングス	3,500	1,368.00	4,788,000	
メルコホールディングス	5,100	5,090.00	25,959,000	
テクノメディカ	3,300	1,658.00	5,471,400	貸付有価証券 1,500株
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	4,500	2,546.00	11,457,000	貸付有価証券 1,900株
日本電気	189,000	6,080.00	1,149,120,000	
富士通	133,800	21,485.00	2,874,693,000	
沖電気工業	60,400	1,008.00	60,883,200	
岩崎通信機	6,500	904.00	5,876,000	
電気興業	7,200	2,320.00	16,704,000	
サンケン電気	17,400	5,690.00	99,006,000	貸付有価証券 500株（500株）
ナカヨ	2,900	1,417.00	4,109,300	

アイホン	8,400	2,229.00	18,723,600	
ルネサスエレクトロニクス	803,400	1,290.00	1,036,386,000	貸付有価証券 12,100株
セイコーエプソン	184,600	2,227.00	411,104,200	
ワコム	107,700	728.00	78,405,600	貸付有価証券 47,900株
アルバック	27,400	6,350.00	173,990,000	貸付有価証券 2,100株
アクセル	6,200	776.00	4,811,200	
E I Z O	12,600	4,380.00	55,188,000	
日本信号	34,700	939.00	32,583,300	
京三製作所	31,900	472.00	15,056,800	貸付有価証券 100株
能美防災	19,700	2,106.00	41,488,200	
ホーチキ	10,800	1,188.00	12,830,400	
星和電機	6,700	524.00	3,510,800	
エレコム	34,100	1,908.00	65,062,800	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
パナソニック	1,586,400	1,374.50	2,180,506,800	貸付有価証券 300株
シャープ	197,800	1,460.00	288,788,000	貸付有価証券 22,000株
アンリツ	89,400	2,000.00	178,800,000	貸付有価証券 42,000株（1,000株）
富士通ゼネラル	45,400	2,949.00	133,884,600	
ソニーグループ	931,800	11,950.00	11,135,010,000	貸付有価証券 7,500株
T D K	71,800	12,290.00	882,422,000	
帝国通信工業	6,600	1,509.00	9,959,400	
タムラ製作所	53,500	785.00	41,997,500	貸付有価証券 4,700株（3,300株）
アルプスアルパイン	121,500	1,276.00	155,034,000	
池上通信機	4,700	795.00	3,736,500	
日本電波工業	14,400	909.00	13,089,600	
鈴木	6,700	872.00	5,842,400	貸付有価証券 1,600株
メイコー	11,100	2,946.00	32,700,600	貸付有価証券 400株
日本トリム	3,200	3,805.00	12,176,000	
ローランド ディー.	8,800	3,125.00	27,500,000	貸付有価証券

ジー.				1,800株
フォスター電機	15,000	954.00	14,310,000	
SMK	3,800	2,442.00	9,279,600	
ヨコオ	12,100	2,725.00	32,972,500	
ティアック	9,400	123.00	1,156,200	
ホシデン	38,900	953.00	37,071,700	
ヒロセ電機	22,900	19,260.00	441,054,000	貸付有価証券 100株
日本航空電子工業	34,100	1,662.00	56,674,200	
TOA	17,500	862.00	15,085,000	
マクセルホールディングス	29,600	1,329.00	39,338,400	
古野電気	19,100	1,119.00	21,372,900	貸付有価証券 100株
ユニデンホールディングス	3,500	2,797.00	9,789,500	
スミダコーポレーション	13,900	1,329.00	18,473,100	
アイコム	6,200	2,465.00	15,283,000	
リオン	6,200	2,700.00	16,740,000	
本多通信工業	11,500	472.00	5,428,000	貸付有価証券 5,400株
横河電機	148,900	1,888.00	281,123,200	
新電元工業	5,700	4,190.00	23,883,000	
アズビル	100,600	5,130.00	516,078,000	
東亜ディーケーケー	7,300	873.00	6,372,900	貸付有価証券 3,300株
日本光電工業	61,500	3,840.00	236,160,000	
チノー	4,700	1,495.00	7,026,500	
共和電業	14,300	389.00	5,562,700	
日本電子材料	6,100	1,966.00	11,992,600	貸付有価証券 2,800株（300株）
堀場製作所	27,500	8,070.00	221,925,000	貸付有価証券 1,800株
アドバンテスト	110,600	10,400.00	1,150,240,000	
小野測器	6,200	565.00	3,503,000	
エスベック	13,200	2,266.00	29,911,200	
キーエンス	146,000	69,260.00	10,111,960,000	
日置電機	7,100	9,410.00	66,811,000	
シスメックス	116,100	14,110.00	1,638,171,000	

日本マイクロニクス	25,900	1,541.00	39,911,900	貸付有価証券 200株
メガチップス	14,900	3,420.00	50,958,000	貸付有価証券 100株
OBARA GROUP	6,700	3,950.00	26,465,000	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
澤藤電機	1,600	2,048.00	3,276,800	
原田工業	6,000	939.00	5,634,000	
コーセル	18,100	1,047.00	18,950,700	
イリソ電子工業	12,500	4,675.00	58,437,500	
オブテックスグループ	24,400	1,568.00	38,259,200	貸付有価証券 1,100株
千代田インテグレ	6,200	1,934.00	11,990,800	
アイ・オー・データ機器	5,500	920.00	5,060,000	
レーザーテック	65,300	27,520.00	1,797,056,000	貸付有価証券 3,000株
スタンレー電気	104,100	2,802.00	291,688,200	
岩崎電気	5,400	2,003.00	10,816,200	
ウシオ電機	76,200	2,123.00	161,772,600	
岡谷電機産業	10,600	365.00	3,869,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	13,700	333.00	4,562,100	
エノモト	4,100	1,744.00	7,150,400	
日本セラミック	13,800	3,075.00	42,435,000	
遠藤照明	7,500	930.00	6,975,000	
古河電池	10,600	1,651.00	17,500,600	貸付有価証券 4,900株
双信電機	7,200	852.00	6,134,400	貸付有価証券 400株
山一電機	9,700	1,718.00	16,664,600	貸付有価証券 200株
図研	9,700	4,005.00	38,848,500	
日本電子	27,100	8,850.00	239,835,000	貸付有価証券 6,000株（900株）
カシオ計算機	119,600	1,783.00	213,246,800	貸付有価証券 7,100株
ファナック	130,500	26,030.00	3,396,915,000	貸付有価証券 600株
日本シイエムケイ	32,000	420.00	13,440,000	貸付有価証券 700株

エンプラス	6,700	3,335.00	22,344,500	貸付有価証券 100株
大真空	5,000	3,740.00	18,700,000	
ローム	61,800	11,240.00	694,632,000	
浜松ホトニクス	106,700	6,820.00	727,694,000	
三井ハイテック	14,600	7,260.00	105,996,000	貸付有価証券 400株
新光電気工業	49,900	4,020.00	200,598,000	
京セラ	226,700	7,330.00	1,661,711,000	
太陽誘電	66,200	7,030.00	465,386,000	
村田製作所	437,000	9,763.00	4,266,431,000	
双葉電子工業	25,500	805.00	20,527,500	
北陸電気工業	5,600	1,033.00	5,784,800	
ニチコン	46,800	1,144.00	53,539,200	貸付有価証券 400株
日本ケミコン	15,000	2,242.00	33,630,000	
K O A	20,600	1,749.00	36,029,400	
市光工業	17,800	711.00	12,655,800	貸付有価証券 300株
小糸製作所	89,100	6,900.00	614,790,000	貸付有価証券 900株
ミツバ	27,400	669.00	18,330,600	貸付有価証券 200株
S C R E E Nホールディ ングス	25,800	10,110.00	260,838,000	
キャノン電子	13,600	1,630.00	22,168,000	
キャノン	739,200	2,649.00	1,958,140,800	貸付有価証券 42,700株
リコー	378,400	1,139.00	430,997,600	貸付有価証券 11,300株
象印マホービン	40,200	1,765.00	70,953,000	貸付有価証券 500株
M U T O Hホールディン グス	1,900	1,591.00	3,022,900	貸付有価証券 200株
東京エレクトロン	87,100	50,180.00	4,370,678,000	貸付有価証券 100株
トヨタ紡織	43,300	2,108.00	91,276,400	
芦森工業	2,800	1,050.00	2,940,000	
ユニプレス	24,400	948.00	23,131,200	
豊田自動織機	120,400	9,830.00	1,183,532,000	

モリタホールディングス	23,800	1,630.00	38,794,000	
三櫻工業	20,600	1,107.00	22,804,200	
デンソー	327,500	7,935.00	2,598,712,500	
東海理化電機製作所	39,200	1,653.00	64,797,600	
三井E & Sホールディングス	57,600	477.00	27,475,200	貸付有価証券 8,200株
川崎重工業	116,300	2,440.00	283,772,000	
名村造船所	44,700	228.00	10,191,600	貸付有価証券 9,200株
サノヤスホールディングス	18,200	144.00	2,620,800	
日本車輛製造	5,400	2,135.00	11,529,000	
三菱ロジスネクスト	19,700	1,049.00	20,665,300	貸付有価証券 6,300株
近畿車輛	2,600	1,130.00	2,938,000	
日産自動車	1,754,300	572.20	1,003,810,460	貸付有価証券 433,900株
いすゞ自動車	395,000	1,467.00	579,465,000	
トヨタ自動車	1,507,000	9,962.00	15,012,734,000	貸付有価証券 3,300株
日野自動車	185,800	1,001.00	185,985,800	
三菱自動車工業	550,600	285.00	156,921,000	貸付有価証券 230,900株（7,100株）
エフテック	10,400	642.00	6,676,800	
レシップホールディングス	5,900	586.00	3,457,400	
GMB	2,700	887.00	2,394,900	
ファルテック	2,600	743.00	1,931,800	
武蔵精密工業	33,200	2,018.00	66,997,600	
日産車体	21,800	757.00	16,502,600	
新明和工業	42,000	948.00	39,816,000	
極東開発工業	25,700	1,733.00	44,538,100	
トピー工業	12,200	1,234.00	15,054,800	貸付有価証券 100株
ティラド	4,600	3,295.00	15,157,000	
タチエス	22,800	1,410.00	32,148,000	貸付有価証券 100株
NOK	72,000	1,386.00	99,792,000	
フタバ産業	37,200	492.00	18,302,400	貸付有価証券

				100株
K Y B	16,600	3,195.00	53,037,000	
大同メタル工業	30,700	604.00	18,542,800	
プレス工業	73,700	361.00	26,605,700	
ミクニ	18,900	322.00	6,085,800	
太平洋工業	31,100	1,268.00	39,434,800	
河西工業	20,100	396.00	7,959,600	
アイシン	108,900	4,335.00	472,081,500	
マツダ	466,900	969.00	452,426,100	貸付有価証券 17,300株
今仙電機製作所	13,000	710.00	9,230,000	
本田技研工業	1,171,200	3,382.00	3,960,998,400	
スズキ	294,900	4,925.00	1,452,382,500	
S U B A R U	426,300	2,063.50	879,670,050	
安永	7,200	1,158.00	8,337,600	
ヤマハ発動機	194,100	2,928.00	568,324,800	貸付有価証券 400株
T B K	17,700	415.00	7,345,500	
エクセディ	20,200	1,739.00	35,127,800	貸付有価証券 600株
豊田合成	48,000	2,366.00	113,568,000	
愛三工業	23,300	860.00	20,038,000	
盟和産業	2,300	1,045.00	2,403,500	
日本プラスト	12,500	644.00	8,050,000	貸付有価証券 100株
ヨロズ	12,700	1,264.00	16,052,800	
エフ・シー・シー	24,300	1,595.00	38,758,500	
シマノ	59,900	33,420.00	2,001,858,000	貸付有価証券 800株
テイ・エス テック	69,100	1,545.00	106,759,500	
ジャムコ	8,700	1,014.00	8,821,800	貸付有価証券 400株（300株）
テルモ	456,000	5,040.00	2,298,240,000	貸付有価証券 400株
クリエートメディック	4,500	981.00	4,414,500	
日機装	44,600	930.00	41,478,000	貸付有価証券 700株
日本エム・ディ・エム	8,600	2,301.00	19,788,600	
島津製作所	191,400	5,270.00	1,008,678,000	貸付有価証券

				1,700株
JMS	12,600	825.00	10,395,000	
クボテック	3,800	304.00	1,155,200	貸付有価証券 100株（100株）
長野計器	10,800	1,171.00	12,646,800	貸付有価証券 200株
ブイ・テクノロジー	7,000	4,870.00	34,090,000	
東京計器	9,500	1,034.00	9,823,000	
愛知時計電機	2,000	4,695.00	9,390,000	
インターアクション	7,400	2,820.00	20,868,000	貸付有価証券 500株
オーバル	13,300	279.00	3,710,700	
東京精密	25,100	5,040.00	126,504,000	
マニー	59,300	2,308.00	136,864,400	貸付有価証券 1,000株
ニコン	227,100	1,249.00	283,647,900	
トプコン	74,900	1,909.00	142,984,100	
オリンパス	780,100	2,427.00	1,893,302,700	
理研計器	13,100	2,990.00	39,169,000	
タムロン	11,500	2,624.00	30,176,000	貸付有価証券 1,400株
HOYA	290,300	17,980.00	5,219,594,000	
シード	5,800	704.00	4,083,200	
ノーリツ銅機	13,400	2,809.00	37,640,600	
エー・アンド・デイ	12,500	1,158.00	14,475,000	
朝日インテック	162,700	3,315.00	539,350,500	貸付有価証券 13,800株
シチズン時計	188,700	500.00	94,350,000	貸付有価証券 200株
リズム	4,600	1,329.00	6,113,400	
大研医器	11,800	601.00	7,091,800	
メニコン	22,900	8,820.00	201,978,000	貸付有価証券 1,200株
シンシア	1,600	642.00	1,027,200	
松風	6,800	2,037.00	13,851,600	
セイコーホールディングス	21,000	2,261.00	47,481,000	貸付有価証券 900株
ニプロ	110,900	1,293.00	143,393,700	
中本パックス	3,800	1,838.00	6,984,400	

スノーピーク	9,700	5,240.00	50,828,000	貸付有価証券 800株
パラマウントベッドホールディングス	28,500	2,210.00	62,985,000	
トランザクション	8,100	1,164.00	9,428,400	貸付有価証券 2,900株
粧美堂	4,300	419.00	1,801,700	貸付有価証券 2,000株
ニホンフラッシュ	12,700	1,264.00	16,052,800	
前田工織	16,400	3,340.00	54,776,000	貸付有価証券 300株
永大産業	19,400	308.00	5,975,200	
アートネイチャー	14,300	728.00	10,410,400	貸付有価証券 100株
バンダイナムコホールディングス	123,000	8,349.00	1,026,927,000	
アイフィスジャパン	3,800	705.00	2,679,000	
共立印刷	24,900	172.00	4,282,800	貸付有価証券 100株
SHOEI	14,000	5,130.00	71,820,000	
フランスベッドホールディングス	19,100	950.00	18,145,000	
パイロットコーポレーション	25,100	4,345.00	109,059,500	貸付有価証券 100株
萩原工業	9,600	1,518.00	14,572,800	貸付有価証券 1,400株
トッパン・フォームズ	26,600	1,036.00	27,557,600	
フジシールインターナショナル	30,600	2,612.00	79,927,200	
タカラトミー	66,700	1,121.00	74,770,700	
廣済堂	10,400	1,066.00	11,086,400	貸付有価証券 1,500株
エステールホールディングス	4,000	668.00	2,672,000	貸付有価証券 1,800株
タカノ	5,100	772.00	3,937,200	貸付有価証券 2,300株
プロネクサス	11,900	1,075.00	12,792,500	
ホクシン	9,200	163.00	1,499,600	貸付有価証券 4,300株
ウッドワン	5,000	1,166.00	5,830,000	
大建工業	10,000	2,377.00	23,770,000	

凸版印刷	226,100	1,959.00	442,929,900	
大日本印刷	175,800	2,703.00	475,187,400	
共同印刷	4,600	2,655.00	12,213,000	
N I S S H A	30,500	1,814.00	55,327,000	
光村印刷	1,300	1,675.00	2,177,500	
TAKARA & CO MPANY	7,300	1,794.00	13,096,200	貸付有価証券 2,200株
アシックス	131,500	2,546.00	334,799,000	貸付有価証券 18,200株
ツツミ	3,700	2,403.00	8,891,100	貸付有価証券 700株
ローランド	10,300	5,540.00	57,062,000	貸付有価証券 200株（200株）
小松ウオール工業	4,500	1,960.00	8,820,000	
ヤマハ	88,500	7,160.00	633,660,000	
河合楽器製作所	4,200	4,220.00	17,724,000	
クリナップ	13,800	583.00	8,045,400	
ピジョン	89,900	3,235.00	290,826,500	貸付有価証券 42,200株
兼松サステック	1,000	1,811.00	1,811,000	
キングジム	12,000	886.00	10,632,000	貸付有価証券 200株
リンテック	31,800	2,530.00	80,454,000	
イトーキ	27,400	362.00	9,918,800	
任天堂	85,100	55,140.00	4,692,414,000	
三菱鉛筆	24,500	1,475.00	36,137,500	
タカラスタンダード	30,700	1,680.00	51,576,000	
コクヨ	71,300	1,937.00	138,108,100	貸付有価証券 5,300株
ナカバヤシ	14,600	595.00	8,687,000	
グローブライド	7,200	8,090.00	58,248,000	貸付有価証券 600株（600株）
オカムラ	51,100	1,687.00	86,205,700	
美津濃	14,700	2,600.00	38,220,000	
東京電力ホールディング ス	1,261,700	287.00	362,107,900	貸付有価証券 401,000株
中部電力	455,100	1,324.50	602,779,950	
関西電力	563,600	1,073.50	605,024,600	
中国電力	214,600	1,029.00	220,823,400	

北陸電力	136,000	585.00	79,560,000	
東北電力	348,400	837.00	291,610,800	
四国電力	123,600	771.00	95,295,600	
九州電力	328,500	840.00	275,940,000	貸付有価証券 700株
北海道電力	139,200	511.00	71,131,200	
沖縄電力	28,900	1,430.00	41,327,000	
電源開発	118,400	1,632.00	193,228,800	貸付有価証券 100株
エフオン	9,000	889.00	8,001,000	貸付有価証券 3,400株（1,300株）
イーレックス	21,900	2,465.00	53,983,500	貸付有価証券 6,800株（6,800株）
レノバ	25,300	4,900.00	123,970,000	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
東京瓦斯	286,100	2,172.50	621,552,250	
大阪瓦斯	269,400	2,110.00	568,434,000	
東邦瓦斯	73,200	5,220.00	382,104,000	貸付有価証券 900株
北海道瓦斯	8,000	1,570.00	12,560,000	
広島ガス	30,700	381.00	11,696,700	
西部ガスホールディングス	16,700	2,499.00	41,733,300	
静岡ガス	38,700	1,337.00	51,741,900	貸付有価証券 100株
メタウォーター	16,700	1,862.00	31,095,400	
S B Sホールディングス	11,000	4,005.00	44,055,000	
東武鉄道	155,000	2,856.00	442,680,000	貸付有価証券 100株
相鉄ホールディングス	51,000	2,140.00	109,140,000	貸付有価証券 1,300株
東急	375,200	1,480.00	555,296,000	
京浜急行電鉄	191,000	1,310.00	250,210,000	
小田急電鉄	238,300	2,544.00	606,235,200	貸付有価証券 3,300株
京王電鉄	83,100	5,950.00	494,445,000	
京成電鉄	111,500	3,430.00	382,445,000	
富士急行	20,300	4,510.00	91,553,000	貸付有価証券 4,500株（100株）
新京成電鉄	3,800	2,152.00	8,177,600	

東日本旅客鉄道	261,800	6,918.00	1,811,132,400	
西日本旅客鉄道	132,500	5,111.00	677,207,500	貸付有価証券 14,600株
東海旅客鉄道	123,700	15,675.00	1,938,997,500	
西武ホールディングス	179,300	1,332.00	238,827,600	
鴻池運輸	23,700	1,380.00	32,706,000	
西日本鉄道	41,200	2,741.00	112,929,200	貸付有価証券 200株
ハマキョウレックス	11,400	3,355.00	38,247,000	
サカイ引越センター	6,800	4,800.00	32,640,000	
近鉄グループホールディングス	140,900	3,585.00	505,126,500	貸付有価証券 1,000株
阪急阪神ホールディングス	187,900	3,380.00	635,102,000	
南海電気鉄道	66,800	2,327.00	155,443,600	
京阪ホールディングス	62,700	3,105.00	194,683,500	
神戸電鉄	3,400	3,590.00	12,206,000	貸付有価証券 1,500株
名古屋鉄道	115,800	1,959.00	226,852,200	貸付有価証券 4,700株
山陽電気鉄道	10,100	2,010.00	20,301,000	貸付有価証券 4,700株
アルプス物流	9,800	993.00	9,731,400	貸付有価証券 5,400株（5,400株）
日本通運	48,800	7,950.00	387,960,000	貸付有価証券 1,500株
ヤマトホールディングス	197,400	2,847.00	561,997,800	
山九	36,100	5,240.00	189,164,000	
丸運	8,000	276.00	2,208,000	
丸全昭和運輸	11,400	3,425.00	39,045,000	
センコーグループホールディングス	77,700	1,012.00	78,632,400	貸付有価証券 4,900株（3,700株）
トナミホールディングス	3,400	5,070.00	17,238,000	
ニッコンホールディングス	47,300	2,349.00	111,107,700	
日本石油輸送	1,500	2,649.00	3,973,500	
福山通運	18,000	4,785.00	86,130,000	
セイノーホールディングス	105,500	1,388.00	146,434,000	貸付有価証券 300株
エスライン	3,800	925.00	3,515,000	

神奈川中央交通	3,500	3,510.00	12,285,000	貸付有価証券 100株
日立物流	29,000	4,660.00	135,140,000	
丸和運輸機関	29,700	1,667.00	49,509,900	貸付有価証券 9,100株
C & F ロジホールディングス	14,200	1,796.00	25,503,200	
九州旅客鉄道	109,000	2,490.00	271,410,000	
S G ホールディングス	266,200	3,050.00	811,910,000	貸付有価証券 400株
日本郵船	117,800	9,830.00	1,157,974,000	
商船三井	83,600	8,980.00	750,728,000	
川崎汽船	43,400	5,820.00	252,588,000	貸付有価証券 4,600株
N S ユナイテッド海運	6,600	3,845.00	25,377,000	
明治海運	15,000	766.00	11,490,000	貸付有価証券 3,800株（3,100株）
飯野海運	65,400	551.00	36,035,400	貸付有価証券 300株
共栄タンカー	2,500	1,054.00	2,635,000	
乾汽船	9,600	2,472.00	23,731,200	貸付有価証券 1,400株
日本航空	343,200	2,422.00	831,230,400	貸付有価証券 1,400株
A N A ホールディングス	380,200	2,634.50	1,001,636,900	貸付有価証券 3,500株
パスコ	2,700	1,487.00	4,014,900	
トランコム	4,300	8,500.00	36,550,000	
日新	11,200	1,563.00	17,505,600	
三菱倉庫	48,700	3,255.00	158,518,500	貸付有価証券 100株
三井倉庫ホールディングス	14,900	2,719.00	40,513,100	
住友倉庫	49,800	1,860.00	92,628,000	
澁澤倉庫	7,700	2,216.00	17,063,200	
東陽倉庫	23,600	344.00	8,118,400	
日本トランスシティ	31,000	635.00	19,685,000	
ケイヒン	2,700	1,421.00	3,836,700	
中央倉庫	8,600	1,017.00	8,746,200	
川西倉庫	2,600	1,160.00	3,016,000	貸付有価証券

				1,200株
安田倉庫	11,600	962.00	11,159,200	
ファイズホールディングス	2,500	781.00	1,952,500	
東洋埠頭	4,300	1,505.00	6,471,500	
宇徳	10,000	557.00	5,570,000	
上組	77,500	2,416.00	187,240,000	
サンリツ	3,600	790.00	2,844,000	
キムラユニティー	3,800	1,400.00	5,320,000	貸付有価証券 1,700株
キューソー流通システム	3,500	1,794.00	6,279,000	貸付有価証券 1,600株
近鉄エクスプレス	26,600	2,750.00	73,150,000	
東海運	8,000	332.00	2,656,000	
エーアイテイー	8,800	1,083.00	9,530,400	
内外トランスライン	5,400	2,156.00	11,642,400	貸付有価証券 200株
日本コンセプト	4,500	2,035.00	9,157,500	
NEC ネットエスアイ	48,300	2,161.00	104,376,300	
クロスキャット	3,800	1,122.00	4,263,600	
システナ	52,100	2,318.00	120,767,800	
デジタルアーツ	8,500	9,280.00	78,880,000	
日鉄ソリューションズ	21,100	3,920.00	82,712,000	
キューブシステム	7,400	1,148.00	8,495,200	貸付有価証券 3,400株
WOW WORLD	2,200	1,738.00	3,823,600	貸付有価証券 1,000株
コア	6,200	1,524.00	9,448,800	
ラクーンホールディングス	10,300	1,618.00	16,665,400	貸付有価証券 4,300株（800株）
ソリトンシステムズ	7,300	1,538.00	11,227,400	貸付有価証券 100株（100株）
ソフトクリエイイトホールディングス	5,700	3,185.00	18,154,500	
T I S	146,000	3,225.00	470,850,000	
J N Sホールディングス	7,200	529.00	3,808,800	
グリー	89,500	664.00	59,428,000	貸付有価証券 9,400株
GMOペパボ	1,500	3,685.00	5,527,500	貸付有価証券

				600株（100株）
コーエーテクモホールディングス	38,800	5,190.00	201,372,000	貸付有価証券 100株
三菱総合研究所	6,300	4,360.00	27,468,000	
ボルテージ	3,900	445.00	1,735,500	
電算	1,600	2,345.00	3,752,000	
A G S	7,400	892.00	6,600,800	
ファインデックス	12,300	1,061.00	13,050,300	
ブレインパッド	3,800	5,670.00	21,546,000	貸付有価証券 100株（100株）
K L a b	26,800	682.00	18,277,600	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	19,400	1,052.00	20,408,800	
イーブックイニシアティブジャパン	2,400	3,785.00	9,084,000	貸付有価証券 1,000株
ネクソン	328,700	2,218.00	729,056,600	貸付有価証券 2,200株
アイスタイル	44,500	437.00	19,446,500	貸付有価証券 4,300株
エムアップホールディングス	3,800	3,010.00	11,438,000	貸付有価証券 100株
エイチーム	10,100	1,512.00	15,271,200	
エニグモ	13,800	1,533.00	21,155,400	貸付有価証券 200株
テクノスジャパン	11,300	642.00	7,254,600	貸付有価証券 400株
e n i s h	9,000	498.00	4,482,000	貸付有価証券 2,100株
コロプラ	47,900	845.00	40,475,500	貸付有価証券 700株
オルトプラス	11,300	454.00	5,130,200	貸付有価証券 2,600株（1,200株）
ブロードリーフ	72,300	532.00	38,463,600	貸付有価証券 43,600株
クロス・マーケティンググループ	5,500	902.00	4,961,000	貸付有価証券 2,500株（1,800株）
デジタルハーツホールディングス	6,600	2,048.00	13,516,800	
システム情報	10,900	1,001.00	10,910,900	貸付有価証券 5,100株

メディアドゥ	5,700	5,130.00	29,241,000	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
じげん	36,100	425.00	15,342,500	
ブイキューブ	14,800	1,810.00	26,788,000	貸付有価証券 6,900株（2,100株）
エンカレッジ・テクノロジー	2,600	631.00	1,640,600	
サイバーリンクス	4,800	1,593.00	7,646,400	貸付有価証券 1,300株（900株）
ディー・エル・イー	11,700	320.00	3,744,000	貸付有価証券 2,700株（700株）
フィックスターズ	15,500	810.00	12,555,000	貸付有価証券 500株
CARTA HOLDINGS	5,800	2,272.00	13,177,600	貸付有価証券 3,500株（3,500株）
オブティム	10,200	2,114.00	21,562,800	貸付有価証券 4,600株（1,500株）
セレス	5,300	3,300.00	17,490,000	貸付有価証券 1,200株（1,100株）
SHIFT	7,300	26,120.00	190,676,000	貸付有価証券 3,200株（3,100株）
ティーガイア	15,500	2,000.00	31,000,000	
セック	2,100	2,444.00	5,132,400	
テクマトリックス	22,600	1,991.00	44,996,600	
プロシップ	4,300	1,599.00	6,875,700	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	39,600	2,227.00	88,189,200	貸付有価証券 1,700株
GMOペイメントゲートウェイ	28,300	14,970.00	423,651,000	貸付有価証券 6,200株
ザッパラス	5,700	585.00	3,334,500	
システムリサーチ	4,200	2,026.00	8,509,200	貸付有価証券 1,900株
インターネットイニシアティブ	38,900	3,960.00	154,044,000	
さくらインターネット	15,600	637.00	9,937,200	貸付有価証券 7,300株
ヴィンクス	4,100	1,035.00	4,243,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,200	5,160.00	16,512,000	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
SRAホールディングス	7,700	2,855.00	21,983,500	
システムインテグレータ	4,100	650.00	2,665,000	貸付有価証券

				1,900株
朝日ネット	11,800	741.00	8,743,800	
e B A S E	17,400	813.00	14,146,200	
アバント	15,600	1,502.00	23,431,200	
アドソル日進	5,200	2,252.00	11,710,400	
ODKソリューションズ	3,000	755.00	2,265,000	
フリービット	8,700	838.00	7,290,600	貸付有価証券 3,800株（2,000株）
コムチュア	13,400	3,040.00	40,736,000	
サイバーコム	2,200	1,331.00	2,928,200	貸付有価証券 200株
アステリア	10,500	696.00	7,308,000	貸付有価証券 3,800株（400株）
アイル	8,100	1,724.00	13,964,400	
マークラインズ	7,300	2,946.00	21,505,800	
メディカル・データ・ビ ジョン	18,500	1,706.00	31,561,000	
g u m i	20,200	1,025.00	20,705,000	貸付有価証券 3,800株（3,700株）
ショーケース	3,200	676.00	2,163,200	貸付有価証券 600株
モバイルファクトリー	3,300	1,066.00	3,517,800	貸付有価証券 1,400株（700株）
テラスカイ	4,700	2,170.00	10,199,000	貸付有価証券 2,800株（1,000株）
デジタル・インフォメー ション・テクノロジ	6,400	2,020.00	12,928,000	
P C I ホールディングス	6,500	1,121.00	7,286,500	
パイプドHD	3,000	2,402.00	7,206,000	
アイビーシー	2,400	856.00	2,054,400	
ネオジャパン	2,800	1,535.00	4,298,000	貸付有価証券 1,200株（300株）
P R T I M E S	3,100	3,160.00	9,796,000	貸付有価証券 600株（200株）
ラクス	43,900	3,915.00	171,868,500	
ランドコンピュータ	2,200	1,254.00	2,758,800	
ダブルスタンダード	1,900	7,750.00	14,725,000	
オープンドア	8,700	2,312.00	20,114,400	貸付有価証券 4,100株（2,100株）
マイネット	5,200	699.00	3,634,800	貸付有価証券

				2,400株（100株）
アカツキ	5,800	3,290.00	19,082,000	
ベネフィットジャパン	1,100	2,366.00	2,602,600	
Ubicomホールディングス	3,800	3,035.00	11,533,000	
カナミックネットワーク	15,600	628.00	9,796,800	貸付有価証券 100株
ノムラシステムコーポレーション	7,500	301.00	2,257,500	
チェンジ	26,900	2,414.00	64,936,600	貸付有価証券 12,600株（600株）
シンクロ・フード	8,700	409.00	3,558,300	
オークネット	7,700	1,976.00	15,215,200	
キャピタル・アセット・プランニング	2,900	1,029.00	2,984,100	
セグエグループ	3,800	824.00	3,131,200	
エイトレッド	2,800	2,447.00	6,851,600	貸付有価証券 1,300株
AOI TYO Holdings	3,400	898.00	3,053,200	貸付有価証券 1,400株（100株）
マクロミル	29,800	795.00	23,691,000	貸付有価証券 100株
ビーグリー	3,400	1,467.00	4,987,800	貸付有価証券 100株（100株）
オロ	4,600	3,875.00	17,825,000	
ユーザーローカル	4,400	1,919.00	8,443,600	
テモナ	3,200	812.00	2,598,400	貸付有価証券 1,500株（900株）
ニーズウェル	3,100	723.00	2,241,300	
マネーフォワード	22,100	9,090.00	200,889,000	貸付有価証券 4,000株（3,000株）
サインポスト	3,500	703.00	2,460,500	貸付有価証券 500株
電算システムホールディングス	6,000	2,768.00	16,608,000	
ソルクシーズ	6,200	1,014.00	6,286,800	貸付有価証券 300株
フェイス	4,500	690.00	3,105,000	
プロトコーポレーション	17,400	1,565.00	27,231,000	
ハイマックス	4,100	1,101.00	4,514,100	

野村総合研究所	253,600	4,335.00	1,099,356,000	
サイバネットシステム	10,400	704.00	7,321,600	
C Eホールディングス	7,700	595.00	4,581,500	貸付有価証券 3,600株
日本システム技術	2,700	1,826.00	4,930,200	
インテージホールディングス	18,200	1,597.00	29,065,400	貸付有価証券 100株
東邦システムサイエンス	3,800	963.00	3,659,400	貸付有価証券 1,700株
ソースネクスト	69,200	235.00	16,262,000	貸付有価証券 16,000株（15,600株）
インフォコム	13,300	2,521.00	33,529,300	
HEROZ	4,200	2,041.00	8,572,200	
ラクスル	15,900	5,940.00	94,446,000	貸付有価証券 700株
I P S	3,400	2,185.00	7,429,000	貸付有価証券 300株
F I G	15,800	282.00	4,455,600	
システムサポート	4,300	1,374.00	5,908,200	
イーソル	8,900	935.00	8,321,500	貸付有価証券 2,100株
アルテリア・ネットワークス	16,200	1,768.00	28,641,600	
E d u L a b	1,400	3,115.00	4,361,000	
東海ソフト	2,300	1,288.00	2,962,400	
ウイングアーク 1 s t	8,100	2,361.00	19,124,100	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	3,300	1,894.00	6,250,200	貸付有価証券 200株
サーバーワークス	1,400	3,845.00	5,383,000	貸付有価証券 600株
東名	1,400	1,170.00	1,638,000	
ヴィッツ	1,300	1,624.00	2,111,200	
トビラシステムズ	2,900	1,300.00	3,770,000	貸付有価証券 700株（600株）
S a n s a n	13,000	11,810.00	153,530,000	貸付有価証券 2,300株（2,300株）
L i n k - U	2,600	1,575.00	4,095,000	貸付有価証券 1,200株（900株）
ギフトィ	12,700	3,665.00	46,545,500	貸付有価証券 5,400株（1,500株）

ベース	2,500	4,970.00	12,425,000	
フォーカスシステムズ	9,800	1,044.00	10,231,200	
クレスコ	9,600	2,017.00	19,363,200	
フジ・メディア・ホールディングス	151,400	1,181.00	178,803,400	貸付有価証券 500株
オービック	46,000	22,200.00	1,021,200,000	
ジャストシステム	20,800	6,730.00	139,984,000	
TDCソフト	12,800	1,398.00	17,894,400	
Zホールディングス	2,005,600	740.30	1,484,745,680	貸付有価証券 100株
トレンドマイクロ	78,000	6,280.00	489,840,000	貸付有価証券 1,600株
IDホールディングス	8,300	951.00	7,893,300	
日本オラクル	29,600	9,470.00	280,312,000	
アルファシステムズ	3,900	3,940.00	15,366,000	
フューチャー	15,400	2,530.00	38,962,000	
CAC Holdings	8,500	1,696.00	14,416,000	
SBテクノロジー	5,200	3,105.00	16,146,000	
トーセ	3,900	787.00	3,069,300	
オービックビジネスコンサルティング	13,900	5,290.00	73,531,000	貸付有価証券 5,600株（1,100株）
伊藤忠テクノソリューションズ	66,500	3,530.00	234,745,000	
アイティフォー	19,000	883.00	16,777,000	貸付有価証券 400株
東計電算	1,700	4,820.00	8,194,000	
エックスネット	2,300	1,052.00	2,419,600	
大塚商会	79,000	5,940.00	469,260,000	貸付有価証券 100株
サイボウズ	19,500	2,522.00	49,179,000	貸付有価証券 300株
電通国際情報サービス	21,100	4,465.00	94,211,500	
ACCESS	18,200	976.00	17,763,200	
デジタルガレージ	24,100	5,120.00	123,392,000	
EMシステムズ	24,100	821.00	19,786,100	
ウェザーニューズ	4,400	5,850.00	25,740,000	
C I J	9,400	873.00	8,206,200	
ビジネスエンジニアリング	1,500	3,505.00	5,257,500	

ダ				
日本エンタープライズ	14,800	213.00	3,152,400	貸付有価証券 100株
WOWOW	7,000	2,448.00	17,136,000	貸付有価証券 3,200株
スカラ	13,000	744.00	9,672,000	
インテリジェント ウェ イブ	8,500	639.00	5,431,500	
I M A G I C A G R O U P	12,400	533.00	6,609,200	貸付有価証券 800株（800株）
ネットワンシステムズ	59,600	3,640.00	216,944,000	
システムソフト	30,200	201.00	6,070,200	貸付有価証券 14,100株
アルゴグラフィックス	11,400	3,405.00	38,817,000	
マーベラス	23,000	713.00	16,399,000	
エイベックス	25,100	1,501.00	37,675,100	
日本ユニシス	50,600	3,090.00	156,354,000	
兼松エレクトロニクス	7,900	3,885.00	30,691,500	
都築電気	6,500	1,845.00	11,992,500	
T B S ホールディングス	96,800	1,658.00	160,494,400	
日本テレビホールディン グス	121,800	1,226.00	149,326,800	
朝日放送グループホール ディングス	14,500	724.00	10,498,000	
テレビ朝日ホールディン グス	45,100	1,746.00	78,744,600	貸付有価証券 1,300株
スカパー J S A T ホール ディングス	96,100	422.00	40,554,200	貸付有価証券 800株
テレビ東京ホールディン グス	10,400	2,141.00	22,266,400	貸付有価証券 100株
日本 B S 放送	4,900	1,119.00	5,483,100	貸付有価証券 100株
ビジョン	24,900	1,268.00	31,573,200	
スマートバリュー	3,800	720.00	2,736,000	貸付有価証券 1,700株
U S E N - N E X T H O L D I N G S	13,900	3,120.00	43,368,000	貸付有価証券 1,300株（1,200株）
ワイヤレスゲート	6,000	427.00	2,562,000	貸付有価証券 700株
コネクシオ	8,300	1,573.00	13,055,900	

日本通信	129,000	241.00	31,089,000	貸付有価証券 200株
クロップス	2,700	985.00	2,659,500	
日本電信電話	1,707,300	3,221.00	5,499,213,300	
KDDI	1,170,600	3,669.00	4,294,931,400	
ソフトバンク	1,326,500	1,535.50	2,036,840,750	
光通信	17,200	20,600.00	354,320,000	
エムティーアイ	14,100	722.00	10,180,200	貸付有価証券 1,000株
GMOインターネット	51,700	3,005.00	155,358,500	
ファイバーゲート	4,700	1,627.00	7,646,900	貸付有価証券 100株
アйдママーケティング コミュニケーション	3,700	384.00	1,420,800	
KADOKAWA	37,800	5,390.00	203,742,000	
学研ホールディングス	20,600	1,252.00	25,791,200	
ゼンリン	26,500	1,070.00	28,355,000	
昭文社ホールディングス	5,900	512.00	3,020,800	
インプレスホールディン グス	12,100	277.00	3,351,700	
アイネット	7,500	1,419.00	10,642,500	
松竹	9,700	11,680.00	113,296,000	貸付有価証券 500株（500株）
東宝	86,100	5,110.00	439,971,000	貸付有価証券 100株
東映	4,800	21,180.00	101,664,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	388,600	2,156.00	837,821,600	
ピー・シー・エー	2,100	5,450.00	11,445,000	貸付有価証券 100株
ビジネスブレイン太田昭 和	5,000	1,726.00	8,630,000	
DTS	30,300	2,665.00	80,749,500	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	62,200	6,680.00	415,496,000	
シーイーシー	15,600	1,577.00	24,601,200	
カプコン	125,100	3,340.00	417,834,000	貸付有価証券 2,900株
アイ・エス・ピー	6,800	1,249.00	8,493,200	貸付有価証券 100株

ジャステック	8,400	1,264.00	10,617,600	
S C S K	33,700	7,270.00	244,999,000	
日本システムウエア	4,800	2,424.00	11,635,200	
アイネス	14,300	1,615.00	23,094,500	
T K C	24,700	3,865.00	95,465,500	
富士ソフト	15,600	5,870.00	91,572,000	
N S D	46,900	2,098.00	98,396,200	
コナミホールディングス	53,000	7,410.00	392,730,000	
福井コンピュータホールディングス	6,700	4,535.00	30,384,500	貸付有価証券 100株
J B C Cホールディングス	9,900	1,567.00	15,513,300	
ミロク情報サービス	14,500	1,671.00	24,229,500	
ソフトバンクグループ	1,158,300	6,320.00	7,320,456,000	
ハウスイ	1,200	951.00	1,141,200	
高千穂交易	5,600	1,205.00	6,748,000	貸付有価証券 2,100株
オルパヘルスケアホールディングス	2,400	1,564.00	3,753,600	
伊藤忠食品	3,500	5,380.00	18,830,000	
エレマテック	11,700	1,182.00	13,829,400	
J A L U X	4,100	1,762.00	7,224,200	貸付有価証券 1,900株
あらた	11,700	4,430.00	51,831,000	
トーメンデバイス	1,900	5,430.00	10,317,000	貸付有価証券 800株（100株）
東京エレクトロン デバイス	4,800	5,810.00	27,888,000	
フィールズ	12,800	494.00	6,323,200	
双日	809,200	340.00	275,128,000	貸付有価証券 2,200株
アルフレッサ ホールディングス	152,000	1,798.00	273,296,000	
横浜冷凍	41,100	908.00	37,318,800	
神栄	2,000	1,110.00	2,220,000	
ラサ商事	7,800	919.00	7,168,200	
アルコニックス	15,600	1,685.00	26,286,000	
神戸物産	113,700	4,350.00	494,595,000	貸付有価証券 4,000株

ハイパー	3,600	540.00	1,944,000	
あい ホールディングス	20,900	2,365.00	49,428,500	
ディーブイエックス	4,500	1,046.00	4,707,000	
ダイワボウホールディングス	66,800	2,088.00	139,478,400	
マクニカ・富士エレホールディングス	34,900	2,728.00	95,207,200	
ラクト・ジャパン	5,000	2,776.00	13,880,000	
グリムス	4,300	2,923.00	12,568,900	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,400	820.00	20,828,000	
八洲電機	11,300	1,005.00	11,356,500	貸付有価証券 5,300株
メディアスホールディングス	8,300	924.00	7,669,200	貸付有価証券 600株
レスターホールディングス	15,300	1,958.00	29,957,400	
ジューテックホールディングス	3,300	1,119.00	3,692,700	
大光	5,600	695.00	3,892,000	貸付有価証券 2,600株
OCHIホールディングス	4,200	1,285.00	5,397,000	
TOKAIホールディングス	71,000	917.00	65,107,000	貸付有価証券 700株
黒谷	4,000	829.00	3,316,000	貸付有価証券 1,600株
Cominix	2,500	725.00	1,812,500	
三洋貿易	14,700	1,213.00	17,831,100	
ビューティガレージ	2,400	4,805.00	11,532,000	貸付有価証券 800株
ウイン・パートナーズ	10,600	994.00	10,536,400	
ミタチ産業	4,000	800.00	3,200,000	
シップヘルスケアホールディングス	51,700	2,890.00	149,413,000	貸付有価証券 300株
明治電機工業	5,000	1,353.00	6,765,000	
デリカフーズホールディングス	5,700	661.00	3,767,700	貸付有価証券 2,600株
スターティアホールディングス	2,800	1,795.00	5,026,000	貸付有価証券 1,300株
コメダホールディングス	32,000	2,060.00	65,920,000	貸付有価証券

				2,600株
ピーバンドットコム	2,000	695.00	1,390,000	
アセンテック	3,800	1,283.00	4,875,400	貸付有価証券 1,700株
富士興産	4,400	988.00	4,347,200	
協栄産業	1,600	1,440.00	2,304,000	
小野建	13,100	1,614.00	21,143,400	貸付有価証券 3,400株（1,200株）
南陽	3,000	2,007.00	6,021,000	
佐島電機	9,100	875.00	7,962,500	
エコートレーディング	3,100	650.00	2,015,000	
伯東	8,900	1,862.00	16,571,800	
コンドーテック	11,300	1,014.00	11,458,200	
中山福	8,400	423.00	3,553,200	
ナガイレーベン	19,400	2,620.00	50,828,000	
三菱食品	16,100	2,928.00	47,140,800	貸付有価証券 400株（400株）
松田産業	10,700	3,035.00	32,474,500	貸付有価証券 200株
第一興商	27,800	3,780.00	105,084,000	
メディパルホールディングス	146,800	2,174.00	319,143,200	
S P K	6,300	1,385.00	8,725,500	
萩原電気ホールディングス	5,400	2,337.00	12,619,800	
アズワン	10,500	17,480.00	183,540,000	
スズデン	5,100	1,535.00	7,828,500	
尾家産業	4,300	1,134.00	4,876,200	
シモジマ	9,000	1,133.00	10,197,000	
ドウシシャ	13,800	1,779.00	24,550,200	
小津産業	3,200	1,928.00	6,169,600	
高速	7,700	1,640.00	12,628,000	
たけびし	5,100	1,600.00	8,160,000	貸付有価証券 2,300株
リックス	3,300	1,552.00	5,121,600	
丸文	13,000	808.00	10,504,000	
ハピネット	12,200	1,491.00	18,190,200	貸付有価証券 1,900株（1,800株）
橋本総業ホールディング	3,000	2,249.00	6,747,000	

ス				
日本ライフライン	47,300	1,379.00	65,226,700	
タカショー	9,500	1,077.00	10,231,500	貸付有価証券 1,700株
マルカ	5,200	2,643.00	13,743,600	
I DOM	49,400	991.00	48,955,400	
進和	8,700	2,348.00	20,427,600	貸付有価証券 200株（200株）
エスケイジャパン	3,500	475.00	1,662,500	
ダイトロン	6,200	2,345.00	14,539,000	
シークス	20,900	1,306.00	27,295,400	
田中商事	4,500	660.00	2,970,000	
オーハシテクニカ	7,500	1,483.00	11,122,500	
白銅	5,200	2,778.00	14,445,600	貸付有価証券 2,400株
ダイコー通産	1,700	1,311.00	2,228,700	
伊藤忠商事	1,024,700	3,394.00	3,477,831,800	
丸紅	1,444,700	900.70	1,301,241,290	
高島	2,300	1,840.00	4,232,000	
長瀬産業	80,400	1,897.00	152,518,800	
蝶理	9,300	1,906.00	17,725,800	
豊田通商	147,200	5,030.00	740,416,000	
三共生興	22,200	536.00	11,899,200	
兼松	58,500	1,436.00	84,006,000	
ツカモトコーポレーショ ン	2,400	1,423.00	3,415,200	
三井物産	1,168,800	2,506.00	2,929,012,800	
日本紙パルプ商事	7,600	3,850.00	29,260,000	
カメイ	19,100	1,214.00	23,187,400	
東都水産	1,700	6,310.00	10,727,000	貸付有価証券 700株
OUGホールディングス	2,300	2,993.00	6,883,900	貸付有価証券 1,000株
スターゼン	10,800	2,287.00	24,699,600	
山善	57,200	1,123.00	64,235,600	貸付有価証券 3,500株（3,000株）
椿本興業	2,700	3,825.00	10,327,500	
住友商事	924,600	1,592.50	1,472,425,500	

内田洋行	6,300	5,410.00	34,083,000	貸付有価証券 600株
三菱商事	892,000	3,437.00	3,065,804,000	
第一実業	6,700	4,885.00	32,729,500	
キャノンマーケティング ジャパン	36,300	2,552.00	92,637,600	貸付有価証券 4,800株
西華産業	7,700	1,705.00	13,128,500	
佐藤商事	12,100	1,238.00	14,979,800	
菱洋エレクトロ	11,100	2,345.00	26,029,500	貸付有価証券 1,200株（100株）
東京産業	13,200	709.00	9,358,800	
ユアサ商事	15,000	3,065.00	45,975,000	
神鋼商事	3,300	3,345.00	11,038,500	
トルク	7,800	234.00	1,825,200	
阪和興業	29,300	3,465.00	101,524,500	
正栄食品工業	9,500	4,250.00	40,375,000	貸付有価証券 4,400株
カナデン	11,900	1,048.00	12,471,200	
菱電商事	10,500	1,836.00	19,278,000	
フルサト工業	7,400	2,046.00	15,140,400	
岩谷産業	35,200	6,390.00	224,928,000	
ナイス	5,800	1,930.00	11,194,000	
ニチモウ	2,300	2,100.00	4,830,000	
極東貿易	4,200	2,541.00	10,672,200	貸付有価証券 200株
アステナホールディング ス	20,600	623.00	12,833,800	
三愛石油	36,100	1,430.00	51,623,000	
稲畑産業	35,200	1,750.00	61,600,000	
G S I クレオス	7,200	1,044.00	7,516,800	貸付有価証券 3,300株
明和産業	13,500	1,286.00	17,361,000	
クワザワホールディング ス	5,200	624.00	3,244,800	
ヤマエ久野	10,700	1,153.00	12,337,100	
ワキタ	28,800	1,041.00	29,980,800	
東邦ホールディングス	47,000	1,955.00	91,885,000	
サンゲツ	39,400	1,634.00	64,379,600	
ミツウロコグループホー	21,600	1,380.00	29,808,000	

ルディングス				
シナネンホールディングス	5,400	3,535.00	19,089,000	
伊藤忠エネクス	32,400	1,003.00	32,497,200	
サンリオ	41,100	2,352.00	96,667,200	貸付有価証券 300株
サンワテクノス	9,600	1,470.00	14,112,000	
リョーサン	16,200	2,375.00	38,475,000	
新光商事	19,700	834.00	16,429,800	
トーヨー	6,600	1,618.00	10,678,800	
三信電気	7,800	1,703.00	13,283,400	貸付有価証券 400株
東陽テクニカ	14,500	1,200.00	17,400,000	
モスフードサービス	20,700	3,320.00	68,724,000	貸付有価証券 4,500株
加賀電子	13,300	3,035.00	40,365,500	
ソーダニッカ	13,900	577.00	8,020,300	
立花エレクトック	10,800	1,559.00	16,837,200	貸付有価証券 3,500株
フォーバル	5,100	1,053.00	5,370,300	
PAL TAC	23,500	4,790.00	112,565,000	
三谷産業	19,300	387.00	7,469,100	
太平洋興発	5,800	651.00	3,775,800	
西本Wismettac ホールディングス	3,300	3,945.00	13,018,500	
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,300	1,854.00	2,410,200	
コーア商事ホールディン グス	11,000	685.00	7,535,000	貸付有価証券 2,000株
国際紙パルプ商事	31,200	373.00	11,637,600	貸付有価証券 100株
ヤマタネ	6,300	1,598.00	10,067,400	
丸紅建材リース	1,400	1,879.00	2,630,600	
日鉄物産	10,400	5,130.00	53,352,000	
泉州電業	4,100	4,675.00	19,167,500	
トラスコ中山	30,500	2,969.00	90,554,500	貸付有価証券 200株
オートバックスセブン	53,100	1,555.00	82,570,500	貸付有価証券 100株
モリト	10,700	685.00	7,329,500	貸付有価証券

				300株
加藤産業	21,100	3,435.00	72,478,500	
北恵	3,700	1,029.00	3,807,300	
イノテック	8,200	1,474.00	12,086,800	
イエローハット	27,700	1,952.00	54,070,400	
J Kホールディングス	13,200	842.00	11,114,400	貸付有価証券 7,800株
日伝	12,100	2,467.00	29,850,700	
北沢産業	9,900	241.00	2,385,900	
杉本商事	7,400	2,739.00	20,268,600	
因幡電機産業	39,100	2,800.00	109,480,000	
東テク	4,800	2,667.00	12,801,600	
ミスミグループ本社	183,800	4,645.00	853,751,000	
アルテック	9,800	329.00	3,224,200	
タキヒヨー	4,800	1,844.00	8,851,200	
蔵王産業	2,800	1,670.00	4,676,000	
スズケン	62,000	3,370.00	208,940,000	
ジェコス	10,100	902.00	9,110,200	
グローセル	15,900	424.00	6,741,600	
ローソン	37,100	5,520.00	204,792,000	
サンエー	11,100	4,125.00	45,787,500	
カワチ薬品	10,200	2,308.00	23,541,600	
エービーシー・マート	22,900	5,940.00	136,026,000	貸付有価証券 1,600株
ハードオフコーポレーション	6,400	779.00	4,985,600	
アスクル	23,700	1,709.00	40,503,300	貸付有価証券 200株
ゲオホールディングス	19,600	1,201.00	23,539,600	貸付有価証券 300株（300株）
アダストリア	20,300	1,884.00	38,245,200	貸付有価証券 200株
ジーフット	8,800	408.00	3,590,400	貸付有価証券 4,100株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,100	412.00	865,200	貸付有価証券 900株
くら寿司	15,300	4,120.00	63,036,000	貸付有価証券 100株
キャンドゥ	7,000	1,951.00	13,657,000	貸付有価証券

				3,300株（1,000株）
アイケイ	4,200	615.00	2,583,000	貸付有価証券 400株
パルグループホールディングス	12,800	1,716.00	21,964,800	貸付有価証券 400株
エディオン	62,100	1,080.00	67,068,000	貸付有価証券 7,400株
サーラコーポレーション	29,700	624.00	18,532,800	
ワッツ	7,100	880.00	6,248,000	貸付有価証券 3,300株
ハローズ	5,900	3,060.00	18,054,000	
フジオフードグループ本社	12,400	1,357.00	16,826,800	
あみやき亭	3,200	2,900.00	9,280,000	
ひらまつ	26,900	206.00	5,541,400	貸付有価証券 2,100株
大黒天物産	4,700	7,120.00	33,464,000	貸付有価証券 1,900株（500株）
ハニーズホールディングス	11,600	1,113.00	12,910,800	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	3,600	780.00	2,808,000	貸付有価証券 1,600株
アルペン	11,200	3,640.00	40,768,000	
ハブ	4,700	745.00	3,501,500	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
クオールホールディングス	19,800	1,580.00	31,284,000	
ジンズホールディングス	10,000	7,380.00	73,800,000	貸付有価証券 800株
ビックカメラ	86,900	1,080.00	93,852,000	貸付有価証券 26,300株（1,900株）
DCMホールディングス	90,400	1,083.00	97,903,200	貸付有価証券 2,400株
Monotaro	185,200	2,499.00	462,814,800	貸付有価証券 8,700株
東京一番フーズ	3,700	598.00	2,212,600	貸付有価証券 1,700株
DDホールディングス	7,500	474.00	3,555,000	貸付有価証券 3,500株（100株）
きちりホールディングス	3,900	617.00	2,406,300	
アークランドサービス	10,700	2,270.00	24,289,000	貸付有価証券

ホールディングス				3,800株
J. フロント リテイ リング	174,900	990.00	173,151,000	貸付有価証券 7,000株
ドトール・日レスホール ディングス	23,200	1,659.00	38,488,800	
マツモトキヨシホール ディングス	60,600	5,220.00	316,332,000	貸付有価証券 1,300株
ブロンコビリー	8,400	2,459.00	20,655,600	
Z O Z O	86,400	4,245.00	366,768,000	貸付有価証券 500株
トレジャー・ファクト リー	4,300	941.00	4,046,300	
物語コーポレーション	7,800	6,880.00	53,664,000	貸付有価証券 1,100株（500株）
ココカラファイン	13,100	8,830.00	115,673,000	貸付有価証券 5,500株
三越伊勢丹ホールディ ングス	256,400	770.00	197,428,000	貸付有価証券 300株
H a m e e	3,800	1,642.00	6,239,600	貸付有価証券 1,800株
マーケットエンタープラ イズ	900	880.00	792,000	貸付有価証券 300株（300株）
ウエルシアホールディ ングス	77,500	3,925.00	304,187,500	貸付有価証券 200株
クリエイト S D ホール ディングス	21,600	3,930.00	84,888,000	貸付有価証券 2,000株（400株）
丸善 C H I ホールディ ングス	17,100	388.00	6,634,800	貸付有価証券 8,100株
ミサワ	3,000	700.00	2,100,000	
ティーライフ	2,000	1,644.00	3,288,000	
エー・ピーホールディ ングス	2,700	457.00	1,233,900	
チムニー	4,500	1,487.00	6,691,500	貸付有価証券 2,100株
シュッピン	10,000	1,200.00	12,000,000	貸付有価証券 300株
オイシックス・ラ・大地	19,300	3,875.00	74,787,500	
ネクステージ	29,600	2,220.00	65,712,000	
ジョイフル本田	42,900	1,485.00	63,706,500	貸付有価証券 19,300株
鳥貴族ホールディングス	5,400	1,851.00	9,995,400	

ホットランド	10,900	1,315.00	14,333,500	貸付有価証券 600株（300株）
すかいらくホールディングス	189,100	1,574.00	297,643,400	貸付有価証券 88,800株
SFPホールディングス	7,100	1,377.00	9,776,700	貸付有価証券 3,300株
綿半ホールディングス	11,000	1,273.00	14,003,000	
ヨシックスホールディングス	2,900	2,189.00	6,348,100	貸付有価証券 1,300株
ユナイテッド・スーパー マーケット・ホール	42,600	1,114.00	47,456,400	貸付有価証券 1,800株
ゴルフダイジェスト・オ ンライン	7,600	1,406.00	10,685,600	
BEENOS	7,400	2,961.00	21,911,400	貸付有価証券 500株
あさひ	10,900	1,400.00	15,260,000	貸付有価証券 4,800株（100株）
日本調剤	8,900	1,745.00	15,530,500	
コスモス薬品	14,800	19,740.00	292,152,000	貸付有価証券 1,200株
トーエル	7,100	872.00	6,191,200	
オンリー	2,500	763.00	1,907,500	貸付有価証券 700株
セブン&アイ・ホール ディングス	573,100	4,952.00	2,837,991,200	
クリエイト・レストラン ツ・ホールディング	78,700	863.00	67,918,100	貸付有価証券 17,200株（1,600株）
ツルハホールディングス	32,000	13,840.00	442,880,000	
サンマルクホールディン グス	11,600	1,560.00	18,096,000	
フェリシモ	3,200	1,495.00	4,784,000	貸付有価証券 1,400株（300株）
トリドールホールディン グス	36,300	2,343.00	85,050,900	貸付有価証券 17,000株
TOKYO BASE	13,300	625.00	8,312,500	
ウイルプラスホールディ ングス	2,300	981.00	2,256,300	
JMホールディングス	9,900	2,295.00	22,720,500	貸付有価証券 1,000株
サツドラホールディン グス	2,200	2,158.00	4,747,600	
アレンザホールディン グ	11,200	1,410.00	15,792,000	

ス				
串カツ田中ホールディングス	3,900	2,102.00	8,197,800	
バロックジャパンリミテッド	10,200	874.00	8,914,800	
クスリのアオキホールディングス	14,600	7,920.00	115,632,000	貸付有価証券 900株（100株）
力の源ホールディングス	6,700	609.00	4,080,300	貸付有価証券 2,200株
FOOD & LIFE COMPANIE	85,800	4,965.00	425,997,000	
メディカルシステムネットワーク	12,700	782.00	9,931,400	
はるやまホールディングス	6,900	580.00	4,002,000	
ノジマ	26,100	2,821.00	73,628,100	貸付有価証券 200株
カッパ・クリエイト	20,500	1,392.00	28,536,000	貸付有価証券 9,600株（200株）
ライトオン	10,900	721.00	7,858,900	貸付有価証券 3,100株（3,100株）
良品計画	168,600	2,485.00	418,971,000	貸付有価証券 9,800株
三城ホールディングス	18,100	269.00	4,868,900	
アドヴァングループ	14,900	936.00	13,946,400	
アルビス	4,700	2,408.00	11,317,600	
コナカ	17,300	361.00	6,245,300	
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,649.00	2,968,200	貸付有価証券 800株
G-7ホールディングス	7,100	4,190.00	29,749,000	貸付有価証券 100株（100株）
イオン北海道	19,300	1,207.00	23,295,100	
コジマ	25,200	671.00	16,909,200	貸付有価証券 12,200株
ヒマラヤ	5,100	1,340.00	6,834,000	貸付有価証券 2,300株
コーナン商事	20,800	3,750.00	78,000,000	
エコス	5,400	2,008.00	10,843,200	
ワタミ	19,300	959.00	18,508,700	貸付有価証券 9,000株
マルシェ	3,900	484.00	1,887,600	貸付有価証券

				1,800株
パン・パシフィック・インターナショナルホ	292,900	2,127.00	622,998,300	
西松屋チェーン	32,100	1,389.00	44,586,900	貸付有価証券 14,600株
ゼンショーホールディングス	78,700	2,775.00	218,392,500	貸付有価証券 3,800株
幸楽苑ホールディングス	9,300	1,502.00	13,968,600	貸付有価証券 700株（700株）
ハークスレイ	3,100	1,013.00	3,140,300	
サイゼリヤ	21,700	2,587.00	56,137,900	貸付有価証券 600株
VTホールディングス	55,100	572.00	31,517,200	貸付有価証券 200株
魚力	4,600	2,185.00	10,051,000	貸付有価証券 2,100株
ポプラ	3,800	225.00	855,000	
フジ・コーポレーション	7,700	1,252.00	9,640,400	貸付有価証券 600株
ユナイテッドアローズ	16,700	1,804.00	30,126,800	
ハイデイ日高	21,100	1,679.00	35,426,900	貸付有価証券 11,100株
京都きもの友禅	9,300	254.00	2,362,200	
コロワイド	50,100	1,783.00	89,328,300	貸付有価証券 22,800株（1,600株）
ピーシーデポコーポレーション	17,000	477.00	8,109,000	貸付有価証券 3,800株
壱番屋	10,300	4,820.00	49,646,000	貸付有価証券 100株
トップカルチャー	5,300	348.00	1,844,400	
P L A N T	3,700	742.00	2,745,400	
スギホールディングス	29,200	8,260.00	241,192,000	貸付有価証券 200株
薬王堂ホールディングス	6,400	2,501.00	16,006,400	
スクロール	20,900	895.00	18,705,500	貸付有価証券 1,500株
ヨンドシーホールディングス	13,500	1,799.00	24,286,500	貸付有価証券 300株
木曽路	19,100	2,299.00	43,910,900	貸付有価証券 8,900株
S R S ホールディングス	19,400	828.00	16,063,200	貸付有価証券

				9,100株（7,800株）
千趣会	26,400	389.00	10,269,600	
タカキュー	11,300	133.00	1,502,900	
リテールパートナーズ	17,800	1,271.00	22,623,800	
ケーヨー	27,100	829.00	22,465,900	貸付有価証券 6,800株
上新電機	16,800	2,547.00	42,789,600	貸付有価証券 300株
日本瓦斯	71,200	1,584.00	112,780,800	貸付有価証券 3,600株（3,600株）
ロイヤルホールディングス	25,100	1,999.00	50,174,900	貸付有価証券 11,000株
東天紅	1,100	1,114.00	1,225,400	
いなげや	16,300	1,466.00	23,895,800	
チヨダ	14,300	811.00	11,597,300	貸付有価証券 900株
ライフコーポレーション	13,700	4,610.00	63,157,000	
リンガーハット	18,100	2,237.00	40,489,700	貸付有価証券 7,600株
MrMaxHD	20,100	658.00	13,225,800	
テンアライド	13,500	318.00	4,293,000	貸付有価証券 6,300株
AOKIホールディングス	28,300	657.00	18,593,100	
オークワ	23,000	1,190.00	27,370,000	貸付有価証券 9,400株
コメリ	22,600	2,588.00	58,488,800	
青山商事	32,600	692.00	22,559,200	貸付有価証券 9,200株（5,200株）
しまむら	17,000	9,710.00	165,070,000	
はせがわ	7,800	274.00	2,137,200	
高島屋	106,700	1,150.00	122,705,000	貸付有価証券 9,500株
松屋	32,000	972.00	31,104,000	
エイチ・ツー・オー リ テイリング	69,400	888.00	61,627,200	
近鉄百貨店	5,600	2,515.00	14,084,000	
丸井グループ	124,000	2,077.00	257,548,000	貸付有価証券 100株
アクシアル リテイリン	12,200	4,195.00	51,179,000	

ダ				
井筒屋	7,400	196.00	1,450,400	貸付有価証券 1,400株
イオン	563,800	3,013.00	1,698,729,400	貸付有価証券 2,900株
イズミ	29,800	3,630.00	108,174,000	貸付有価証券 1,800株
平和堂	27,000	2,264.00	61,128,000	貸付有価証券 12,300株
フジ	17,700	2,140.00	37,878,000	貸付有価証券 900株（900株）
ヤオコー	16,600	7,260.00	120,516,000	貸付有価証券 2,900株
ゼビオホールディングス	17,700	1,113.00	19,700,100	貸付有価証券 200株
ケーズホールディングス	124,700	1,219.00	152,009,300	
O l y m p i c グループ	7,600	771.00	5,859,600	
日産東京販売ホールディングス	21,500	247.00	5,310,500	
シルバーライフ	3,000	1,880.00	5,640,000	貸付有価証券 1,000株（300株）
一家ダイニングプロジェクト	3,000	537.00	1,611,000	
Genky Drug Stores	6,400	5,170.00	33,088,000	貸付有価証券 3,000株
ナルミヤ・インターナショナル	2,800	1,013.00	2,836,400	
ブックオフグループホールディングス	8,500	979.00	8,321,500	貸付有価証券 2,800株
ギフト	2,300	2,288.00	5,262,400	貸付有価証券 100株
アインホールディングス	21,300	7,220.00	153,786,000	貸付有価証券 300株
元気寿司	4,100	2,629.00	10,778,900	貸付有価証券 1,900株
ヤマダホールディングス	491,100	482.00	236,710,200	貸付有価証券 1,300株
アークランドサカモト	22,900	1,601.00	36,662,900	
ニトリホールディングス	58,100	21,100.00	1,225,910,000	貸付有価証券 300株
グルメ杵屋	10,400	998.00	10,379,200	貸付有価証券 4,800株

愛眼	11,700	224.00	2,620,800	
ケーユーホールディングス	7,600	1,032.00	7,843,200	
吉野家ホールディングス	48,100	2,070.00	99,567,000	貸付有価証券 4,700株（3,300株）
松屋フーズホールディングス	7,000	3,640.00	25,480,000	
サガミホールディングス	21,700	1,040.00	22,568,000	貸付有価証券 10,500株
関西スーパーマーケット	11,100	1,734.00	19,247,400	貸付有価証券 5,200株（5,100株）
王将フードサービス	9,700	5,940.00	57,618,000	貸付有価証券 1,600株（200株）
プレナス	16,400	2,043.00	33,505,200	
ミニストップ	10,900	1,454.00	15,848,600	
アークス	28,000	2,350.00	65,800,000	貸付有価証券 100株
バローホールディングス	29,900	2,515.00	75,198,500	
藤久	3,400	740.00	2,516,000	貸付有価証券 200株
ベルク	7,200	6,070.00	43,704,000	貸付有価証券 100株（100株）
大庄	7,800	991.00	7,729,800	貸付有価証券 2,800株
ファーストリテイリング	19,600	76,620.00	1,501,752,000	貸付有価証券 300株
サンドラッグ	55,100	3,705.00	204,145,500	
サックスパーホールディングス	12,400	557.00	6,906,800	
ヤマザワ	3,400	1,743.00	5,926,200	貸付有価証券 1,500株
やまや	3,000	2,526.00	7,578,000	貸付有価証券 1,400株
ベルーナ	31,400	865.00	27,161,000	貸付有価証券 600株
島根銀行	5,100	595.00	3,034,500	
じもとホールディングス	9,900	703.00	6,959,700	
めぶきフィナンシャルグループ	762,300	249.00	189,812,700	貸付有価証券 100株
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,400	1,613.00	29,679,200	

九州フィナンシャルグループ	299,600	427.00	127,929,200	
ゆうちょ銀行	415,700	972.00	404,060,400	貸付有価証券 193,300株
富山第一銀行	35,000	302.00	10,570,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	893,800	439.00	392,378,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	95,800	716.00	68,592,800	
三十三フィナンシャルグループ	12,700	1,490.00	18,923,000	
第四北越フィナンシャルグループ	23,900	2,761.00	65,987,900	
ひろぎんホールディングス	216,400	637.00	137,846,800	貸付有価証券 1,300株
新生銀行	119,600	1,414.00	169,114,400	貸付有価証券 5,700株
あおぞら銀行	87,400	2,657.00	232,221,800	貸付有価証券 9,900株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,036,200	614.50	6,167,244,900	貸付有価証券 18,300株
りそなホールディングス	1,693,100	436.30	738,699,530	貸付有価証券 300株
三井住友トラスト・ホールディングス	277,300	3,733.00	1,035,160,900	
三井住友フィナンシャルグループ	1,015,300	3,896.00	3,955,608,800	
千葉銀行	489,600	689.00	337,334,400	
群馬銀行	302,000	354.00	106,908,000	貸付有価証券 1,300株
武蔵野銀行	21,900	1,804.00	39,507,600	
千葉興業銀行	37,400	290.00	10,846,000	
筑波銀行	61,000	177.00	10,797,000	貸付有価証券 300株
七十七銀行	46,000	1,269.00	58,374,000	貸付有価証券 100株
青森銀行	11,400	2,144.00	24,441,600	
秋田銀行	8,800	1,467.00	12,909,600	
山形銀行	16,500	876.00	14,454,000	
岩手銀行	9,600	1,727.00	16,579,200	
東邦銀行	131,200	215.00	28,208,000	貸付有価証券

				2,400株
東北銀行	7,000	1,035.00	7,245,000	
みちのく銀行	9,400	898.00	8,441,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	132,400	2,091.00	276,848,400	貸付有価証券 100株
静岡銀行	357,300	892.00	318,711,600	貸付有価証券 200株
十六銀行	18,400	2,255.00	41,492,000	
スルガ銀行	128,700	380.00	48,906,000	貸付有価証券 600株
八十二銀行	330,500	384.00	126,912,000	
山梨中央銀行	17,000	851.00	14,467,000	
大垣共立銀行	29,000	1,953.00	56,637,000	貸付有価証券 100株
福井銀行	12,500	1,607.00	20,087,500	
北國銀行	13,600	2,159.00	29,362,400	
清水銀行	6,000	1,622.00	9,732,000	
富山銀行	2,800	2,074.00	5,807,200	
滋賀銀行	29,400	1,892.00	55,624,800	
南都銀行	21,400	2,011.00	43,035,400	貸付有価証券 100株
百五銀行	132,000	328.00	43,296,000	貸付有価証券 1,800株
京都銀行	52,500	5,010.00	263,025,000	
紀陽銀行	51,900	1,579.00	81,950,100	貸付有価証券 100株
ほくほくフィナンシャルグループ	97,700	865.00	84,510,500	貸付有価証券 200株
山陰合同銀行	92,400	573.00	52,945,200	
中国銀行	126,300	893.00	112,785,900	貸付有価証券 400株
鳥取銀行	4,700	1,149.00	5,400,300	
伊予銀行	194,400	590.00	114,696,000	貸付有価証券 400株
百十四銀行	15,600	1,591.00	24,819,600	
四国銀行	20,800	735.00	15,288,000	
阿波銀行	22,500	2,198.00	49,455,000	
大分銀行	8,400	1,793.00	15,061,200	
宮崎銀行	9,200	2,087.00	19,200,400	

佐賀銀行	8,300	1,469.00	12,192,700	
沖縄銀行	13,400	2,757.00	36,943,800	
琉球銀行	31,900	791.00	25,232,900	
セブン銀行	490,200	257.00	125,981,400	貸付有価証券 5,400株
みずほフィナンシャルグループ	1,993,600	1,587.00	3,163,843,200	
高知銀行	5,300	830.00	4,399,000	
山口フィナンシャルグループ	183,100	661.00	121,029,100	貸付有価証券 700株
長野銀行	4,800	1,158.00	5,558,400	
名古屋銀行	11,800	2,679.00	31,612,200	貸付有価証券 100株
北洋銀行	221,200	259.00	57,290,800	貸付有価証券 6,600株
愛知銀行	4,900	3,625.00	17,762,500	
中京銀行	5,300	1,397.00	7,404,100	
大光銀行	5,000	1,405.00	7,025,000	
愛媛銀行	20,500	793.00	16,256,500	
トマト銀行	5,700	1,102.00	6,281,400	
京葉銀行	62,600	442.00	27,669,200	
栃木銀行	70,900	181.00	12,832,900	
北日本銀行	4,600	1,578.00	7,258,800	
東和銀行	25,800	523.00	13,493,400	
福島銀行	16,800	245.00	4,116,000	貸付有価証券 200株
大東銀行	7,000	654.00	4,578,000	
トモニホールディングス	113,400	329.00	37,308,600	
フィデアホールディングス	142,400	127.00	18,084,800	貸付有価証券 300株
池田泉州ホールディングス	168,700	168.00	28,341,600	
F P G	49,400	707.00	34,925,800	
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,300	1,415.00	15,989,500	貸付有価証券 700株（100株）
マーキュリアホールディングス	4,900	749.00	3,670,100	
S B I ホールディングス	180,800	2,842.00	513,833,600	
日本アジア投資	12,400	271.00	3,360,400	貸付有価証券

				100株
ジャフコ グループ	18,700	7,030.00	131,461,000	貸付有価証券 4,300株（4,300株）
大和証券グループ本社	1,098,800	659.50	724,658,600	
野村ホールディングス	2,240,100	580.90	1,301,274,090	
岡三証券グループ	125,000	420.00	52,500,000	貸付有価証券 8,000株
丸三証券	43,600	649.00	28,296,400	貸付有価証券 18,200株
東洋証券	48,400	159.00	7,695,600	貸付有価証券 1,500株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	156,400	419.00	65,531,600	
光世証券	3,500	593.00	2,075,500	
水戸証券	39,200	314.00	12,308,800	貸付有価証券 200株
いちよし証券	29,400	659.00	19,374,600	貸付有価証券 700株
松井証券	71,800	828.00	59,450,400	貸付有価証券 500株
マネックスグループ	131,600	617.00	81,197,200	
極東証券	19,700	834.00	16,429,800	
岩井コスモホールディングス	15,000	1,429.00	21,435,000	貸付有価証券 200株
藍澤證券	26,300	1,107.00	29,114,100	
マネーパートナーズグループ	15,600	213.00	3,322,800	貸付有価証券 100株
スパークス・グループ	67,800	280.00	18,984,000	貸付有価証券 800株
小林洋行	4,200	274.00	1,150,800	
かんぽ生命保険	181,900	2,058.00	374,350,200	
SOMPOホールディングス	258,600	5,011.00	1,295,844,600	
アニコム ホールディングス	41,300	895.00	36,963,500	
MS&ADインシュアランスグループホール	356,300	3,769.00	1,342,894,700	貸付有価証券 200株
第一生命ホールディングス	722,100	2,342.50	1,691,519,250	貸付有価証券 1,000株
東京海上ホールディングス	483,200	5,584.00	2,698,188,800	

T & Dホールディングス	438,500	1,428.00	626,178,000	
アドバンスクリエイト	7,000	1,033.00	7,231,000	貸付有価証券 3,200株
全国保証	38,200	5,550.00	212,010,000	貸付有価証券 10,900株
あんしん保証	5,000	312.00	1,560,000	
ジェイリース	4,900	1,668.00	8,173,200	貸付有価証券 2,300株
イントラスト	4,100	706.00	2,894,600	
日本モーゲージサービス	7,500	1,093.00	8,197,500	貸付有価証券 300株（200株）
C a s a	4,100	945.00	3,874,500	貸付有価証券 1,800株
アルヒ	21,700	1,364.00	29,598,800	貸付有価証券 8,800株
プレミアグループ	6,800	3,530.00	24,004,000	
クレディセゾン	85,600	1,282.00	109,739,200	貸付有価証券 1,900株
芙蓉総合リース	15,400	7,720.00	118,888,000	
みずほリース	22,600	3,620.00	81,812,000	貸付有価証券 10,800株
東京センチュリー	34,100	6,420.00	218,922,000	貸付有価証券 300株
日本証券金融	62,100	864.00	53,654,400	貸付有価証券 900株
アイフル	246,200	347.00	85,431,400	貸付有価証券 600株
リコーリース	11,500	3,720.00	42,780,000	貸付有価証券 900株
イオンフィナンシャル サービス	89,800	1,311.00	117,727,800	貸付有価証券 1,100株
アコム	289,400	428.00	123,863,200	貸付有価証券 100株
ジャックス	16,200	2,798.00	45,327,600	
オリエントコーポレー ション	396,900	148.00	58,741,200	
オリックス	890,700	2,157.00	1,921,239,900	
三菱HCキャピタル	507,400	598.00	303,425,200	貸付有価証券 300株
九州リースサービス	7,200	602.00	4,334,400	貸付有価証券 1,200株

日本取引所グループ	396,300	2,853.00	1,130,643,900	
イー・ギャランティ	17,200	2,546.00	43,791,200	
アサックス	7,600	695.00	5,282,000	貸付有価証券 4,500株
NEC キャピタルソ リューション	6,000	2,139.00	12,834,000	
いちご	163,400	347.00	56,699,800	
日本駐車場開発	160,900	176.00	28,318,400	貸付有価証券 1,700株
スター・マイカ・ホール ディングス	7,900	1,409.00	11,131,100	貸付有価証券 100株
SREホールディングス	2,200	8,280.00	18,216,000	
ADワークスグループ	29,000	160.00	4,640,000	
ヒューリック	311,200	1,343.00	417,941,600	貸付有価証券 6,300株
三栄建築設計	5,900	1,934.00	11,410,600	
野村不動産ホールディン グス	84,300	3,005.00	253,321,500	
三重交通グループホール ディングス	29,700	514.00	15,265,800	貸付有価証券 13,900株
サムティ	20,900	2,310.00	48,279,000	
ディア・ライフ	18,900	496.00	9,374,400	
コーセーアールイー	4,300	658.00	2,829,400	貸付有価証券 500株
日本商業開発	9,300	1,710.00	15,903,000	貸付有価証券 4,300株
プレサンスコーポレー ション	24,100	1,835.00	44,223,500	貸付有価証券 200株
ハウスコム	2,500	1,272.00	3,180,000	
日本管理センター	7,000	1,299.00	9,093,000	
サンセイランディック	4,300	828.00	3,560,400	
エストラスト	1,700	660.00	1,122,000	
フージャースホールディ ングス	23,900	673.00	16,084,700	
オープンハウス	46,600	5,410.00	252,106,000	
東急不動産ホールディン グス	398,900	671.00	267,661,900	
飯田グループホールディ ングス	122,400	2,817.00	344,800,800	
イーグランド	2,400	1,519.00	3,645,600	

ムゲンエステート	9,000	485.00	4,365,000	
ビーロット	9,900	557.00	5,514,300	貸付有価証券 1,000株
ファーストブラザーズ	3,300	1,015.00	3,349,500	
ハウズドゥ	7,200	1,040.00	7,488,000	
シーアールイー	3,800	1,928.00	7,326,400	貸付有価証券 800株
プロパティエージェント	2,400	2,955.00	7,092,000	貸付有価証券 1,100株
ケイアイスター不動産	4,600	5,610.00	25,806,000	貸付有価証券 2,100株
アグレ都市デザイン	2,600	1,020.00	2,652,000	
グッドコムアセット	6,300	1,453.00	9,153,900	
ジェイ・エス・ビー	3,000	3,385.00	10,155,000	
テンポイノベーション	4,100	927.00	3,800,700	貸付有価証券 500株
グローバル・リンク・マ ネジメント	2,500	934.00	2,335,000	
フェイスネットワーク	1,200	1,383.00	1,659,600	
パーク24	78,800	2,107.00	166,031,600	
パラカ	3,800	1,880.00	7,144,000	貸付有価証券 1,700株
三井不動産	668,700	2,686.50	1,796,462,550	
三菱地所	963,800	1,792.00	1,727,129,600	
平和不動産	25,100	4,230.00	106,173,000	
東京建物	144,900	1,706.00	247,199,400	貸付有価証券 2,000株
ダイビル	37,200	1,421.00	52,861,200	
京阪神ビルディング	25,300	1,472.00	37,241,600	貸付有価証券 100株
住友不動産	329,800	3,868.00	1,275,666,400	
テーオーシー	26,400	671.00	17,714,400	貸付有価証券 100株
東京楽天地	2,400	4,160.00	9,984,000	
レオパレス21	121,700	243.00	29,573,100	
スターツコーポレーショ ン	17,500	2,975.00	52,062,500	
フジ住宅	17,000	707.00	12,019,000	
空港施設	14,700	606.00	8,908,200	

明和地所	6,900	605.00	4,174,500	
ゴールドクレスト	13,200	1,771.00	23,377,200	貸付有価証券 800株
エスリード	5,700	1,640.00	9,348,000	
日神グループホールディングス	21,700	520.00	11,284,000	貸付有価証券 9,600株
日本エスコン	27,300	809.00	22,085,700	貸付有価証券 100株
タカラレーベン	61,500	321.00	19,741,500	
AVANTIA	7,600	880.00	6,688,000	
イオンモール	73,600	1,702.00	125,267,200	貸付有価証券 7,000株
毎日コムネット	5,000	746.00	3,730,000	貸付有価証券 200株
ファースト住建	5,500	1,325.00	7,287,500	貸付有価証券 2,500株
カチタス	36,300	4,005.00	145,381,500	貸付有価証券 300株
トーセイ	20,200	1,183.00	23,896,600	貸付有価証券 100株
穴吹興産	3,200	2,050.00	6,560,000	貸付有価証券 100株
サンフロンティア不動産	18,000	1,195.00	21,510,000	
エフ・ジェー・ネクスト	14,400	1,046.00	15,062,400	貸付有価証券 1,000株
インテリックス	3,300	754.00	2,488,200	
ランドビジネス	6,200	271.00	1,680,200	
サンネクスタグループ	4,600	1,020.00	4,692,000	
グランディハウス	10,000	487.00	4,870,000	
日本空港ビルデング	51,000	5,040.00	257,040,000	
明豊ファシリティワークス	6,500	881.00	5,726,500	
日本工営	8,300	3,215.00	26,684,500	
LIFULL	43,400	358.00	15,537,200	貸付有価証券 200株
ミクシィ	36,100	2,694.00	97,253,400	貸付有価証券 100株
ジェイエイシーリクルートメント	11,700	1,933.00	22,616,100	
日本M&Aセンター	233,200	3,385.00	789,382,000	

メンバーズ	4,200	3,215.00	13,503,000	
中広	2,000	390.00	780,000	貸付有価証券 100株
UTグループ	20,500	3,175.00	65,087,500	貸付有価証券 4,500株
アイティメディア	4,800	2,285.00	10,968,000	貸付有価証券 2,100株（1,200株）
タケエイ	15,900	1,671.00	26,568,900	
E・Jホールディングス	7,400	1,289.00	9,538,600	貸付有価証券 400株
夢真ビーネックスグループ	37,800	1,292.00	48,837,600	
コシダカホールディングス	38,000	592.00	22,496,000	貸付有価証券 16,400株
アルトナー	3,400	868.00	2,951,200	
パソナグループ	15,400	3,095.00	47,663,000	貸付有価証券 100株
CDS	3,500	1,599.00	5,596,500	
リンクアンドモチベーション	31,300	1,008.00	31,550,400	貸付有価証券 5,500株（5,500株）
GCA	20,700	1,377.00	28,503,900	貸付有価証券 1,800株（1,500株）
エス・エム・エス	48,300	4,025.00	194,407,500	貸付有価証券 1,200株
サニーサイドアップグループ	4,900	741.00	3,630,900	貸付有価証券 300株（300株）
パーソルホールディングス	142,100	2,686.00	381,680,600	
リニカル	8,000	862.00	6,896,000	
クックパッド	44,700	223.00	9,968,100	貸付有価証券 300株
エスクリ	4,500	512.00	2,304,000	貸付有価証券 2,100株
アイ・ケイ・ケイ	6,900	675.00	4,657,500	
学情	5,700	1,214.00	6,919,800	貸付有価証券 2,600株
スタジオアリス	7,100	2,257.00	16,024,700	貸付有価証券 4,200株
シミックホールディングス	7,900	1,508.00	11,913,200	
エプコ	3,000	848.00	2,544,000	

N J S	3,100	1,933.00	5,992,300	
総合警備保障	56,600	5,010.00	283,566,000	
カカクコム	105,000	3,760.00	394,800,000	
セントケア・ホールディング	10,400	986.00	10,254,400	貸付有価証券 4,800株
サイネックス	2,400	673.00	1,615,200	
ルネサンス	8,900	1,171.00	10,421,900	貸付有価証券 4,200株
ディップ	22,200	3,840.00	85,248,000	貸付有価証券 1,500株
デジタルホールディングス	9,900	1,700.00	16,830,000	貸付有価証券 2,900株（2,900株）
新日本科学	17,300	864.00	14,947,200	
キャリアデザインセンター	3,600	1,217.00	4,381,200	
ベネフィット・ワン	51,700	4,945.00	255,656,500	貸付有価証券 1,400株
エムスリー	250,800	8,072.00	2,024,457,600	貸付有価証券 5,700株
ツカダ・グローバルホールディング	9,000	342.00	3,078,000	
プラス	1,800	537.00	966,600	
アウトソーシング	81,400	2,025.00	164,835,000	貸付有価証券 2,200株
ウェルネット	14,300	514.00	7,350,200	貸付有価証券 2,900株（700株）
ワールドホールディングス	5,700	2,735.00	15,589,500	
ディー・エヌ・エー	60,100	2,041.00	122,664,100	貸付有価証券 3,800株
博報堂D Yホールディングス	197,800	1,886.00	373,050,800	
ぐるなび	24,700	502.00	12,399,400	貸付有価証券 1,000株
タカミヤ	17,200	485.00	8,342,000	
ジャパンベストレスキューシステム	9,600	1,103.00	10,588,800	
ファンコミュニケーションズ	35,500	421.00	14,945,500	
ライク	3,800	1,811.00	6,881,800	
ビジネス・ブレークス	5,900	449.00	2,649,100	

ルー				
エスプール	40,100	1,012.00	40,581,200	
W D Bホールディングス	6,500	3,540.00	23,010,000	
手間いらず	1,800	5,760.00	10,368,000	貸付有価証券 100株（100株）
ティア	8,300	505.00	4,191,500	
C D G	1,300	1,573.00	2,044,900	貸付有価証券 600株
アドウェイズ	23,100	682.00	15,754,200	
バリューコマース	11,100	4,715.00	52,336,500	貸付有価証券 2,200株
インフォマート	155,800	1,025.00	159,695,000	貸付有価証券 1,200株
J Pホールディングス	40,600	279.00	11,327,400	貸付有価証券 2,400株
レグス	3,000	2,269.00	6,807,000	貸付有価証券 1,300株（600株）
プレステージ・インター ナショナル	53,300	785.00	41,840,500	
アミューズ	7,700	2,378.00	18,310,600	
ドリームインキュベータ	4,300	939.00	4,037,700	
クイック	8,800	1,401.00	12,328,800	
T A C	7,700	252.00	1,940,400	
電通グループ	146,500	4,230.00	619,695,000	貸付有価証券 7,400株
テイクアンドギヴ・ニー ズ	6,600	1,065.00	7,029,000	
ぴあ	4,100	3,420.00	14,022,000	貸付有価証券 200株
イオンファンタジー	5,500	1,922.00	10,571,000	貸付有価証券 2,400株
シーティーエス	16,000	797.00	12,752,000	
ネクシィーズグループ	5,000	890.00	4,450,000	貸付有価証券 200株（200株）
H. U. グループホール ディングス	39,800	3,225.00	128,355,000	
アルプス技研	12,600	2,001.00	25,212,600	貸付有価証券 100株
ダイオーズ	2,800	1,075.00	3,010,000	貸付有価証券 1,300株
日本空調サービス	14,900	728.00	10,847,200	貸付有価証券

				100株
オリエンタルランド	151,200	16,755.00	2,533,356,000	貸付有価証券 2,500株
ダスキン	33,000	2,675.00	88,275,000	
明光ネットワークジャ パン	16,700	596.00	9,953,200	貸付有価証券 7,700株（3,100株）
ファルコホールディング ス	6,800	1,757.00	11,947,600	
秀英予備校	3,100	423.00	1,311,300	貸付有価証券 1,400株
ラウンドワン	48,500	1,407.00	68,239,500	貸付有価証券 1,000株
リゾートトラスト	65,200	1,921.00	125,249,200	
ビー・エム・エル	18,300	4,410.00	80,703,000	
りらいあコミュニケー ションズ	21,600	1,246.00	26,913,600	
リソー教育	72,100	419.00	30,209,900	貸付有価証券 1,000株
早稲田アカデミー	6,000	964.00	5,784,000	貸付有価証券 2,800株
ユー・エス・エス	159,100	1,897.00	301,812,700	
東京個別指導学院	12,500	641.00	8,012,500	
サイバーエージェント	350,300	2,155.00	754,896,500	貸付有価証券 8,700株
楽天グループ	729,000	1,113.00	811,377,000	貸付有価証券 74,000株
クリーク・アンド・リ パー社	7,400	1,763.00	13,046,200	
モーニングスター	20,700	497.00	10,287,900	
テー・オー・ダブリュー	24,900	322.00	8,017,800	
山田コンサルティンググ ループ	8,300	1,150.00	9,545,000	
セントラルスポーツ	5,300	2,494.00	13,218,200	貸付有価証券 2,500株
フルキャストホールディ ングス	12,100	2,245.00	27,164,500	貸付有価証券 1,200株
エン・ジャパン	25,300	3,820.00	96,646,000	
リソルホールディングス	1,500	4,000.00	6,000,000	貸付有価証券 600株
テクノプロ・ホールディ ングス	85,100	3,080.00	262,108,000	貸付有価証券 13,500株

アトラグループ	3,200	315.00	1,008,000	貸付有価証券 2,000株
インターワークス	4,100	403.00	1,652,300	
アイ・アールジャパン ホールディングス	5,800	13,100.00	75,980,000	貸付有価証券 400株
KeePer 技研	9,100	3,895.00	35,444,500	
ファーストロジック	2,700	782.00	2,111,400	
三機サービス	2,700	1,101.00	2,972,700	
Gunosy	8,900	689.00	6,132,100	
デザインワン・ジャパン	3,500	224.00	784,000	貸付有価証券 600株（500株）
イー・ガーディアン	5,800	3,255.00	18,879,000	
リブセンス	7,800	204.00	1,591,200	
ジャパンマテリアル	43,700	1,319.00	57,640,300	貸付有価証券 300株
ベクトル	17,700	1,105.00	19,558,500	
ウチヤマホールディング ス	7,000	350.00	2,450,000	
チャーム・ケア・コーポ レーション	10,600	1,634.00	17,320,400	貸付有価証券 400株（400株）
キャリアリンク	4,600	1,953.00	8,983,800	貸付有価証券 2,500株
I B J	11,600	981.00	11,379,600	
アサンテ	5,100	1,795.00	9,154,500	貸付有価証券 2,300株
バリューHR	5,700	1,771.00	10,094,700	
M&Aキャピタルパート ナーズ	11,700	5,370.00	62,829,000	貸付有価証券 5,400株
ライドオンエクスプレス ホールディングス	5,500	1,558.00	8,569,000	貸付有価証券 2,300株（2,300株）
ERIホールディングス	4,000	1,122.00	4,488,000	
アビスト	2,200	2,984.00	6,564,800	
シグマクシス	7,800	2,597.00	20,256,600	
ウィルグループ	10,400	1,307.00	13,592,800	
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	21,100	215.00	4,536,500	
メドピア	10,900	4,045.00	44,090,500	貸付有価証券 1,300株（200株）
レアジョブ	2,700	1,400.00	3,780,000	貸付有価証券 1,200株（200株）

リクルートホールディングス	1,018,200	6,624.00	6,744,556,800	貸付有価証券 9,100株
エラン	19,600	1,360.00	26,656,000	貸付有価証券 300株
土木管理総合試験所	6,600	367.00	2,422,200	
ネットマーケティング	6,900	441.00	3,042,900	貸付有価証券 2,000株（1,700株）
日本郵政	1,075,500	972.50	1,045,923,750	
ベルシステム24ホールディングス	23,800	1,667.00	39,674,600	貸付有価証券 2,500株
鎌倉新書	14,300	1,007.00	14,400,100	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
SMN	3,000	681.00	2,043,000	
一蔵	1,800	397.00	714,600	
グローバルキッズCOMPANY	2,600	752.00	1,955,200	
エアトリ	9,000	3,110.00	27,990,000	貸付有価証券 4,200株
アトラエ	9,900	2,782.00	27,541,800	貸付有価証券 400株（400株）
ストライク	5,400	4,140.00	22,356,000	貸付有価証券 2,400株
ソラスト	34,900	1,522.00	53,117,800	
セラク	4,500	2,132.00	9,594,000	貸付有価証券 2,100株
インソース	13,800	2,094.00	28,897,200	貸付有価証券 6,200株（6,200株）
ベイカレント・コンサルティング	9,300	52,600.00	489,180,000	
Orchestra Holdings	2,700	3,485.00	9,409,500	
アイモバイル	4,000	1,458.00	5,832,000	貸付有価証券 1,800株
キャリアインデックス	5,800	1,074.00	6,229,200	貸付有価証券 1,100株
MS-Japan	5,800	1,081.00	6,269,800	貸付有価証券 200株
船場	2,800	780.00	2,184,000	
グレイステクノロジー	14,400	1,189.00	17,121,600	貸付有価証券 4,700株（2,300株）
ジャパンエレベーター	41,000	2,782.00	114,062,000	

サービスホールディング				
フルテック	2,000	1,341.00	2,682,000	
グリーンズ	5,400	541.00	2,921,400	貸付有価証券 700株
ツナググループ・ホール ディングス	3,200	308.00	985,600	貸付有価証券 200株
GameW i t h	4,200	547.00	2,297,400	
ソウルドアウト	3,400	1,670.00	5,678,000	貸付有価証券 600株（600株）
MS&C o n s u l t i n g	2,300	605.00	1,391,500	
ウェルビー	5,300	1,580.00	8,374,000	
エル・ティー・エス	1,800	3,625.00	6,525,000	貸付有価証券 600株（400株）
ミダックホールディング ス	6,200	4,730.00	29,326,000	貸付有価証券 2,900株（900株）
日総工産	11,100	769.00	8,535,900	
キュービーネットホール ディングス	6,500	1,851.00	12,031,500	貸付有価証券 100株
R P Aホールディングス	17,100	609.00	10,413,900	貸付有価証券 5,700株（5,700株）
スプリックス	4,000	930.00	3,720,000	
マネジメントソリュー ションズ	7,000	2,860.00	20,020,000	貸付有価証券 3,200株
プロレド・パートナーズ	3,100	2,479.00	7,684,900	貸付有価証券 300株（300株）
a n d f a c t o r y	3,200	542.00	1,734,400	
テクノ・ホールディングス	1,700	999.00	1,698,300	
フロンティア・マネジメ ント	3,700	1,078.00	3,988,600	貸付有価証券 1,100株（200株）
ピアラ	2,300	838.00	1,927,400	貸付有価証券 400株（400株）
コプロ・ホールディング ス	1,800	1,129.00	2,032,200	
ギークス	2,400	1,645.00	3,948,000	
カーブスホールディング ス	39,000	889.00	34,671,000	
フォーラムエンジニアリ ング	9,900	906.00	8,969,400	
ダイレクトマーケティング ミックス	7,600	4,370.00	33,212,000	

ポピンズホールディングス	3,300	3,195.00	10,543,500	貸付有価証券 100株（100株）
LITALICO	5,700	6,180.00	35,226,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	7,200	1,158.00	8,337,600	貸付有価証券 100株
リログループ	77,700	2,388.00	185,547,600	貸付有価証券 22,800株
東祥	8,800	1,787.00	15,725,600	貸付有価証券 4,200株
エイチ・アイ・エス	31,600	2,522.00	79,695,200	貸付有価証券 14,800株（3,900株）
ラックランド	4,100	2,834.00	11,619,400	
共立メンテナンス	23,500	3,620.00	85,070,000	貸付有価証券 1,800株（500株）
イチネンホールディングス	14,800	1,276.00	18,884,800	
建設技術研究所	8,500	2,515.00	21,377,500	
スペース	10,100	919.00	9,281,900	
長大	5,700	1,945.00	11,086,500	
燦ホールディングス	6,200	1,443.00	8,946,600	
スバル興業	900	8,400.00	7,560,000	貸付有価証券 100株
東京テアトル	5,600	1,270.00	7,112,000	貸付有価証券 2,600株
タナベ経営	2,700	1,500.00	4,050,000	
ナガワ	4,500	11,310.00	50,895,000	貸付有価証券 2,200株
東京都競馬	10,600	4,150.00	43,990,000	
常磐興産	5,700	1,446.00	8,242,200	貸付有価証券 2,600株
カナモト	25,000	2,638.00	65,950,000	貸付有価証券 8,000株
西尾レントオール	13,100	3,035.00	39,758,500	
トランス・コスモス	13,500	3,570.00	48,195,000	貸付有価証券 100株
乃村工芸社	60,900	940.00	57,246,000	貸付有価証券 800株
藤田観光	6,200	2,245.00	13,919,000	貸付有価証券 2,900株
KNT-CTホールディングス	7,600	1,369.00	10,404,400	貸付有価証券 4,500株

	日本管財	15,200	2,725.00	41,420,000	
	トーカイ	13,700	2,467.00	33,797,900	
	白洋舎	1,600	2,077.00	3,323,200	
	セコム	140,100	8,562.00	1,199,536,200	
	セントラル警備保障	6,800	2,693.00	18,312,400	
	丹青社	26,800	879.00	23,557,200	
	メイテック	17,200	6,660.00	114,552,000	
	応用地質	16,000	1,368.00	21,888,000	
	船井総研ホールディングス	29,100	2,780.00	80,898,000	
	進学会ホールディングス	5,600	423.00	2,368,800	貸付有価証券 900株
	オオバ	10,000	838.00	8,380,000	貸付有価証券 4,700株
	いであ	3,800	1,892.00	7,189,600	
	学究社	4,100	1,394.00	5,715,400	
	ベネッセホールディングス	52,100	2,416.00	125,873,600	
	イオンディライト	17,500	3,650.00	63,875,000	貸付有価証券 1,100株
	ナック	6,700	955.00	6,398,500	貸付有価証券 100株
	ダイセキ	28,560	4,790.00	136,802,400	貸付有価証券 2,000株
	ステップ	5,200	1,807.00	9,396,400	
	小計 銘柄数：2,168			416,079,355,380	
	組入時価比率：98.8%			100.0%	
合計				416,079,355,380	

(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9月6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

	2021年 9月 6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	5,032,853,600	—	5,075,100,000	42,122,650
合計	5,032,853,600	—	5,075,100,000	42,122,650

（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。

外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2021年 9月 6日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	60,087,013
コール・ローン	1,643,786,903
株式	84,982,922,368
投資証券	2,046,429,229
派生商品評価勘定	306,452,884
未収入金	75,862,631
未収配当金	146,899,898
差入委託証拠金	1,198,499,317
流動資産合計	90,460,940,243
資産合計	90,460,940,243
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	89,935,718
未払金	333,872,940
未払解約金	56,421,161
未払利息	1,289
その他未払費用	464,100
流動負債合計	480,695,208
負債合計	480,695,208
純資産の部	
元本等	
元本	31,139,090,547
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	58,841,154,488
元本等合計	89,980,245,035
純資産合計	89,980,245,035
負債純資産合計	90,460,940,243

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 9月 6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	2.8896円
(10,000口当たり純資産額)	(28,896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 9月 8日

至 2021年 9月 6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、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

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 9月 6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 9月 6日現在

期首

2020年 9月 8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	23,146,792,739円
同期中における追加設定元本額	14,770,687,758円
同期中における一部解約元本額	6,778,389,950円
期末元本額	31,139,090,547円
期末元本額の内訳※	
野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型	2,262,863,174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	1,001,946,537円
野村外国株インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）	904,410,657円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	2,652,654円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	2,276,778円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	8,197,997円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	1,335,210円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	3,560,421円
野村外国株インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	14,735,019,419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）	4,139,754,762円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数（為替ヘッジあり）連動型上場投信	538,203,800円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	298,021,287円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	5,126,651,098円
野村外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA（適格機関投資家専用）	1,165,102,408円
ノムラ外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA（適格機関投資家専用）	819,105,864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）	85,748,530円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスオープン投信・為替ヘッジ型（適格機関投資家専用）	593,043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）	43,646,908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9月6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	9,600	23.16	222,336.00	
		HALLIBURTON CO	12,300	20.17	248,091.00	
		SCHLUMBERGER LTD	19,100	28.09	536,519.00	
		CHENIERE ENERGY INC	3,450	89.92	310,224.00	
		CHEVRON CORP	27,040	97.49	2,636,129.60	
		CONOCOPHILLIPS	18,820	56.24	1,058,436.80	
		DEVON ENERGY CORP	8,900	29.17	259,613.00	
		EOG RESOURCES INC	8,070	67.99	548,679.30	

EXXON MOBIL CORP	59,210	54.87	3,248,852.70
HESS CORP	3,840	69.91	268,454.40
KINDER MORGAN INC	27,800	16.34	454,252.00
MARATHON PETROLEUM CORP	8,960	58.24	521,830.40
OCCIDENTAL PETE CORP	12,900	25.92	334,368.00
ONEOK INC	6,170	53.17	328,058.90
PHILLIPS 66	5,960	69.62	414,935.20
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,290	149.88	493,105.20
VALERO ENERGY CORP	5,630	64.70	364,261.00
WILLIAMS COS	16,800	24.97	419,496.00
AIR PRODUCTS	3,070	268.28	823,619.60
ALBEMARLE CORP	1,680	241.86	406,324.80
CELANESE CORP-SERIES A	1,610	155.14	249,775.40
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,670	45.43	121,298.10
CORTEVA INC	10,260	44.92	460,879.20
DOW INC	10,300	62.12	639,836.00
DUPONT DE NEMOURS INC	7,370	72.08	531,229.60
EASTMAN CHEMICAL CO.	1,980	112.56	222,868.80
ECOLAB INC	3,560	225.14	801,498.40
FMC CORP	1,790	95.28	170,551.20
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	3,510	150.91	529,694.10
LINDE PLC	7,290	313.43	2,284,904.70
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,690	95.73	353,243.70
MOSAIC CO/THE	5,300	32.15	170,395.00
PPG INDUSTRIES	3,240	155.66	504,338.40
RPM INTERNATIONAL INC	1,820	81.80	148,876.00
SHERWIN-WILLIAMS	3,510	307.43	1,079,079.30
MARTIN MARIETTA MATERIALS	865	374.48	323,925.20
VULCAN MATERIALS CO	1,840	180.31	331,770.40
AMCOR PLC	21,900	12.68	277,692.00
AVERY DENNISON CORP	1,110	225.73	250,560.30
BALL CORP	4,420	97.38	430,419.60
CROWN HOLDINGS INC	1,870	111.80	209,066.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	5,190	59.92	310,984.80
PACKAGING CORP OP AMERICA	1,330	152.45	202,758.50

SEALED AIR CORP	2,300	61.22	140,806.00
WESTROCK CO	3,690	52.60	194,094.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	20,230	36.14	731,112.20
NEWMONT CORP	11,300	59.67	674,271.00
NUCOR CORP	4,170	114.05	475,588.50
STEEL DYNAMICS	3,000	66.77	200,310.00
BOEING CO	7,720	218.17	1,684,272.40
GENERAL DYNAMICS	3,360	202.46	680,265.60
HEICO CORP	570	124.44	70,930.80
HEICO CORP-CLASS A	1,040	113.34	117,873.60
HOWMET AEROSPACE INC	5,800	31.37	181,946.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	590	203.17	119,870.30
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,890	231.74	669,728.60
LOCKHEED MARTIN	3,506	356.00	1,248,136.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,190	365.93	801,386.70
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	21,160	83.65	1,770,034.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	661	448.81	296,663.41
TEXTRON INC	3,210	72.55	232,885.50
TRANSDIGM GROUP INC	708	602.27	426,407.16
ALLEGION PLC	1,180	148.13	174,793.40
CARRIER GLOBAL CORP	11,280	57.41	647,584.80
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	2,040	98.14	200,205.60
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	10,170	75.02	762,953.40
LENNOX INTERNATIONAL INC	489	332.79	162,734.31
MASCO CORP	3,660	61.19	223,955.40
OWENS CORNING INC	1,560	95.40	148,824.00
SMITH (A.O.) CORP	1,900	73.24	139,156.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,370	199.94	673,797.80
AMETEK INC	3,140	135.40	425,156.00
EATON CORP PLC	5,520	166.38	918,417.60
EMERSON ELEC	8,310	105.38	875,707.80
GENERAC HOLDINGS INC	854	453.75	387,502.50
PLUG POWER INC	7,100	26.40	187,440.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,580	324.00	511,920.00

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,950	58.21	113,509.50	
SUNRUN INC	2,430	45.54	110,662.20	
3M CORP	8,060	194.39	1,566,783.40	
GENERAL ELECTRIC CO	15,262	104.75	1,598,694.50	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	9,690	228.36	2,212,808.40	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,900	55.93	162,197.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,451	486.22	705,505.22	
CATERPILLAR INC DEL	7,590	210.37	1,596,708.30	
CUMMINS INC	2,040	238.57	486,682.80	
DEERE & COMPANY	4,140	389.34	1,611,867.60	
DOVER CORP	2,000	174.93	349,860.00	
FORTIVE CORP	4,590	75.50	346,545.00	
IDEX CORP	1,110	222.57	247,052.70	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	4,400	228.53	1,005,532.00	
INGERSOLL-RAND INC	5,800	52.94	307,052.00	
NORDSON CORP	780	241.45	188,331.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	5,620	91.82	516,028.40	
PACCAR	4,720	84.43	398,509.60	
PARKER HANNIFIN CORP	1,760	289.91	510,241.60	
PENTAIR PLC	2,420	77.87	188,445.40	
SNAP-ON INC	760	226.90	172,444.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,210	191.10	422,331.00	
WABTEC CORP	2,540	90.23	229,184.20	
XYLEM INC	2,510	137.25	344,497.50	
FASTENAL CO	7,810	55.89	436,500.90	
GRAINGER(W.W.) INC	620	429.65	266,383.00	
UNITED RENTALS INC	1,000	351.37	351,370.00	
CINTAS CORP	1,338	396.53	530,557.14	
COPART INC	2,940	145.63	428,152.20	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	3,090	125.47	387,702.30	
ROLLINS INC	3,150	39.71	125,086.50	
WASTE CONNECTIONS INC	3,570	131.28	468,669.60	
WASTE MANAGEMENT INC	5,860	155.40	910,644.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	1,900	90.09	171,171.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH	2,290	123.57	282,975.30	

INC				
FEDEX CORPORATION	3,460	266.04	920,498.40	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	10,030	197.34	1,979,320.20	
DELTA AIR LINES INC	1,960	40.25	78,890.00	
SOUTHWEST AIRLINES	2,100	48.86	102,606.00	
AMERCO	150	655.02	98,253.00	
CSX CORP	31,400	32.00	1,004,800.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	1,190	181.08	215,485.20	
KANSAS CITY SOUTHERN	1,290	291.63	376,202.70	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	2,340	53.19	124,464.60	
LYFT INC-A	3,620	48.21	174,520.20	
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,460	250.40	866,384.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,400	301.15	421,610.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	17,170	40.32	692,294.40	
UNION PAC CORP	9,330	214.91	2,005,110.30	
APTIV PLC	3,690	149.93	553,241.70	
AUTOLIV INC	980	87.72	85,965.60	
BORGWARNER INC	3,610	43.14	155,735.40	
LEAR CORP	810	159.37	129,089.70	
FORD MOTOR COMPANY	54,100	12.89	697,349.00	
GENERAL MOTORS CO	18,380	48.82	897,311.60	
TESLA INC	11,434	733.57	8,387,639.38	
DR HORTON INC	4,770	94.96	452,959.20	
GARMIN LTD	2,190	176.11	385,680.90	
LENNAR CORP-A	3,800	105.61	401,318.00	
MOHAWK INDUSTRIES	850	194.07	164,959.50	
NEWELL BRANDS INC	5,700	25.66	146,262.00	
NVR INC	49	5,100.64	249,931.36	
PULTEGROUP INC	3,700	53.39	197,543.00	
WHIRLPOOL CORP	880	225.87	198,765.60	
HASBRO INC	1,840	99.36	182,822.40	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	3,530	98.56	347,916.80	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,690	388.33	656,277.70	
NIKE INC-B	17,830	163.29	2,911,460.70	
V F CORP	4,520	76.23	344,559.60	

AIRBNB INC-CLASS A	1,800	158.00	284,400.00	
ARAMARK	3,000	34.13	102,390.00	
BOOKING HOLDINGS INC	576	2,304.45	1,327,363.20	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	3,010	103.56	311,715.60	
CARNIVAL CORP	11,300	22.96	259,448.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	397	1,920.01	762,243.97	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,900	148.05	281,295.00	
DOMINOS PIZZA INC	552	514.50	284,004.00	
DRAFTKINGS INC - CL A	4,610	61.02	281,302.20	
EXPEDIA GROUP INC	1,970	142.64	281,000.80	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,780	123.08	465,242.40	
LAS VEGAS SANDS CORP	5,010	43.13	216,081.30	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	3,770	133.00	501,410.00	
MCDONALD'S CORP	10,440	238.82	2,493,280.80	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	2,900	13.81	40,049.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	5,580	42.54	237,373.20	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,010	79.43	239,084.30	
STARBUCKS CORP	16,400	117.19	1,921,916.00	
VAIL RESORTS INC	590	291.58	172,032.20	
WYNN RESORTS LTD	1,400	100.30	140,420.00	
YUM BRANDS INC	4,130	130.92	540,699.60	
GENUINE PARTS CO	2,010	122.18	245,581.80	
LKQ CORP	4,070	50.84	206,918.80	
POOL CORP	562	496.89	279,252.18	
AMAZON.COM INC	6,335	3,478.05	22,033,446.75	
CHEWY INC - CLASS A	1,090	76.75	83,657.50	
DOORDASH INC-A	1,070	193.46	207,002.20	
EBAY INC	9,480	76.53	725,504.40	
ETSY INC	1,710	220.38	376,849.80	
MERCADOLIBRE INC	622	1,946.01	1,210,418.22	
WAYFAIR INC - CLASS A	1,000	273.54	273,540.00	
DOLLAR GENERAL CORP	3,360	222.45	747,432.00	
DOLLAR TREE INC	3,260	92.81	302,560.60	
TARGET CORP	6,940	244.31	1,695,511.40	
ADVANCE AUTO PARTS	960	199.44	191,462.40	

AUTOZONE	319	1,537.25	490,382.75	
BATH & BODY WORKS INC	3,460	65.60	226,976.00	
BEST BUY COMPANY INC	3,160	114.02	360,303.20	
BURLINGTON STORES INC	920	297.50	273,700.00	
CARMAX INC	2,280	127.15	289,902.00	
CARVANA CO	1,000	328.66	328,660.00	
HOME DEPOT	14,910	330.34	4,925,369.40	
LOWES COS INC	9,900	205.98	2,039,202.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	997	584.80	583,045.60	
ROSS STORES INC	4,880	115.38	563,054.40	
TJX COS INC	16,680	71.07	1,185,447.60	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,620	198.80	322,056.00	
ULTA BEAUTY INC	780	382.11	298,045.80	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	6,191	462.55	2,863,647.05	
KROGER CO	10,210	46.65	476,296.50	
SYSCO CORP	6,950	77.35	537,582.50	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	10,130	51.29	519,567.70	
WALMART INC	21,550	149.25	3,216,337.50	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	128	562.51	72,001.28	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	4,290	70.93	304,289.70	
COCA COLA CO	57,290	56.73	3,250,061.70	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	2,900	61.06	177,074.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,320	211.83	491,445.60	
KEURIG DR PEPPER INC	9,940	35.24	350,285.60	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	2,700	46.98	126,846.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	5,400	97.58	526,932.00	
PEPSICO INC	19,330	157.09	3,036,549.70	
ARCHER DANIELS MIDLAND	7,610	60.20	458,122.00	
BUNGE LIMITED	1,970	77.39	152,458.30	
CAMPBELL SOUP CO	2,600	43.05	111,930.00	
CONAGRA BRANDS INC	7,130	33.49	238,783.70	
GENERAL MILLS	8,340	57.77	481,801.80	
HERSHEY CO/THE	2,050	177.99	364,879.50	
HORMEL FOODS CORP	4,180	42.81	178,945.80	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	1,580	120.61	190,563.80	

KELLOGG CO	3,610	63.44	229,018.40	
KRAFT HEINZ CO/THE	9,300	35.83	333,219.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	2,170	63.58	137,968.60	
MCCORMICK & CO INC.	3,460	88.08	304,756.80	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	19,440	61.72	1,199,836.80	
TYSON FOODS INC-CL A	4,090	78.23	319,960.70	
ALTRIA GROUP INC	25,840	50.97	1,317,064.80	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	21,700	106.10	2,302,370.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,320	84.39	280,174.80	
CLOROX CO	1,750	169.51	296,642.50	
COLGATE PALMOLIVE CO.	11,070	77.91	862,463.70	
KIMBERLY-CLARK CORP	4,670	140.75	657,302.50	
PROCTER & GAMBLE CO	34,100	144.05	4,912,105.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3,260	341.83	1,114,365.80	
ABBOTT LABORATORIES	24,850	128.94	3,204,159.00	
ABIOMED INC	620	372.69	231,067.80	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,035	721.50	746,752.50	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	7,130	82.71	589,722.30	
BECTON,DICKINSON	4,030	257.83	1,039,054.90	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	19,450	44.92	873,694.00	
DANAHER CORP	8,930	332.43	2,968,599.90	
DENTSPLY SIRONA INC	3,070	62.43	191,660.10	
DEXCOM INC	1,324	542.43	718,177.32	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,660	121.07	1,048,466.20	
HOLOGIC INC	3,600	80.25	288,900.00	
IDEXX LABORATORIES INC	1,181	688.33	812,917.73	
INSULET CORP	900	302.59	272,331.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,637	1,071.77	1,754,487.49	
MASIMO CORP	710	276.98	196,655.80	
MEDTRONIC PLC	18,870	134.63	2,540,468.10	
NOVOCURE LTD	1,200	138.55	166,260.00	
RESMED INC	1,980	295.80	585,684.00	
STERIS PLC	1,410	217.82	307,126.20	
STRYKER CORP	4,710	276.65	1,303,021.50	
TELEFLEX INC	679	398.43	270,533.97	

THE COOPER COMPANIES, INC.	694	455.92	316,408.48	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,030	464.38	478,311.40	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,830	146.74	415,274.20	
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,140	125.14	267,799.60	
ANTHEM INC	3,373	378.73	1,277,456.29	
CARDINAL HEALTH INC	4,110	53.64	220,460.40	
CENTENE CORP	7,950	64.37	511,741.50	
CIGNA CORP	4,840	216.92	1,049,892.80	
CVS HEALTH CORP	18,250	87.47	1,596,327.50	
DAVITA INC	920	132.17	121,596.40	
HCA HEALTHCARE INC	3,730	252.95	943,503.50	
HENRY SCHEIN INC	2,030	78.38	159,111.40	
HUMANA INC	1,768	415.56	734,710.08	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,350	306.65	413,977.50	
MCKESSON CORP	2,220	206.28	457,941.60	
MOLINA HEALTHCARE INC	820	274.75	225,295.00	
OAK STREET HEALTH INC	1,360	49.89	67,850.40	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,880	155.84	292,979.20	
UNITEDHEALTH GROUP INC	13,141	422.86	5,556,803.26	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,100	156.22	171,842.00	
ABBVIE INC	24,710	111.62	2,758,130.20	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,600	197.46	315,936.00	
AMGEN INC	8,040	226.37	1,820,014.80	
BIOGEN INC	2,120	333.60	707,232.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,500	84.95	212,375.00	
EXACT SCIENCES CORP	2,330	107.98	251,593.40	
GILEAD SCIENCES INC	17,460	71.96	1,256,421.60	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	3,010	110.01	331,130.10	
INCYTE CORP	2,560	76.09	194,790.40	
MODERNA INC	4,780	416.70	1,991,826.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,400	95.87	134,218.00	
NOVAVAX INC	990	251.49	248,975.10	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,445	679.57	981,978.65	
SEAGEN INC	1,850	152.22	281,607.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	3,600	198.05	712,980.00	

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	31,220	65.61	2,048,344.20	
CATALENT INC	2,410	140.35	338,243.50	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	6,200	34.15	211,730.00	
ELI LILLY & CO.	11,400	259.53	2,958,642.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	750	136.93	102,697.50	
JOHNSON & JOHNSON	36,780	175.04	6,437,971.20	
MERCK & CO INC	35,430	77.26	2,737,321.80	
PFIZER INC	78,260	46.84	3,665,698.40	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	2,160	39.31	84,909.60	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	15,800	9.48	149,784.00	
VIATRIS INC	18,000	14.89	268,020.00	
ZOETIS INC	6,600	209.69	1,383,954.00	
BANK OF AMERICA CORP	107,610	41.05	4,417,390.50	
CITIGROUP	29,020	71.17	2,065,353.40	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,720	43.07	246,360.40	
FIFTH THIRD BANCORP	9,670	38.51	372,391.70	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,500	202.13	505,325.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	20,600	15.25	314,150.00	
JPMORGAN CHASE & CO	42,260	159.49	6,740,047.40	
KEYCORP	13,600	20.05	272,680.00	
M & T BANK CORP	1,870	138.96	259,855.20	
PNC FINANCIAL	5,890	191.52	1,128,052.80	
REGIONS FINANCIAL CORP	14,000	19.71	275,940.00	
SVB FINANCIAL GROUP	793	571.51	453,207.43	
TRUIST FINANCIAL CORP	18,720	56.45	1,056,744.00	
US BANCORP	19,630	56.15	1,102,224.50	
WELLS FARGO CO	57,830	44.17	2,554,351.10	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	18,540	281.89	5,226,240.60	
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,900	31.21	184,139.00	
VOYA FINANCIAL INC	1,820	64.43	117,262.60	
AFLAC INC	9,190	55.71	511,974.90	
ALLEGHANY CORP	211	662.77	139,844.47	
ALLSTATE CORP	4,180	133.97	559,994.60	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	910	137.80	125,398.00	
AMERICAN INTL GROUP	11,840	55.10	652,384.00	

AON PLC	3,190	291.43	929,661.70
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,950	39.43	234,608.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,930	145.49	426,285.70
ASSURANT INC	750	170.37	127,777.50
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,990	69.11	137,528.90
BROWN & BROWN INC	3,400	58.94	200,396.00
CHUBB LTD	6,190	183.46	1,135,617.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,140	121.08	259,111.20
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	320	180.87	57,878.40
EVEREST RE GROUP LTD	570	256.64	146,284.80
FNF GROUP	3,940	48.08	189,435.20
GLOBE LIFE INC	1,230	94.29	115,976.70
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	4,970	68.09	338,407.30
LINCOLN NATIONAL CORP	2,580	67.56	174,304.80
LOEWS CORP	3,210	54.76	175,779.60
MARKEL CORP	193	1,255.66	242,342.38
MARSH & MCLENNAN COS	7,050	159.50	1,124,475.00
METLIFE INC	10,620	61.22	650,156.40
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,840	66.00	253,440.00
PROGRESSIVE CO	8,120	96.23	781,387.60
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5,420	104.89	568,503.80
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	720	152.47	109,778.40
TRAVELERS COS INC/THE	3,480	159.17	553,911.60
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,750	228.52	399,910.00
WR BERKLEY CORP	2,030	74.45	151,133.50
ACCENTURE PLC-CL A	8,890	343.33	3,052,203.70
AKAMAI TECHNOLOGIES	2,220	113.80	252,636.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	5,890	207.38	1,221,468.20
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	1,690	170.75	288,567.50
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	7,360	76.55	563,408.00
EPAM SYSTEMS INC	776	643.39	499,270.64
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	8,640	125.39	1,083,369.60
FISERV INC	8,270	115.66	956,508.20
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,070	261.92	280,254.40
GARTNER INC	1,240	313.35	388,554.00

GLOBAL PAYMENTS INC	4,050	158.01	639,940.50
GODADDY INC - CLASS A	2,300	74.96	172,408.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	12,440	139.58	1,736,375.20
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,070	175.74	188,041.80
MASTERCARD INC	12,360	340.23	4,205,242.80
MONGODB INC	800	507.41	405,928.00
OKTA INC	1,730	270.40	467,792.00
PAYCHEX INC	4,430	113.60	503,248.00
PAYPAL HOLDINGS INC	15,600	289.13	4,510,428.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	2,690	310.00	833,900.00
SQUARE INC - A	5,500	269.74	1,483,570.00
TWILIO INC - A	2,290	367.23	840,956.70
VERISIGN INC	1,430	220.23	314,928.90
VISA INC-CLASS A SHARES	23,640	225.11	5,321,600.40
WESTERN UNION CO	6,100	21.72	132,492.00
WIX.COM LTD	780	233.72	182,301.60
ADOBE INC	6,681	666.59	4,453,487.79
ANSYS INC	1,240	368.38	456,791.20
AUTODESK INC.	3,050	288.75	880,687.50
AVALARA INC	1,260	189.78	239,122.80
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,560	67.18	171,980.80
BLACK KNIGHT INC	2,200	75.89	166,958.00
CADENCE DESIGN SYS INC	3,810	165.71	631,355.10
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,870	115.96	216,845.20
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	1,580	124.36	196,488.80
CITRIX SYSTEMS INC	1,800	102.75	184,950.00
CLOUDFLARE INC - CLASS A	3,280	130.44	427,843.20
COUPA SOFTWARE INC	1,050	261.91	275,005.50
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	2,640	278.23	734,527.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	530	170.00	90,100.00
DATADOG INC - CLASS A	2,670	138.06	368,620.20
DOCUSIGN INC	2,710	310.05	840,235.50
DROPBOX INC-CLASS A	4,500	32.39	145,755.00
DYNATRACE INC	2,680	70.93	190,092.40

FAIR ISAAC CORP	400	467.23	186,892.00
FORTINET INC	1,890	320.19	605,159.10
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1,070	123.01	131,620.70
HUBSPOT INC	634	704.09	446,393.06
INTUIT INC	3,812	563.25	2,147,109.00
MICROSOFT CORP	99,820	301.14	30,059,794.80
NORTONLIFELOCK INC	8,000	27.28	218,240.00
ORACLE CORPORATION	26,240	90.00	2,361,600.00
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	21,400	26.64	570,096.00
PALO ALTO NETWORKS INC	1,376	468.22	644,270.72
PAYCOM SOFTWARE INC	730	496.26	362,269.80
PTC INC	1,560	132.99	207,464.40
RINGCENTRAL INC-CLASS A	1,070	250.81	268,366.70
SALESFORCE.COM INC	13,580	267.08	3,626,946.40
SERVICENOW INC	2,767	678.63	1,877,769.21
SPLUNK INC	2,340	158.44	370,749.60
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	3,370	74.00	249,380.00
SYNOPSYS INC	2,080	336.64	700,211.20
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	6,110	78.20	477,802.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	550	488.10	268,455.00
UNITY SOFTWARE INC	780	133.61	104,215.80
VMWARE INC - CLASS A	1,170	145.11	169,778.70
WORKDAY INC-CLASS A	2,640	277.74	733,233.60
ZENDESK INC	1,640	125.08	205,131.20
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,970	298.29	885,921.30
ZSCALER INC	1,090	287.40	313,266.00
ARISTA NETWORKS INC	790	363.12	286,864.80
CISCO SYSTEMS	58,930	59.42	3,501,620.60
F5 NETWORKS INC	920	203.61	187,321.20
JUNIPER NETWORKS INC	4,100	28.98	118,818.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,310	244.85	565,603.50
APPLE INC	232,860	154.30	35,930,298.00
DELL TECHNOLOGIES-C	3,800	97.14	369,132.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	18,700	15.48	289,476.00
HP INC	17,600	29.86	525,536.00

NETAPP INC	3,110	91.35	284,098.50
SEAGATE TECHNOLOGY	3,010	90.32	271,863.20
WESTERN DIGITAL CORP	4,230	61.41	259,764.30
AMPHENOL CORP-CL A	8,190	77.04	630,957.60
ARROW ELECTRS INC	1,050	117.43	123,301.50
CDW CORPORATION	1,980	202.70	401,346.00
COGNEX CORP	2,460	88.46	217,611.60
CORNING INC	11,480	39.49	453,345.20
IPG PHOTONICS CORP	540	174.22	94,078.80
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	2,570	181.28	465,889.60
TE CONNECTIVITY LTD	4,570	149.67	683,991.90
TRIMBLE INC	3,490	94.86	331,061.40
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	739	590.60	436,453.40
ADVANCED MICRO DEVICES	16,850	109.92	1,852,152.00
ANALOG DEVICES INC	7,441	162.44	1,208,716.04
APPLIED MATERIALS	12,780	135.83	1,735,907.40
BROADCOM INC	5,712	497.68	2,842,748.16
ENPHASE ENERGY INC	1,840	173.94	320,049.60
INTEL CORP	56,270	53.51	3,011,007.70
KLA CORP	2,180	341.75	745,015.00
LAM RESEARCH	1,967	610.71	1,201,266.57
MARVELL TECHNOLOGY INC	11,560	61.51	711,055.60
MICROCHIP TECHNOLOGY	3,870	156.83	606,932.10
MICRON TECHNOLOGY	15,560	73.81	1,148,483.60
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	630	502.13	316,341.90
NVIDIA CORP	34,800	228.43	7,949,364.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,800	212.99	809,362.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	5,770	45.71	263,746.70
QORVO INC	1,530	185.36	283,600.80
QUALCOMM INC	15,830	144.63	2,289,492.90
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,300	183.01	420,923.00
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	700	285.80	200,060.00
TERADYNE INC	2,420	121.88	294,949.60
TEXAS INSTRUMENTS INC	12,930	189.88	2,455,148.40
XILINX INC	3,340	155.96	520,906.40

AT & T INC	99,900	27.56	2,753,244.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,300	28.66	65,918.00
LIBERTY GLOBAL PLC-C	4,600	28.85	132,710.00
LUMEN TECHNOLOGIES INC	13,200	12.13	160,116.00
VERIZON COMMUNICATIONS	57,900	55.43	3,209,397.00
T-MOBILE US INC	8,640	136.00	1,175,040.00
ALLIANT ENERGY CORP	3,670	61.47	225,594.90
AMERICAN ELECTRIC POWER	6,790	90.41	613,883.90
DUKE ENERGY CORP	10,810	105.68	1,142,400.80
EDISON INTERNATIONAL	5,260	58.65	308,499.00
ENTERGY CORP	2,790	112.56	314,042.40
EVERGY INC	3,150	68.50	215,775.00
EVERSOURCE ENERGY	4,660	91.99	428,673.40
EXELON CORPORATION	13,350	49.82	665,097.00
FIRSTENERGY CORP	7,560	39.59	299,300.40
NEXTERA ENERGY INC	27,300	85.69	2,339,337.00
NRG ENERGY INC	3,040	45.43	138,107.20
PG&E CORP	20,300	9.15	185,745.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	1,600	77.18	123,488.00
PPL CORPORATION	10,400	30.09	312,936.00
SOUTHERN CO.	14,660	66.27	971,518.20
XCEL ENERGY INC	7,560	69.80	527,688.00
ATMOS ENERGY CORP	1,720	97.50	167,700.00
UGI CORP	3,120	46.88	146,265.60
AMEREN CORPORATION	3,440	88.11	303,098.40
CENTERPOINT ENERGY INC	7,700	25.94	199,738.00
CMS ENERGY CORP	4,000	64.96	259,840.00
CONSOLIDATED EDISON INC	4,850	76.30	370,055.00
DOMINION ENERGY INC	11,060	78.38	866,882.80
DTE ENERGY COMPANY	2,800	120.75	338,100.00
NISOURCE INC	5,800	25.06	145,348.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	6,880	64.14	441,283.20
SEMPRA ENERGY	4,490	133.41	599,010.90
WEC ENERGY GROUP INC	4,290	96.08	412,183.20
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,470	185.15	457,320.50

ESSENTIAL UTILITIES INC	3,320	49.43	164,107.60
ALLY FINANCIAL INC	5,440	51.06	277,766.40
AMERICAN EXPRESS CO	9,480	159.30	1,510,164.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	6,380	157.26	1,003,318.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	4,190	122.99	515,328.10
SYNCHRONY FINANCIAL	8,240	47.38	390,411.20
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,630	272.35	443,930.50
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	2,300	61.81	142,163.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	11,460	53.93	618,037.80
BLACKROCK INC	2,126	937.28	1,992,657.28
BLACKSTONE INC	9,610	129.00	1,239,690.00
CARLYLE GROUP INC/THE	2,100	50.09	105,189.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,540	126.25	194,425.00
CME GROUP INC	4,990	195.30	974,547.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	540	385.91	208,391.40
FRANKLIN RESOURCES INC	4,200	32.00	134,400.00
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	700	106.35	74,445.00
GOLDMAN SACHS GROUP	4,789	411.31	1,969,763.59
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	7,790	121.13	943,602.70
INVESCO LTD	5,600	24.88	139,328.00
KKR & CO INC-A	7,400	64.44	476,856.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	513	475.22	243,787.86
MOODYS CORP	2,330	385.39	897,958.70
MORGAN STANLEY	19,660	104.25	2,049,555.00
MSCI INC	1,141	650.75	742,505.75
NASDAQ INC	1,600	198.53	317,648.00
NORTHERN TRUST CORP	2,750	117.35	322,712.50
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,800	139.04	250,272.00
S&P GLOBAL INC	3,346	452.08	1,512,659.68
SCHWAB(CHARLES)CORP	20,280	72.09	1,461,985.20
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,860	62.04	115,394.40
STATE STREET CORP	4,870	92.89	452,374.30
T ROWE PRICE GROUP INC	3,120	218.57	681,938.40
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,550	88.41	137,035.50
AES CORP	9,700	24.64	239,008.00
	5,500	19.11	105,105.00

VISTRA CORP				
CERNER CORP	4,260	75.69	322,439.40	
TELADOC HEALTH INC	1,910	144.56	276,109.60	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,950	317.64	619,398.00	
10X GENOMICS INC-CLASS A	1,080	185.21	200,026.80	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,310	179.28	772,696.80	
AVANTOR INC	7,200	40.72	293,184.00	
BIO TECHNE CORP	548	513.09	281,173.32	
BIO-RAD LABORATORIES-A	310	819.70	254,107.00	
CHARLES RIVER LABORATORIES	710	449.55	319,180.50	
ILLUMINA INC	2,022	466.98	944,233.56	
IQVIA HOLDINGS INC	2,630	263.22	692,268.60	
METTLER-TOLEDO INTL	329	1,575.31	518,276.99	
PERKINELMER INC	1,540	190.50	293,370.00	
PPD INC	1,820	46.72	85,030.40	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5,454	568.11	3,098,471.94	
WATERS CORP	900	423.40	381,060.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,950	83.12	162,084.00	
CLARIVATE PLC	4,700	26.26	123,422.00	
COSTAR GROUP INC	5,370	87.86	471,808.20	
EQUIFAX INC	1,680	278.28	467,510.40	
IHS MARKIT LTD	5,200	122.24	635,648.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,890	137.10	259,119.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,880	99.02	186,157.60	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	1,430	103.65	148,219.50	
TRUNSON	2,650	124.47	329,845.50	
VERISK ANALYTICS INC	2,100	205.08	430,668.00	
CBRE GROUP INC	4,560	98.56	449,433.60	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	15,800	4.22	66,676.00	
ALTICE USA INC-A	3,200	28.27	90,464.00	
CABLE ONE INC	77	2,085.43	160,578.11	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,868	811.33	1,515,564.44	
COMCAST CORP-CL A	64,100	61.72	3,956,252.00	
DISCOVERY INC - A	2,030	28.31	57,469.30	
DISCOVERY INC - C	3,900	27.16	105,924.00	
	3,500	45.43	159,005.00	

DISH NETWORK CORP-A				
FOX CORP-CLASS A	4,980	36.89	183,712.20	
FOX CORP-CLASS B	1,900	34.13	64,847.00	
INTERPUBRIC GROUP	5,100	37.30	190,230.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-A	390	185.31	72,270.90	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	2,200	190.80	419,760.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	2,328	50.10	116,632.80	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	1,160	50.16	58,185.60	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	5,400	22.56	121,824.00	
OMNICOM GROUP	3,000	73.74	221,220.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	16,000	6.33	101,280.00	
VIACOMCBS INC-CLASS B	8,650	41.28	357,072.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,760	81.18	873,496.80	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	7,180	44.02	316,063.60	
DISNEY (WALT) CO	25,390	181.00	4,595,590.00	
ELECTRONIC ARTS	4,060	146.60	595,196.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,700	51.40	138,780.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,380	86.08	204,870.40	
NETFLIX INC	6,200	590.53	3,661,286.00	
ROKU INC	1,630	342.27	557,900.10	
SEA LTD-ADR	980	353.36	346,292.80	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	1,680	160.56	269,740.80	
ALPHABET INC-CL A	4,199	2,874.79	12,071,243.21	
ALPHABET INC-CL C	4,066	2,895.50	11,773,103.00	
FACEBOOK INC-A	33,430	376.26	12,578,371.80	
IAC/INTERACTIVECORP	1,160	132.06	153,189.60	
MATCH GROUP INC	3,480	148.19	515,701.20	
PINTEREST INC- CLASS A	7,520	56.59	425,556.80	
SNAP INC-A	13,380	75.08	1,004,570.40	
TWITTER INC	10,950	64.66	708,027.00	
ZILLOW GROUP INC - A	860	97.08	83,488.80	
ZILLOW GROUP INC - C	2,340	97.56	228,290.40	
小計銘柄数：597			561,963,019.05	
			(61,720,398,382)	
組入時価比率：68.6%			72.6%	

カナダドル	CAMECO CORP	5,000	27.04	135,200.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	16,300	43.82	714,266.00	
	CENOVUS ENERGY INC	18,000	10.98	197,640.00	
	ENBRIDGE INC	28,130	50.12	1,409,875.60	
	IMPERIAL OIL	3,700	34.32	126,984.00	
	KEYERA CORP	3,200	30.41	97,312.00	
	PARKLAND CORP	2,100	37.30	78,330.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	7,400	38.96	288,304.00	
	SUNCOR ENERGY INC	20,800	23.47	488,176.00	
	TC ENERGY CORP	13,820	60.57	837,077.40	
	NUTRIEN LTD	7,760	76.60	594,416.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,260	72.27	163,330.20	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	3,560	73.72	262,443.20	
	B2GOLD CORP	12,600	5.00	63,000.00	
	BARRICK GOLD	24,300	25.43	617,949.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	8,600	25.67	220,762.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,760	185.27	511,345.20	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	9,400	10.03	94,282.00	
	KINROSS GOLD CORP	18,000	7.75	139,500.00	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	3,710	52.77	195,776.70	
	LUNDIN MINING CORP	9,600	10.21	98,016.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	3,200	33.32	106,624.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	7,000	30.78	215,460.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	6,550	58.36	382,258.00	
	YAMANA GOLD INC	12,300	5.53	68,019.00	
	WEST FRASER TIMBER	1,210	100.60	121,726.00	
	CAE INC	4,300	38.06	163,658.00	
	WSP GLOBAL INC	1,610	163.91	263,895.10	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	2,700	20.54	55,458.00	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,200	107.06	128,472.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	2,300	45.27	104,121.00	
	RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	1,660	78.82	130,841.20	
	AIR CANADA	2,000	24.02	48,040.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	9,870	159.01	1,569,428.70	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	9,335	90.59	845,657.65	

MAGNA INTERNATIONAL INC	3,930	100.68	395,672.40	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,700	50.05	135,135.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	3,780	80.54	304,441.20	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	820	191.76	157,243.20	
DOLLARAMA INC	4,030	56.86	229,145.80	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	11,600	50.42	584,872.00	
EMPIRE CO LTD A	2,100	40.19	84,399.00	
LOBLAW COMPANIES	2,520	89.81	226,321.20	
METRO INC	3,550	64.43	228,726.50	
WESTON(GEORGE)LTD	1,170	136.27	159,435.90	
SAPUTO INC	3,100	35.21	109,151.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	4,600	36.73	168,958.00	
CANOPY GROWTH CORP	2,800	21.25	59,500.00	
BANK OF MONTREAL	9,100	127.73	1,162,343.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	16,950	78.12	1,324,134.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	6,320	145.57	920,002.40	
NATIONAL BANK OF CANADA	4,660	98.18	457,518.80	
ROYAL BANK OF CANADA	19,950	129.48	2,583,126.00	
TORONTO DOMINION BANK	25,400	82.45	2,094,230.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	371	567.02	210,364.42	
GREAT-WEST LIFE CO INC	3,800	38.70	147,060.00	
IA FINANCIAL CORP INC	1,500	70.45	105,675.00	
INTACT FINANCIAL CORP	2,510	173.04	434,330.40	
MANULIFE FINANCIAL CORP	26,500	24.42	647,130.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	7,600	43.03	327,028.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	8,070	64.69	522,048.30	
CGI INC	3,060	115.44	353,246.40	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	850	153.56	130,526.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,578	1,946.48	3,071,545.44	
BLACKBERRY LTD	7,400	13.88	102,712.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	274	2,192.52	600,750.48	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	1,470	150.19	220,779.30	
OPEN TEXT CORP	3,700	68.66	254,042.00	
BCE INC	1,020	65.73	67,044.60	

		TELUS CORP	5,200	29.18	151,736.00	
		ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	4,800	63.49	304,752.00	
		EMERA INC	3,540	59.18	209,497.20	
		FORTIS INC	6,470	57.79	373,901.30	
		HYDRO ONE LTD	4,300	31.82	136,826.00	
		ALTAGAS LTD	3,600	25.51	91,836.00	
		ALGONQUIN POWER & UTILITIES	8,600	19.61	168,646.00	
		ATCO LTD CL1	900	42.26	38,034.00	
		CANADIAN UTILITIES LTD A	2,000	35.62	71,240.00	
		BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	17,800	71.21	1,267,538.00	
		IGM FINANCIAL INC	1,400	47.04	65,856.00	
		ONEX CORPORATION	1,200	88.41	106,092.00	
		TMX GROUP LTD	730	139.78	102,039.40	
		BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	1,800	55.48	99,864.00	
		NORTHLAND POWER INC	3,240	42.55	137,862.00	
		THOMSON REUTERS CORP	2,340	148.81	348,215.40	
		FIRSTSERVICE CORP	580	236.21	137,001.80	
		QUEBECOR INC-CL B	2,500	31.79	79,475.00	
		SHAW COMMUNICATIONS INC-B	6,900	37.25	257,025.00	
	小計	銘柄数：88			34,263,718.79	
					(3,000,473,854)	
		組入時価比率：3.3%			3.5%	
	ユーロ	TENARIS SA	7,000	8.49	59,444.00	
		ENI SPA	35,300	10.53	371,709.00	
		GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	6,600	8.48	55,981.20	
		NESTE OYJ	6,000	53.22	319,320.00	
		OMV AG	1,970	47.30	93,181.00	
		REPSOL SA	20,900	9.59	200,451.90	
		TOTALENERGIES SE	35,030	37.26	1,305,392.95	
		VOPAK	700	35.88	25,116.00	
		AIR LIQUIDE SA	6,580	151.14	994,501.20	
		AKZO NOBEL	2,580	102.00	263,160.00	
		ARKEMA	820	111.35	91,307.00	
		BASF SE	12,630	64.81	818,550.30	
		COVESTRO AG	2,710	57.28	155,228.80	
			2,700	28.30	76,410.00	

EVONIK INDUSTRIES AG				
FUCHS PETROLUB SE-PREF	740	43.54	32,219.60	
KONINKLIJKE DSM NV	2,380	177.85	423,283.00	
LANXESS	1,270	63.28	80,365.60	
SOLVAY SA	1,010	110.70	111,807.00	
SYMRISE AG	1,730	119.95	207,513.50	
UMICORE	2,710	54.60	147,966.00	
CRH PLC	10,840	44.68	484,331.20	
HEIDELBERGCEMENT AG	2,190	72.04	157,767.60	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,570	49.35	176,179.50	
ARCELORMITTAL	10,000	28.21	282,100.00	
VOESTALPINE AG	1,680	37.90	63,672.00	
STORA ENSO OYJ-R	8,600	16.88	145,168.00	
UPM-KYMMENE OYJ	7,200	34.80	250,560.00	
AIRBUS SE	8,170	114.48	935,301.60	
DASSAULT AVIATION SA	26	943.00	24,518.00	
MTU AERO ENGINES AG	780	194.20	151,476.00	
SAFRAN SA	4,830	104.44	504,445.20	
THALES SA	1,580	85.82	135,595.60	
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	6,900	61.00	420,900.00	
KINGSPAN GROUP PLC	2,170	94.12	204,240.40	
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	3,600	23.27	83,772.00	
BOUYGUES	3,100	35.89	111,259.00	
EIFFAGE SA	1,250	91.18	113,975.00	
FERROVIAL SA	6,856	24.93	170,920.08	
VINCI	7,470	91.14	680,815.80	
LEGRAND SA	3,630	97.38	353,489.40	
PRYSMIAN SPA	3,700	32.46	120,102.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	7,530	153.88	1,158,716.40	
SIEMENS ENERGY AG	5,900	25.28	149,152.00	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	3,000	25.66	76,980.00	
SIEMENS AG	10,650	142.58	1,518,477.00	
ALSTOM	4,590	34.62	158,905.80	
CNH INDUSTRIAL NV	13,700	14.04	192,416.50	
GEA GROUP AG	2,180	40.44	88,159.20	

KION GROUP AG	1,100	89.68	98,648.00	
KNORR-BREMSE AG	1,030	102.25	105,317.50	
KONE OYJ	4,820	69.82	336,532.40	
RATIONAL AG	56	944.00	52,864.00	
WARTSILA OYJ	6,600	11.83	78,111.00	
BRENNTAG SE	2,180	85.22	185,779.60	
DEUTSCHE POST AG-REG	13,750	59.19	813,862.50	
INPOST SA	2,800	15.75	44,111.20	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	4,500	8.28	37,291.50	
ADP	460	98.02	45,089.20	
AENA SME SA	960	133.90	128,544.00	
ATLANTIA SPA	6,900	15.76	108,778.50	
GETLINK	6,100	13.71	83,661.50	
CONTINENTAL AG	1,610	110.88	178,516.80	
FAURECIA	1,661	39.99	66,423.39	
MICHELIN (CGDE)	2,450	136.85	335,282.50	
VALEO SA	3,300	23.31	76,923.00	
BAYER MOTOREN WERK	4,510	79.40	358,094.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	760	68.00	51,680.00	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	11,770	70.17	825,900.90	
FERRARI NV	1,730	184.30	318,839.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	2,150	87.60	188,340.00	
RENAULT SA	2,700	30.11	81,297.00	
STELLANTIS NV	28,600	17.13	489,918.00	
VOLKSWAGEN AG	463	288.80	133,714.40	
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,540	201.90	512,826.00	
SEB SA	440	137.60	60,544.00	
ADIDAS AG	2,640	299.05	789,492.00	
ESSILORLUXOTTICA	4,020	166.46	669,169.20	
HERMES INTERNATIONAL	434	1,255.00	544,670.00	
KERING SA	1,049	683.30	716,781.70	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	3,884	634.90	2,465,951.60	
MONCLER SPA	2,990	54.02	161,519.80	
PUMA SE	1,340	102.55	137,417.00	
ACCOR SA	2,250	28.67	64,507.50	

FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,310	168.95	390,274.50	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	1,200	44.54	53,448.00	
SODEXO	1,110	69.42	77,056.20	
DELIVERY HERO SE	2,320	129.25	299,860.00	
HELLOFRESH SE	2,380	93.66	222,910.80	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	2,510	81.05	203,435.50	
PROSUS NV	12,910	77.36	998,717.60	
ZALANDO SE	3,160	94.70	299,252.00	
INDITEX SA	14,900	29.57	440,593.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	8,700	15.53	135,111.00	
COLRUYT SA	680	47.81	32,510.80	
JERONIMO MARTINS	3,800	18.24	69,312.00	
KESKO OYJ-B SHS	3,900	34.78	135,642.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	14,700	28.29	415,936.50	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	10,560	50.29	531,062.40	
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	7,800	11.91	92,898.00	
HEINEKEN HOLDING NV	1,580	77.40	122,292.00	
HEINEKEN NV	3,740	91.80	343,332.00	
PERNOD RICARD SA	2,870	183.70	527,219.00	
REMY COINTREAU	280	168.60	47,208.00	
DANONE	9,220	61.51	567,122.20	
JDE PEET'S BV	900	28.98	26,082.00	
KERRY GROUP PLC-A	2,200	124.25	273,350.00	
HENKEL AG & CO KGAA	1,480	76.05	112,554.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,480	82.10	203,608.00	
BEIERSDORF AG	1,430	102.60	146,718.00	
LOREAL-ORD	3,507	394.85	1,384,738.95	
BIOMERIEUX	610	110.65	67,496.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	560	190.90	106,904.00	
DIASORIN SPA	330	201.90	66,627.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	12,460	39.94	497,714.70	
SARTORIUS AG-VORZUG	370	578.40	214,008.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,050	58.74	237,897.00	
AMPLIFON SPA	1,800	44.12	79,416.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	2,990	65.16	194,828.40	

FRESENIUS SE & CO KGAA	5,820	43.73	254,508.60	
ORPEA	670	105.60	70,752.00	
ARGENX SE	660	295.00	194,700.00	
GRIFOLS SA	4,200	20.92	87,864.00	
BAYER AG-REG	13,620	47.47	646,609.50	
IPSEN	520	82.82	43,066.40	
MERCK KGAA	1,880	205.90	387,092.00	
ORION OYJ	1,300	35.15	45,695.00	
RECORDATI SPA	1,620	55.46	89,845.20	
SANOFI	15,770	87.85	1,385,394.50	
UCB SA	1,720	98.04	168,628.80	
ABN AMRO BANK NV-CVA	6,100	11.86	72,358.20	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	92,100	5.56	512,812.80	
BANCO SANTANDER SA	242,000	3.07	744,392.00	
BNP PARIBAS	15,620	53.87	841,449.40	
CAIXABANK	60,600	2.64	160,165.80	
COMMERZBANK AG	14,500	5.45	79,025.00	
CREDIT AGRICOLE SA	16,100	12.11	195,099.80	
ERSTE GROUP BANK AG	3,980	34.87	138,782.60	
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	8,400	15.38	129,234.00	
ING GROEP NV	54,000	11.79	636,768.00	
INTESA SANPAOLO	233,000	2.38	556,287.50	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	13,429	0.00	0.00	
KBC GROEP NV	3,560	72.12	256,747.20	
MEDIOBANCA S.P.A.	8,700	9.88	86,008.20	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	1,900	20.94	39,786.00	
SOCIETE GENERALE	11,200	26.56	297,528.00	
UNICREDIT SPA	29,500	10.85	320,252.00	
EURAZEO SE	620	86.60	53,692.00	
EXOR NV	1,500	70.02	105,030.00	
GROUPE BRUXELLES LAM	1,600	96.94	155,104.00	
SOFINA SA	220	371.80	81,796.00	
WENDEL	420	122.00	51,240.00	
AEGON NV	25,000	4.16	104,075.00	
AGEAS	2,600	42.46	110,396.00	

ALLIANZ SE-REG	5,740	196.68	1,128,943.20
ASSICURAZIONI GENERALI	15,300	17.32	264,996.00
AXA SA	27,300	23.59	644,007.00
CNP ASSURANCES	1,640	14.41	23,640.60
HANNOVER RUECK SE	860	154.55	132,913.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,910	241.65	461,551.50
NN GROUP NV	4,000	43.92	175,680.00
POSTE ITALIANE SPA	7,400	11.42	84,545.00
SAMPO OYJ-A SHS	7,110	43.76	311,133.60
SCOR SE	2,200	25.43	55,946.00
ADYEN NV	278	2,670.00	742,260.00
AMADEUS IT GROUP SA	6,500	51.40	334,100.00
ATOS SE	1,420	45.18	64,155.60
BECHTLE AG	1,200	62.74	75,288.00
CAPGEMINI SA	2,180	191.55	417,579.00
EDENRED	3,300	46.95	154,935.00
NEXI SPA	5,800	17.65	102,370.00
WORLDLINE SA	3,370	72.39	243,954.30
DASSAULT SYSTEMES SE	9,390	48.79	458,138.10
NEMETSCHEK SE	890	83.80	74,582.00
SAP SE	14,460	125.60	1,816,176.00
TEAMVIEWER AG	2,470	28.25	69,777.50
NOKIA OYJ	74,000	5.12	378,880.00
ASM INTERNATIONAL NV	700	334.20	233,940.00
ASML HOLDING NV	5,862	721.80	4,231,191.60
INFINEON TECHNOLOGIES AG	17,890	36.95	661,035.50
STMICROELECTRONICS NV	9,250	37.90	350,575.00
CELLNEX TELECOM SA	7,220	57.52	415,294.40
DEUTSCHE TELEKOM-REG	46,300	17.80	824,325.20
ELISA OYJ	1,900	54.34	103,246.00
ILIAD SA	150	182.00	27,300.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	5,000	9.99	49,960.00
KONINKLIJKE KPN NV	50,600	2.70	136,721.20
ORANGE SA	28,900	9.54	275,966.10
PROXIMUS	2,400	16.69	40,068.00

TELECOM ITALIA SPA	157,000	0.36	58,058.60	
TELECOM ITALIA-RNC	68,000	0.39	26,894.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	15,000	2.41	36,165.00	
TELEFONICA SA	73,065	4.12	301,246.99	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1,500	36.42	54,630.00	
ELECTRICITE DE FRANCE	6,400	10.96	70,144.00	
ELIA GROUP SA/NV	380	106.90	40,622.00	
ENDESA S.A.	4,600	20.81	95,726.00	
ENEL SPA	113,000	7.72	872,586.00	
ENERGIAS DE PORTUGAL	38,000	4.78	181,906.00	
FORTUM OYJ	6,600	26.32	173,712.00	
IBERDROLA SA	82,820	10.55	874,165.10	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	5,400	17.25	93,150.00	
TERNA SPA	18,500	6.69	123,839.00	
VERBUND AG	920	94.30	86,756.00	
ENAGAS SA	3,700	19.22	71,132.50	
NATURGY ENERGY GROUP SA	4,100	21.77	89,257.00	
SNAM SPA	27,792	4.93	137,209.10	
E.ON SE	32,400	11.12	360,352.80	
ENGIE	26,400	11.99	316,641.60	
RWE AG	9,310	33.35	310,488.50	
SUEZ	5,000	19.61	98,050.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	7,300	29.59	216,007.00	
AMUNDI SA	910	79.20	72,072.00	
DEUTSCHE BANK AG-REG	27,200	10.54	286,742.40	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,740	145.50	398,670.00	
EDP RENOVAVEIS SA	3,900	23.16	90,324.00	
UNIPER SE	1,300	34.40	44,720.00	
EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,880	122.70	230,676.00	
QIAGEN N.V.	3,100	47.70	147,870.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	391	531.00	207,621.00	
BUREAU VERITAS SA	4,200	28.13	118,146.00	
RANDSTAD NV	1,710	61.92	105,883.20	
TELEPERFORMANCE	853	377.10	321,666.30	
WOLTERS KLUWER	3,710	97.32	361,057.20	

小計	AROUNDTOWN SA	14,500	6.31	91,611.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	4,780	52.34	250,185.20	
	LEG IMMOBILIEN SE	980	130.45	127,841.00	
	VONOVIA SE	7,410	54.66	405,030.60	
	PUBLICIS GROUPE	3,130	55.78	174,591.40	
	BOLLORE	13,000	5.06	65,845.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	1,180	55.54	65,537.20	
	VIVENDI SE	9,980	32.93	328,641.40	
	SCOUT24 AG	1,320	71.70	94,644.00	
	銘柄数：232			69,055,312.06	
				(9,006,884,351)	
	組入時価比率：10.0%			10.6%	
英ポンド	JACKSON FINANCIAL INC	915	14.15	12,953.23	
	BP PLC	282,900	2.96	839,081.40	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	57,600	14.33	825,753.60	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	52,100	14.31	745,655.20	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	1,890	92.00	173,880.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	2,600	29.00	75,400.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	18,250	30.91	564,107.50	
	ANTOFAGASTA PLC	5,400	14.24	76,923.00	
	BHP GROUP PLC	29,300	21.19	620,867.00	
	EVRAZ PLC	7,600	5.92	45,037.60	
	GLENCORE PLC	138,200	3.33	460,275.10	
	RIO TINTO PLC-REG	15,540	54.08	840,403.20	
	MONDI PLC	7,200	20.40	146,880.00	
	BAE SYSTEMS PLC	44,700	5.64	252,197.40	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	124,000	1.11	138,508.00	
	DCC PLC	1,370	62.96	86,255.20	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	59,400	1.88	111,969.00	
	SMITHS GROUP PLC	5,700	14.40	82,080.00	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1,040	164.65	171,236.00	
	ASHTREAD GROUP PLC	6,240	57.34	357,801.60	
	BUNZLE	4,700	25.94	121,918.00	
	FERGUSON PLC	3,060	106.10	324,666.00	
	RENTOKIL INTIAL PLC	26,200	5.81	152,222.00	
		14,500	7.11	103,153.00	

BARRATT DEVELOPMENTS PLC				
PERSIMMON PLC	4,690	28.70	134,603.00	
TAYLOR WIMPEY PLC	55,000	1.77	97,542.50	
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	1,800	47.51	85,518.00	
BURBERRY GROUP PLC	6,000	18.92	113,520.00	
COMPASS GROUP PLC	24,900	14.96	372,628.50	
ENTAIN PLC	8,600	19.43	167,098.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,680	45.89	122,985.20	
WHITBREAD PLC	2,900	32.06	92,974.00	
OCADO GROUP PLC	7,200	20.05	144,360.00	
NEXT PLC	1,800	79.14	142,452.00	
JD SPORTS FASHION PLC	7,600	10.32	78,470.00	
KINGFISHER PLC	30,100	3.48	104,898.50	
MORRISON SUPERMARKETS	31,000	2.90	89,900.00	
SAINSBURY	25,000	3.03	75,950.00	
TESCO PLC	105,000	2.55	268,485.00	
COCA-COLA HBC AG-DI	2,800	26.36	73,808.00	
DIAGEO PLC	32,400	35.30	1,143,882.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,900	19.63	96,211.50	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	30,600	27.11	829,566.00	
IMPERIAL BRANDS PLC	13,200	15.55	205,326.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	9,890	56.89	562,642.10	
UNILEVER PLC	36,410	39.78	1,448,389.80	
SMITH & NEPHEW PLC	12,200	13.99	170,739.00	
NMC HEALTH PLC	800	0.24	192.00	
ASTRAZENECA PLC	21,525	85.09	1,831,562.25	
GLAXOSMITHKLINE PLC	70,000	14.78	1,035,160.00	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,100	25.72	54,012.00	
BARCLAYS PLC	240,000	1.84	443,280.00	
HSBC HOLDINGS PLC	286,400	3.84	1,101,064.80	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	980,000	0.43	425,418.00	
NATWEST GROUP PLC	83,000	2.14	177,620.00	
STANDARD CHARTERED PLC	36,000	4.53	163,224.00	
M&G PLC	39,000	2.02	78,936.00	
ADMIRAL GROUP PLC	2,850	34.86	99,351.00	

	AVIVA PLC	54,600	4.13	225,498.00	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	16,500	3.13	51,645.00	
	LEGAL & GENERAL	82,800	2.79	231,012.00	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	8,100	6.25	50,641.20	
	PRUDENTIAL PLC	36,600	15.37	562,542.00	
	AVEVA GROUP PLC	1,582	41.76	66,064.32	
	SAGE GROUP PLC (THE)	16,300	7.43	121,206.80	
	HALMA PLC	5,350	30.40	162,640.00	
	BT GROUP PLC	124,000	1.62	200,942.00	
	VODAFONE GROUP PLC	395,000	1.20	477,239.00	
	SSE PLC	14,100	16.62	234,342.00	
	NATIONAL GRID PLC	50,200	9.41	472,633.00	
	SEVERN TRENT PLC	3,400	28.02	95,268.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	9,400	10.56	99,264.00	
	3I GROUP PLC	13,100	13.35	174,950.50	
	ABRDN PLC	27,600	2.63	72,753.60	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	4,600	14.93	68,701.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	4,560	80.68	367,900.80	
	SCHRODERS PLC	1,510	37.93	57,274.30	
	ST JAMES S PLACE PLC	7,700	16.70	128,590.00	
	EXPERIAN PLC	13,060	32.47	424,058.20	
	INTERTEK GROUP PLC	2,190	53.48	117,121.20	
	RELX PLC	26,700	21.91	584,997.00	
	INFORMA PLC	21,300	5.49	117,064.80	
	PEARSON	10,800	7.62	82,296.00	
	WPP PLC	16,600	9.90	164,406.40	
	AUTO TRADER GROUP PLC	12,100	6.34	76,738.20	
小計	銘柄数：85			24,848,781.50	
				(3,780,245,129)	
	組入時価比率：4.2%			4.4%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	3,200	19.29	61,728.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	118	982.50	115,935.00	
	GIVAUDAN-REG	133	4,584.00	609,672.00	
	SIKA AG-REG	1,940	329.90	640,006.00	
	HOLCIM LTD	7,550	51.96	392,298.00	
		513	763.00	391,419.00	

GEBERIT AG-REG				
ABB LTD	24,200	34.42	832,964.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	290	282.00	81,780.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	550	295.30	162,415.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	730	337.70	246,521.00	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	7,240	101.50	734,860.00	
THE SWATCH GROUP AG-B	410	258.50	105,985.00	
THE SWATCH GROUP AG-REG	550	50.35	27,692.50	
BARRY CALLEBAUT AG	52	2,332.00	121,264.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	14	10,730.00	150,220.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	109,200.00	218,400.00	
NESTLE SA-REG	40,260	115.22	4,638,757.20	
ALCON INC	7,090	77.24	547,631.60	
SONOVA HOLDING AG-REG	740	358.30	265,142.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	145	1,781.00	258,245.00	
NOVARTIS AG-REG	30,750	83.37	2,563,627.50	
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	9,821	364.75	3,582,209.75	
ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	480	405.60	194,688.00	
VIFOR PHARMA AG	620	133.20	82,584.00	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	430	77.70	33,411.00	
BALOISE HOLDING AG	580	147.40	85,492.00	
SWISS LIFE HOLDING AG	446	478.80	213,544.80	
SWISS RE LTD	4,130	82.62	341,220.60	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,086	399.30	832,939.80	
TEMENOS AG-REG	960	139.45	133,872.00	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,400	94.36	226,464.00	
SWISSCOM AG-REG	365	535.20	195,348.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	35,500	9.68	343,853.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	3,000	62.52	187,560.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	310	1,622.50	502,975.00	
UBS GROUP AG	50,300	15.29	769,338.50	
LONZA AG-REG	1,021	768.80	784,944.80	
ADECCO GROUP AG-REG	2,210	51.14	113,019.40	
SGS SA-REG	85	2,883.00	245,055.00	
SWISS PRIME SITE-REG	1,060	97.65	103,509.00	
小計				

	銘柄数：40			22,138,591.45	
				(2,659,066,219)	
	組入時価比率：3.0%			3.1%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	2,500	263.20	658,000.00	
	BOLIDEN AB	3,880	300.00	1,164,000.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	8,300	155.20	1,288,160.00	
	ASSA ABLOY AB-B	14,200	274.70	3,900,740.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	20,500	124.80	2,558,400.00	
	SKANSKA AB-B SHS	4,700	249.80	1,174,060.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,800	303.30	545,940.00	
	ALFA LAVAL AB	4,200	351.90	1,477,980.00	
	ATLAS COPCO AB-A	9,180	591.20	5,427,216.00	
	ATLAS COPCO AB-B	5,260	497.90	2,618,954.00	
	EPIROC AB - A	9,300	192.15	1,786,995.00	
	EPIROC AB - B	5,900	167.00	985,300.00	
	SANDVIK AB	16,000	220.70	3,531,200.00	
	SKF AB-B SHARES	5,400	219.30	1,184,220.00	
	VOLVO AB-A SHS	2,800	196.50	550,200.00	
	VOLVO AB-B SHS	20,200	192.28	3,884,056.00	
	SECURITAS AB-B SHS	4,300	142.90	614,470.00	
	ELECTROLUX AB-B	3,300	217.90	719,070.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	5,700	116.05	661,485.00	
	EVOLUTION AB	2,310	1,473.40	3,403,554.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	9,900	175.66	1,739,034.00	
	ICA GRUPPEN AB	1,580	421.70	666,286.00	
	SWEDISH MATCH AB	22,830	80.24	1,831,879.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	8,200	275.50	2,259,100.00	
	NORDEA BANK ABP	46,000	105.60	4,857,600.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	22,600	118.25	2,672,450.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	19,700	98.40	1,938,480.00	
	SWEDBANK AB	13,300	168.44	2,240,252.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,600	315.60	504,960.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,000	299.40	598,800.00	
	INVESTOR AB-B SHS	24,900	205.90	5,126,910.00	
	KINNEVIK AB - B	3,430	343.70	1,178,891.00	

	小計	LUNDBERGS AB-B SHS	1,100	546.00	600,600.00	
		SINCH AB	7,400	200.60	1,484,440.00	
		ERICSSON LM-B	41,400	102.92	4,260,888.00	
		HEXAGON AB-B SHS	27,000	150.15	4,054,050.00	
		TELIA CO AB	35,000	36.72	1,285,200.00	
		TELE 2 AB-B SHS	7,300	130.40	951,920.00	
		EQT AB	3,450	417.80	1,441,410.00	
		FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,400	598.40	837,760.00	
		EMBRACER GROUP AB	3,600	207.00	745,200.00	
		銘柄数：41			79,410,110.20	
					(1,018,831,713)	
		組入時価比率：1.1%			1.2%	
ノルウェーク ローネ	小計	EQUINOR ASA	13,300	194.30	2,584,190.00	
		YARA INTERNATIONAL ASA	2,420	437.80	1,059,476.00	
		NORSK HYDRO	18,700	62.20	1,163,140.00	
		MOWI ASA	6,200	232.10	1,439,020.00	
		ORKLA ASA	9,800	78.14	765,772.00	
		DNB BANK ASA	13,300	189.95	2,526,335.00	
		GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,900	203.80	591,020.00	
		TELENOR ASA	9,900	152.60	1,510,740.00	
		SCHIBSTED ASA-B SHS	1,560	412.00	642,720.00	
		SCHIBSTED ASA-CL A	900	463.90	417,510.00	
		ADEVINTA ASA	3,500	167.00	584,500.00	
		銘柄数：11			13,284,423.00	
					(168,047,950)	
		組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマークク ローネ		CHR HANSEN HOLDING A/S	1,460	561.00	819,060.00	
		NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,840	496.70	1,410,628.00	
		ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S-B SHS	130	3,324.00	432,120.00	
		VESTAS WIND SYSTEMS A/S	14,170	265.50	3,762,135.00	
		DSV PANALPINA A S	2,840	1,646.00	4,674,640.00	
		A P MOLLER - MAERSK A/S-A	45	17,570.00	790,650.00	
		AP MOLLER-MAERSK A/S-B	84	18,615.00	1,563,660.00	
		PANDORA A/S	1,410	775.60	1,093,596.00	

	CARLSBERG B	1,460	1,088.50	1,589,210.00	
	AMBU A/S-B	2,300	210.40	483,920.00	
	COLOPLAST-B	1,660	1,104.00	1,832,640.00	
	DEMANT A/S	1,360	364.90	496,264.00	
	GN STORE NORD A/S	1,750	487.00	852,250.00	
	GENMAB A/S	898	3,062.00	2,749,676.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	23,570	629.60	14,839,672.00	
	DANSKE BANK AS	9,400	106.85	1,004,390.00	
	TRYG A/S	5,000	154.75	773,750.00	
	ORSTED A/S	2,620	989.00	2,591,180.00	
小計	銘柄数：18			41,759,441.00	
				(732,460,595)	
	組入時価比率：0.8%			0.9%	
豪ドル	AMPOL LTD	3,200	28.24	90,368.00	
	OIL SEARCH LTD	27,000	3.83	103,410.00	
	SANTOS LTD.	27,900	6.25	174,375.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	1,700	35.99	61,183.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	13,500	19.90	268,650.00	
	ORICA LTD	4,800	13.44	64,512.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	6,000	54.31	325,860.00	
	BHP GROUP LIMITED	41,000	42.35	1,736,350.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	6,500	23.92	155,480.00	
	EVOLUTION MINING LTD	24,000	3.90	93,600.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	23,000	20.85	479,550.00	
	NEWCREST MINING	11,400	24.58	280,212.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	15,000	9.76	146,400.00	
	RIO TINTO LTD	5,060	111.37	563,532.20	
	SOUTH32 LTD	72,000	3.28	236,160.00	
	REECE LTD	4,600	19.83	91,218.00	
	BRAMBLES LTD	21,000	12.17	255,570.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	10,000	5.34	53,400.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	27,000	3.79	102,330.00	
	SYDNEY AIRPORT	18,000	7.93	142,740.00	
	TRANSURBAN GROUP	37,200	14.32	532,704.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	8,000	46.07	368,560.00	

CROWN RESORTS LTD	4,800	9.41	45,168.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	920	156.71	144,173.20
TABCORP HOLDINGS	29,000	4.87	141,230.00
WESFARMERS LIMITED	15,680	57.78	905,990.40
COLES GROUP LTD	18,700	17.74	331,738.00
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	17,500	6.79	118,825.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	17,500	40.72	712,600.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	9,100	12.37	112,567.00
COCHLEAR LTD	910	237.36	215,997.60
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	71.95	197,862.50
SONIC HEALTHCARE LTD	6,400	43.75	280,000.00
CSL LIMITED	6,330	303.87	1,923,497.10
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	40,100	27.87	1,117,587.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	24,710	101.84	2,516,466.40
NATIONAL AUSTRALIA BANK	45,700	28.70	1,311,590.00
WESTPAC BANKING CORP	51,600	26.02	1,342,632.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	34,000	5.40	183,600.00
MEDIBANK PRIVATE LTD	40,000	3.57	142,800.00
QBE INSURANCE	20,000	11.70	234,000.00
SUNCORP GROUP LTD	18,200	12.66	230,412.00
AFTERPAY LTD	3,130	130.71	409,122.30
COMPUTERSHARE LTD	7,350	16.57	121,789.50
WISETECH GLOBAL LTD	2,200	49.23	108,306.00
XERO LIMITED	1,930	151.01	291,449.30
TELSTRA CORP LTD	57,000	3.85	219,450.00
AUSNET SERVICES	25,264	1.95	49,264.80
ORIGIN ENERGY LTD	27,000	4.46	120,420.00
APA GROUP	17,700	9.15	161,955.00
AGL ENERGY LTD	8,900	6.41	57,049.00
ASX LTD	2,880	86.96	250,444.80
MACQUARIE GROUP LIMITED	4,700	169.18	795,146.00
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,800	43.87	78,966.00
REA GROUP LTD	770	155.57	119,788.90
SEEK LTD	4,900	33.18	162,582.00
小計銘柄数：56			21,480,634.00

				(1,753,678,959)	
	組入時価比率：1.9%			2.1%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	16,400	7.25	118,900.00	
	A2 MILK CO LTD	9,700	5.98	58,006.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	7,900	33.45	264,255.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	6,100	15.80	96,380.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	27,000	4.83	130,410.00	
	MERCURY NZ LTD	10,700	6.68	71,476.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	17,100	5.21	89,176.50	
	小計銘柄数：7			828,603.50 (65,070,232)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	26,000	30.85	802,100.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	36,416	57.05	2,077,532.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	19,500	173.90	3,391,050.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	21,000	31.60	663,600.00	
	MTR CORP	21,000	43.85	920,850.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	30,000	50.65	1,519,500.00	
	SANDS CHINA LTD	33,200	25.60	849,920.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	24,000	6.95	166,800.00	
	WYNN MACAU LTD	18,000	9.10	163,800.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	32,000	15.88	508,160.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	25,000	19.68	492,000.00	
	WH GROUP LIMITED	138,000	6.11	843,180.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	52,000	23.40	1,216,800.00	
	HANG SENG BANK	10,200	140.20	1,430,040.00	
	AIA GROUP LTD	169,400	92.70	15,703,380.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	52,120	10.62	553,514.40	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	8,000	45.80	366,400.00	
	CLP HLDGS	22,500	76.85	1,729,125.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	21,000	48.10	1,010,100.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	157,983	12.44	1,965,308.52	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING	16,700	487.60	8,142,920.00	

	LTD				
	CK ASSET HOLDINGS LTD	26,916	49.70	1,337,725.20	
	ESR CAYMAN LTD	30,000	24.00	720,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	18.78	507,060.00	
	HENDERSON LAND	21,845	34.75	759,113.75	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	22,333	36.35	811,804.55	
	SINO LAND CO.LTD	47,000	11.40	535,800.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	18,000	108.30	1,949,400.00	
	SWIRE PACIFIC-A	7,500	53.05	397,875.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	17,000	21.00	357,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	22,200	39.70	881,340.00	
	小計銘柄数：31			52,773,199.22	
				(745,685,304)	
	組入時価比率：0.8%			0.9%	
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	19,000	3.76	71,440.00	
	KEPPEL CORP.	19,000	5.19	98,610.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	20,100	5.04	101,304.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	81,000	0.78	63,180.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	28,000	4.15	116,200.00	
	DBS GROUP HLDGS	25,600	30.12	771,072.00	
	OCBC-ORD	45,550	11.62	529,291.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	16,700	25.56	426,852.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	18.90	77,490.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	116,000	2.38	276,080.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,300	10.17	114,921.00	
	CAPITALAND LIMITED	34,000	4.02	136,680.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,400	6.86	37,044.00	
	UOL GROUP LIMITED	5,700	7.07	40,299.00	
	小計銘柄数：14			2,860,463.00	
				(234,100,291)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
新シェケル	ICL GROUP LTD	9,000	22.70	204,300.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	350	461.10	161,385.00	
	BANK HAPOLIM BM	16,800	27.80	467,040.00	
		19,400	26.65	517,010.00	

		BANK LEUMI LE-ISRAEL				
		ISRAEL DISCOUNT BANK-A	15,700	16.90	265,330.00	
		MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,100	105.80	222,180.00	
		NICE LTD	890	941.60	838,024.00	
		AZRIELI GROUP	600	305.90	183,540.00	
	小計	銘柄数：8			2,858,809.00	
					(97,979,389)	
		組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計					84,982,922,368	
					(84,982,922,368)	

(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9月6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	7,900	127,822.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,990	414,755.80	
		AMERICAN TOWER CORP	6,370	1,923,803.70	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	19,800	171,072.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,930	449,400.50	
		BOSTON PROPERTIES	2,170	247,119.60	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,250	191,800.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	5,990	1,189,015.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,850	645,260.00	
		DUKE REALTY CORP	5,100	273,462.00	
		EQUINIX INC	1,239	1,093,826.37	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,450	215,918.50	
		EQUITY RESIDENTIAL	4,810	411,687.90	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	910	305,377.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,880	364,174.80	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7,520	273,352.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	10,000	161,700.00	
		INVITATION HOMES INC	8,110	340,214.50	
		IRON MOUNTAIN INC	4,090	201,964.20	

小計	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,600	186,190.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,600	313,824.00	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,900	98,078.00	
	PROLOGIS INC	10,280	1,428,817.20	
	PUBLIC STORAGE	2,180	721,056.80	
	REALTY INCOME CORP	5,090	368,007.00	
	REGENCY CENTERS CORP	2,160	149,774.40	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,530	560,714.40	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	4,540	616,305.00	
	SUN COMMUNITIES INC	1,570	328,334.10	
	UDR INC	4,340	240,305.80	
	VENTAS INC	5,220	293,938.20	
	VEREIT INC	3,140	158,978.20	
	VICI PROPERTIES INC	7,200	230,616.00	
	VORNADO REALTY TRUST	2,360	98,789.60	
	WELLTOWER INC	5,760	499,680.00	
	WEYERHAEUSER CO	10,100	370,064.00	
	WP CAREY INC	2,410	191,137.10	
	銘柄数：37	178,339	15,856,336.47	
			(1,741,501,434)	
	組入時価比率：1.9%		85.1%	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,100	68,365.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,986	44,804.16	
小計	銘柄数：2	3,086	113,169.16	
			(9,910,223)	
	組入時価比率：0.0%		0.5%	
ユーロ	COVIVIO	780	60,559.20	
	GECINA SA	560	72,016.00	
小計	KLEPIERRE	3,000	61,380.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,890	132,564.60	
	銘柄数：4	6,230	326,519.80	
			(42,587,977)	
	組入時価比率：0.0%		2.1%	
英ポンド	BRITISH LAND	13,000	70,434.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	9,900	72,804.60	
	SEGRO PLC	16,700	216,432.00	

小計	銘柄数：3	39,600	359,670.60	
	組入時価比率：0.1%		(54,716,688)	2.7%
豪ドル	DEXUS/AU	15,700	167,048.00	
	GOODMAN GROUP	22,600	522,512.00	
	GPT GROUP	26,000	129,740.00	
	LENDLEASE GROUP	9,800	116,620.00	
	MIRVAC GROUP	50,000	155,500.00	
	SCENTRE GROUP	77,000	223,300.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	33,000	153,780.00	
	VICINITY CENTRES	61,000	108,275.00	
小計	銘柄数：8	295,100	1,576,775.00	
	組入時価比率：0.1%		(128,727,911)	6.3%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	30,000	232,800.00	
	LINK REIT	30,000	2,134,500.00	
小計	銘柄数：2	60,000	2,367,300.00	
	組入時価比率：0.0%		(33,449,949)	1.6%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	41,706	129,288.60	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	66,046	138,036.14	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	34,000	70,720.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	46,008	96,156.72	
小計	銘柄数：4	187,760	434,201.46	
	組入時価比率：0.0%		(35,535,047)	1.7%
合計			2,046,429,229	
			(2,046,429,229)	

(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 9月 6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	3,042,638,965	—	3,120,385,936	77,746,971
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	88,431,828,722	—	88,293,058,527	138,770,195
米ドル	64,468,181,463	—	64,242,882,000	225,299,463
カナダドル	3,031,805,450	—	3,042,362,500	△10,557,050
ユーロ	9,229,875,500	—	9,256,960,600	△27,085,100
英ポンド	3,928,280,180	—	3,948,775,600	△20,495,420
スイスフラン	2,717,276,583	—	2,717,043,700	232,883
スウェーデンクローナ	1,015,635,180	—	1,019,728,400	△4,093,220
ノルウェークローネ	169,153,229	—	168,996,800	156,429
デンマーククローネ	736,306,465	—	738,679,500	△2,373,035
豪ドル	1,907,533,082	—	1,931,602,400	△24,069,318
ニュージーランドドル	64,391,068	—	65,163,300	△772,232
香港ドル	789,704,325	—	787,747,500	1,956,825
シンガポールドル	274,396,490	—	274,063,500	332,990
新シェケル	99,289,707	—	99,052,727	236,980
合計	—	—	—	216,517,166

（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。

①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。

②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2021年 9月 6日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,185,809,066
国債証券	638,279,190,050
地方債証券	54,264,457,376
特殊債券	64,433,102,175
社債券	33,787,731,300
未収利息	1,836,056,113
前払費用	68,579,327
流動資産合計	798,854,925,407
資産合計	798,854,925,407
負債の部	
流動負債	
未払金	1,906,947,000
未払解約金	315,621,865
未払利息	4,852
流動負債合計	2,222,573,717
負債合計	2,222,573,717
純資産の部	
元本等	
元本	597,974,500,175
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	198,657,851,515
元本等合計	796,632,351,690
純資産合計	796,632,351,690
負債純資産合計	798,854,925,407

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 9月 6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	1.3322円
(10,000口当たり純資産額)	(13,322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 9月 8日 至 2021年 9月 6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 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2020年 9月 8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	524,917,125,574円
同期中における追加設定元本額	136,091,963,377円
同期中における一部解約元本額	63,034,588,776円
期末元本額	597,974,500,175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	410,947,412円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	42,270,576,754円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	18,203,102,301円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	3,397,033,439円
野村資産設計ファンド2015	354,410,717円
野村資産設計ファンド2020	356,072,002円
野村資産設計ファンド2025	360,307,592円
野村資産設計ファンド2030	287,670,918円
野村資産設計ファンド2035	157,411,535円
野村資産設計ファンド2040	209,063,509円
野村日本債券インデックスファンド	832,074,492円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	161,128,070,256円
のむラップ・ファンド（保守型）	14,160,396,393円
のむラップ・ファンド（普通型）	13,933,987,625円
のむラップ・ファンド（積極型）	1,992,996,476円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）	10,236,759,226円
野村資産設計ファンド2045	22,569,773円
野村円債投資インデックスファンド	832,080,406円
野村インデックスファンド・国内債券	2,156,260,370円
マイ・ロード	34,156,291,113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	1,444,431,221円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）	19,318,945,525円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	2,035,994,418円
野村資産設計ファンド2050	24,643,267円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	28,366,220円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	7,652,056円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	4,148,711円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	2,649,218円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	1,108,634,234円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	390,240,231円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	56,949,378円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	28,540,969円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	112,821,640円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	14,459,036円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	10,080,477円
野村6資産均等バランス	3,464,941,128円
世界6資産分散ファンド	119,058,581円
野村資産設計ファンド2060	8,913,797円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信	23,416,282,317円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	21,290,959,822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）	566,382,186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）	89,531,507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）	1,821,369,605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）	1,056,392,727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）	18,693,338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）	10,151,623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）	678,273円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,695,218,224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）	8,429,022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）	67,576,617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）	70,457,340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）	379,620,385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）	315,915,841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）	940,958,237円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	172,939,009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）	862,454,626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）	312,033,196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）	14,950,130円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	38,242,360,358円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	50,780,257,848円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	19,370,768,778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）	50,980,739,952円
マイバランスDC30	13,685,071,019円
マイバランスDC50	11,262,745,243円
マイバランスDC70	3,806,495,167円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	13,120,439,908円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	1,187,998,412円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	2,906,493,957円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	1,339,539,190円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	187,039,470円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	28,229,041円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	32,370,392円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	61,636,324円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	25,234,668円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	9,465,220円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	881,043,040円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	453,032,397円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	169,464,770円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	211,061,756円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	4,541,407円
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	40,012,732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）	437,912,685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9月6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9月6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４１７回	500,000,000	501,225,000	
		国庫債券 利付（２年）第４１８回	4,400,000,000	4,411,660,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２０回	500,000,000	501,515,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２１回	3,500,000,000	3,511,305,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２２回	1,400,000,000	1,404,760,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２３回	5,200,000,000	5,210,972,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２４回	2,300,000,000	2,305,106,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２６回	1,500,000,000	1,503,540,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２７回	5,300,000,000	5,313,091,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３４回	2,500,000,000	2,507,075,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３５回	8,500,000,000	8,529,325,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３６回	4,300,000,000	4,316,899,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３７回	5,500,000,000	5,525,245,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３８回	5,500,000,000	5,528,325,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３９回	5,200,000,000	5,229,692,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４０回	5,100,000,000	5,132,028,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４１回	5,500,000,000	5,536,850,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４３回	6,070,000,000	6,116,253,400	
		国庫債券 利付（５年）第１４４回	4,400,000,000	4,435,948,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４５回	5,900,000,000	5,951,389,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４６回	2,100,000,000	2,118,984,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４７回	3,600,000,000	3,618,000,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４８回	3,300,000,000	3,316,632,000	
		国庫債券 利付（４０年）第１回	2,360,000,000	3,430,425,200	
		国庫債券 利付（４０年）第２回	900,000,000	1,267,191,000	
		国庫債券 利付（４０年）第３回	900,000,000	1,272,492,000	
		国庫債券 利付（４０年）第４回	1,130,000,000	1,599,605,400	
		国庫債券 利付（４０年）第５回	1,200,000,000	1,639,860,000	
		国庫債券 利付（４０年）第６回	1,300,000,000	1,750,424,000	
		国庫債券 利付（４０年）第７回	1,400,000,000	1,814,218,000	
		国庫債券 利付（４０年）第８回	1,500,000,000	1,819,740,000	
		国庫債券 利付（４０年）第９回	2,050,000,000	1,865,992,000	
		国庫債券 利付（４０年）第１０回	2,010,000,000	2,136,529,500	
		国庫債券 利付（４０年）第１１回	1,750,000,000	1,803,532,500	
		国庫債券 利付（４０年）第１２回	2,070,000,000	1,926,900,900	
		国庫債券 利付（４０年）第１３回	7,020,000,000	6,505,083,000	

国庫債券 利付（４０年）第１４回	2,320,000,000	2,295,106,400	
国庫債券 利付（１０年）第３２６回	2,100,000,000	2,122,008,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２７回	3,100,000,000	3,136,487,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２８回	5,250,000,000	5,307,960,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２９回	6,000,000,000	6,098,100,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３０回	3,800,000,000	3,871,326,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３１回	1,900,000,000	1,927,911,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３２回	5,900,000,000	5,997,291,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３３回	3,600,000,000	3,665,808,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３４回	6,600,000,000	6,733,650,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３５回	4,600,000,000	4,686,848,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３６回	2,750,000,000	2,806,210,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３７回	3,000,000,000	3,041,550,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３８回	5,000,000,000	5,091,300,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３９回	5,000,000,000	5,097,850,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４０回	4,200,000,000	4,287,696,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４１回	7,300,000,000	7,428,845,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４２回	8,550,000,000	8,629,771,500	
国庫債券 利付（１０年）第３４３回	9,500,000,000	9,593,575,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４４回	7,400,000,000	7,474,888,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４５回	5,000,000,000	5,053,100,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４６回	5,100,000,000	5,156,712,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４７回	5,400,000,000	5,461,236,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４８回	5,800,000,000	5,866,874,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４９回	2,800,000,000	2,833,600,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５０回	7,150,000,000	7,236,872,500	
国庫債券 利付（１０年）第３５１回	8,500,000,000	8,607,270,000	

国庫債券 利付（１０年）第３５２回	6,700,000,000	6,785,291,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５３回	4,900,000,000	4,962,769,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５４回	4,350,000,000	4,405,984,500	
国庫債券 利付（１０年）第３５５回	5,100,000,000	5,163,801,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５６回	4,800,000,000	4,858,080,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５７回	1,900,000,000	1,922,097,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５８回	5,470,000,000	5,530,771,700	
国庫債券 利付（１０年）第３５９回	5,600,000,000	5,659,080,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６０回	7,900,000,000	7,974,971,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６１回	8,400,000,000	8,470,056,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６２回	9,800,000,000	9,869,874,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６３回	4,400,000,000	4,425,696,000	
国庫債券 利付（３０年）第１回	500,000,000	614,225,000	
国庫債券 利付（３０年）第２回	500,000,000	603,240,000	
国庫債券 利付（３０年）第３回	160,000,000	192,428,800	
国庫債券 利付（３０年）第４回	900,000,000	1,140,183,000	
国庫債券 利付（３０年）第５回	150,000,000	181,476,000	
国庫債券 利付（３０年）第６回	600,000,000	742,746,000	
国庫債券 利付（３０年）第７回	600,000,000	742,080,000	
国庫債券 利付（３０年）第８回	100,000,000	118,974,000	
国庫債券 利付（３０年）第９回	265,000,000	303,610,500	
国庫債券 利付（３０年）第１０回	250,000,000	278,500,000	
国庫債券 利付（３０年）第１１回	160,000,000	189,593,600	
国庫債券 利付（３０年）第１２回	220,000,000	271,680,200	
国庫債券 利付（３０年）第１３回	290,000,000	355,571,900	
国庫債券 利付（３０年）第１４回	800,000,000	1,023,288,000	
国庫債券 利付（３０年）第１５回	900,000,000	1,166,013,000	
国庫債券 利付（３０年）第１６回	915,000,000	1,189,161,450	
国庫債券 利付（３０年）第１７回	1,200,000,000	1,549,656,000	
国庫債券 利付（３０年）第１８回	2,200,000,000	2,819,828,000	
国庫債券 利付（３０年）第１９回	2,050,000,000	2,636,300,000	
国庫債券 利付（３０年）第２０回	1,270,000,000	1,673,352,000	
国庫債券 利付（３０年）第２１回	300,000,000	388,032,000	
国庫債券 利付（３０年）第２２回	600,000,000	794,868,000	
国庫債券 利付（３０年）第２３回	840,000,000	1,116,612,000	

国庫債券	利付（３０年）第２４回	700,000,000	932,960,000
国庫債券	利付（３０年）第２５回	500,000,000	653,305,000
国庫債券	利付（３０年）第２６回	850,000,000	1,126,590,000
国庫債券	利付（３０年）第２７回	1,550,000,000	2,089,291,500
国庫債券	利付（３０年）第２８回	1,200,000,000	1,624,764,000
国庫債券	利付（３０年）第２９回	1,500,000,000	2,015,430,000
国庫債券	利付（３０年）第３０回	1,700,000,000	2,266,287,000
国庫債券	利付（３０年）第３１回	1,200,000,000	1,584,672,000
国庫債券	利付（３０年）第３２回	1,200,000,000	1,611,420,000
国庫債券	利付（３０年）第３３回	2,400,000,000	3,103,944,000
国庫債券	利付（３０年）第３４回	2,800,000,000	3,736,740,000
国庫債券	利付（３０年）第３５回	2,300,000,000	2,993,703,000
国庫債券	利付（３０年）第３６回	2,000,000,000	2,612,100,000
国庫債券	利付（３０年）第３７回	2,300,000,000	2,969,392,000
国庫債券	利付（３０年）第３８回	1,600,000,000	2,040,016,000
国庫債券	利付（３０年）第３９回	1,400,000,000	1,817,144,000
国庫債券	利付（３０年）第４０回	1,300,000,000	1,661,829,000
国庫債券	利付（３０年）第４１回	1,500,000,000	1,889,325,000
国庫債券	利付（３０年）第４２回	1,600,000,000	2,017,392,000
国庫債券	利付（３０年）第４３回	1,300,000,000	1,640,886,000
国庫債券	利付（３０年）第４４回	1,400,000,000	1,768,942,000
国庫債券	利付（３０年）第４５回	1,700,000,000	2,076,210,000
国庫債券	利付（３０年）第４６回	1,800,000,000	2,199,816,000
国庫債券	利付（３０年）第４７回	1,700,000,000	2,117,741,000
国庫債券	利付（３０年）第４８回	1,900,000,000	2,284,066,000
国庫債券	利付（３０年）第４９回	2,900,000,000	3,487,859,000
国庫債券	利付（３０年）第５０回	1,900,000,000	2,024,545,000
国庫債券	利付（３０年）第５１回	2,650,000,000	2,513,710,500
国庫債券	利付（３０年）第５２回	1,900,000,000	1,887,384,000
国庫債券	利付（３０年）第５３回	1,700,000,000	1,726,520,000
国庫債券	利付（３０年）第５４回	1,700,000,000	1,805,247,000
国庫債券	利付（３０年）第５５回	1,500,000,000	1,591,860,000
国庫債券	利付（３０年）第５６回	1,900,000,000	2,015,045,000
国庫債券	利付（３０年）第５７回	1,600,000,000	1,695,744,000
国庫債券	利付（３０年）第５８回	2,100,000,000	2,224,110,000
国庫債券	利付（３０年）第５９回	1,600,000,000	1,652,160,000
国庫債券	利付（３０年）第６０回	1,150,000,000	1,243,265,000
国庫債券	利付（３０年）第６１回	1,000,000,000	1,029,480,000
国庫債券	利付（３０年）第６２回	700,000,000	683,459,000
国庫債券	利付（３０年）第６３回	1,400,000,000	1,328,572,000
国庫債券	利付（３０年）第６４回	1,500,000,000	1,419,480,000
国庫債券	利付（３０年）第６５回	1,200,000,000	1,133,736,000
国庫債券	利付（３０年）第６６回	2,600,000,000	2,452,398,000

国庫債券 利付（３０年）第６７回	1,300,000,000	1,290,497,000	
国庫債券 利付（３０年）第６８回	1,950,000,000	1,933,249,500	
国庫債券 利付（３０年）第６９回	2,200,000,000	2,235,310,000	
国庫債券 利付（３０年）第７０回	1,610,000,000	1,631,960,400	
国庫債券 利付（３０年）第７１回	1,730,000,000	1,749,393,300	
国庫債券 利付（２０年）第５９回	230,000,000	235,370,500	
国庫債券 利付（２０年）第６０回	780,000,000	795,202,200	
国庫債券 利付（２０年）第６１回	300,000,000	305,154,000	
国庫債券 利付（２０年）第６２回	440,000,000	447,194,000	
国庫債券 利付（２０年）第６３回	300,000,000	310,266,000	
国庫債券 利付（２０年）第６４回	400,000,000	416,488,000	
国庫債券 利付（２０年）第６５回	455,000,000	476,002,800	
国庫債券 利付（２０年）第６６回	300,000,000	313,161,000	
国庫債券 利付（２０年）第６７回	310,000,000	325,856,500	
国庫債券 利付（２０年）第６８回	290,000,000	307,043,300	
国庫債券 利付（２０年）第６９回	560,000,000	591,488,800	
国庫債券 利付（２０年）第７０回	540,000,000	578,005,200	
国庫債券 利付（２０年）第７１回	200,000,000	212,958,000	
国庫債券 利付（２０年）第７２回	1,470,000,000	1,569,180,900	
国庫債券 利付（２０年）第７３回	1,200,000,000	1,283,676,000	
国庫債券 利付（２０年）第７４回	800,000,000	858,424,000	
国庫債券 利付（２０年）第７５回	600,000,000	647,010,000	
国庫債券 利付（２０年）第７６回	910,000,000	974,846,600	
国庫債券 利付（２０年）第７７回	700,000,000	752,360,000	
国庫債券 利付（２０年）第７８回	800,000,000	861,088,000	
国庫債券 利付（２０年）第７９回	860,000,000	928,937,600	
国庫債券 利付（２０年）第８０回	1,400,000,000	1,517,544,000	
国庫債券 利付（２０年）第８１回	360,000,000	390,790,800	
国庫債券 利付（２０年）第８２回	820,000,000	893,455,600	
国庫債券 利付（２０年）第８３回	1,370,000,000	1,500,013,000	
国庫債券 利付（２０年）第８４回	1,200,000,000	1,308,720,000	
国庫債券 利付（２０年）第８５回	400,000,000	440,156,000	
国庫債券 利付（２０年）第８６回	1,700,000,000	1,886,150,000	
国庫債券 利付（２０年）第８７回	500,000,000	552,475,000	
国庫債券 利付（２０年）第８８回	1,100,000,000	1,226,885,000	
国庫債券 利付（２０年）第８９回	470,000,000	521,958,500	
国庫債券 利付（２０年）第９０回	1,500,000,000	1,674,180,000	
国庫債券 利付（２０年）第９１回	250,000,000	280,295,000	
国庫債券 利付（２０年）第９２回	650,000,000	725,777,000	
国庫債券 利付（２０年）第９３回	300,000,000	334,947,000	
国庫債券 利付（２０年）第９４回	200,000,000	224,410,000	
国庫債券 利付（２０年）第９５回	100,000,000	113,895,000	

国庫債券	利付（２０年）第９６回	400,000,000	450,928,000
国庫債券	利付（２０年）第９７回	300,000,000	341,586,000
国庫債券	利付（２０年）第９８回	300,000,000	339,765,000
国庫債券	利付（２０年）第９９回	1,100,000,000	1,251,866,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１００回	820,000,000	942,754,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０１回	250,000,000	290,707,500
国庫債券 回	利付（２０年）第１０２回	1,500,000,000	1,753,725,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０３回	600,000,000	697,392,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０４回	400,000,000	459,472,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０５回	1,900,000,000	2,192,277,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０６回	400,000,000	464,360,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０７回	300,000,000	347,667,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０８回	1,600,000,000	1,830,784,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０９回	900,000,000	1,033,848,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１０回	1,100,000,000	1,280,235,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１１回	800,000,000	941,016,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１２回	1,800,000,000	2,103,210,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１３回	2,000,000,000	2,345,960,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１４回	1,700,000,000	2,002,396,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１５回	1,000,000,000	1,186,190,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１６回	1,100,000,000	1,309,814,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１７回	1,400,000,000	1,655,052,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１８回	500,000,000	588,870,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１９回	800,000,000	928,112,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１２０回	800,000,000	914,032,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１２１回	1,200,000,000	1,406,640,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１２２回	900,000,000	1,046,844,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１２３回	500,000,000	596,935,000

国庫債券 利付（２０年）第１２４回	1,000,000,000	1,184,590,000
国庫債券 利付（２０年）第１２５回	1,400,000,000	1,689,534,000
国庫債券 利付（２０年）第１２６回	1,200,000,000	1,425,348,000
国庫債券 利付（２０年）第１２７回	500,000,000	589,145,000
国庫債券 利付（２０年）第１２８回	1,800,000,000	2,126,268,000
国庫債券 利付（２０年）第１２９回	1,300,000,000	1,522,963,000
国庫債券 利付（２０年）第１３０回	1,700,000,000	1,997,058,000
国庫債券 利付（２０年）第１３１回	800,000,000	931,808,000
国庫債券 利付（２０年）第１３２回	1,300,000,000	1,517,919,000
国庫債券 利付（２０年）第１３３回	1,400,000,000	1,649,004,000
国庫債券 利付（２０年）第１３４回	1,400,000,000	1,654,058,000
国庫債券 利付（２０年）第１３５回	700,000,000	819,707,000
国庫債券 利付（２０年）第１３６回	700,000,000	812,385,000
国庫債券 利付（２０年）第１３７回	1,000,000,000	1,173,820,000
国庫債券 利付（２０年）第１３８回	800,000,000	921,944,000
国庫債券 利付（２０年）第１３９回	1,000,000,000	1,163,120,000
国庫債券 利付（２０年）第１４０回	2,300,000,000	2,706,088,000
国庫債券 利付（２０年）第１４１回	2,600,000,000	3,065,920,000
国庫債券 利付（２０年）第１４２回	950,000,000	1,130,842,000
国庫債券 利付（２０年）第１４３回	1,300,000,000	1,522,300,000
国庫債券 利付（２０年）第１４４回	1,300,000,000	1,507,480,000
国庫債券 利付（２０年）第１４５回	2,300,000,000	2,725,408,000
国庫債券 利付（２０年）第１４６回	2,400,000,000	2,849,880,000
国庫債券 利付（２０年）第１４７回	4,000,000,000	4,710,960,000
国庫債券 利付（２０年）第１４８回	2,100,000,000	2,451,729,000
国庫債券 利付（２０年）第１４９回	3,850,000,000	4,501,920,500
	3,330,000,000	3,857,238,900

国庫債券 利付（２０年）第１５０回			
国庫債券 利付（２０年）第１５１回	2,500,000,000	2,834,525,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５２回	2,650,000,000	3,007,034,500	
国庫債券 利付（２０年）第１５３回	1,600,000,000	1,839,776,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５４回	1,620,000,000	1,842,426,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５５回	5,350,000,000	5,940,265,500	
国庫債券 利付（２０年）第１５６回	6,150,000,000	6,301,413,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５７回	6,540,000,000	6,507,234,600	
国庫債券 利付（２０年）第１５８回	2,770,000,000	2,874,512,100	
国庫債券 利付（２０年）第１５９回	2,900,000,000	3,049,408,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６０回	2,300,000,000	2,452,904,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６１回	2,100,000,000	2,206,575,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６２回	1,700,000,000	1,784,847,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６３回	2,600,000,000	2,727,452,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６４回	2,600,000,000	2,681,900,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６５回	2,200,000,000	2,266,682,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６６回	2,300,000,000	2,443,152,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６７回	2,600,000,000	2,672,254,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６８回	2,700,000,000	2,726,784,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６９回	2,530,000,000	2,506,698,700	
国庫債券 利付（２０年）第１７０回	2,000,000,000	1,978,000,000	
国庫債券 利付（２０年）第１７１回	1,500,000,000	1,480,740,000	
国庫債券 利付（２０年）第１７２回	3,840,000,000	3,853,286,400	
国庫債券 利付（２０年）第１７３回	3,250,000,000	3,255,687,500	
国庫債券 利付（２０年）第１７４回	3,670,000,000	3,670,000,000	
国庫債券 利付（２０年）第１７５回	5,500,000,000	5,593,445,000	
	6,020,000,000	6,117,945,400	

	小計	国庫債券 利付（２０年）第１７６回			
		国庫債券 利付（２０年）第１７７回	1,300,000,000	1,295,242,000	
		メキシコ合衆国 第２５回円貨社債（２０１８）	100,000,000	100,261,000	
		銘柄数：266	598,015,000,000	638,279,190,050	
		組入時価比率：80.1%		80.7%	
	合計			638,279,190,050	
地方債証券	日本円	東京都 公募第７１５回	100,000,000	100,965,000	
		東京都 公募第７１６回	200,000,000	201,956,000	
		東京都 公募第７３１回	100,000,000	101,582,000	
		東京都 公募第７３６回	100,000,000	101,504,000	
		東京都 公募第７４５回	300,000,000	305,937,000	
		東京都 公募第７６０回	100,000,000	100,100,000	
		東京都 公募第７６１回	100,000,000	100,251,000	
		東京都 公募第７６９回	500,000,000	504,905,000	
		東京都 公募第７７８回	100,000,000	100,748,000	
		東京都 公募（３０年）第７回	100,000,000	134,629,000	
		東京都 公募第１０回	200,000,000	265,202,000	
		東京都 公募第１回	300,000,000	308,196,000	
		東京都 公募（２０年）第３回	200,000,000	211,390,000	
		東京都 公募第７回	100,000,000	108,675,000	
		東京都 公募（２０年）第１３回	100,000,000	113,166,000	
		東京都 公募（２０年）第１６回	200,000,000	228,306,000	
		東京都 公募（２０年）第１７回	200,000,000	229,468,000	
		東京都 公募第２３回	100,000,000	118,537,000	
		東京都 公募（２０年）第２６回	100,000,000	116,868,000	
		東京都 公募（２０年）第２９回	200,000,000	232,216,000	
		東京都 公募（５年）第３１回	300,000,000	299,958,000	
		北海道 公募平成２４年度第９回	100,000,000	100,892,000	
		北海道 公募平成２５年度第１回	300,000,000	302,766,000	
		北海道 公募平成２６年度第１３回	100,000,000	101,473,000	
		北海道 公募平成２７年度第７回	100,000,000	102,042,000	
		北海道 公募平成２９年度第５回	200,000,000	201,506,000	
		北海道 公募平成２９年度第７回	100,000,000	100,954,000	
		北海道 公募平成２９年度第９回	100,000,000	100,887,000	
		北海道 公募平成３０年度第１５回	269,280,000	270,200,937	
		北海道 公募令和２年度第４回	300,000,000	301,809,000	
		宮城県 公募第３１回１号	300,000,000	306,153,000	
		宮城県 公募第３２回２号	100,000,000	100,404,000	
		神奈川県 公募第１９６回	100,000,000	101,023,000	
		神奈川県 公募第２００回	100,000,000	101,660,000	
		神奈川県 公募第２０５回	100,000,000	101,655,000	

神奈川県 公募第206回	100,000,000	101,793,000	
神奈川県 公募第210回	200,000,000	202,898,000	
神奈川県 公募第212回	100,000,000	101,447,000	
神奈川県 公募第231回	200,000,000	202,130,000	
神奈川県 公募第247回	200,000,000	200,680,000	
神奈川県 公募（30年）第3回	100,000,000	134,250,000	
神奈川県 公募第7回	300,000,000	336,192,000	
神奈川県 公募（20年）第14回	100,000,000	116,632,000	
神奈川県 公募（20年）第17回	200,000,000	236,216,000	
神奈川県 公募（20年）第26回	100,000,000	115,482,000	
大阪府 公募第378回	104,000,000	105,586,000	
大阪府 公募第381回	100,000,000	101,654,000	
大阪府 公募第382回	100,000,000	101,684,000	
大阪府 公募第383回	100,000,000	101,791,000	
大阪府 公募第384回	100,000,000	101,784,000	
大阪府 公募第387回	300,000,000	304,515,000	
大阪府 公募第389回	100,000,000	101,620,000	
大阪府 公募第396回	200,000,000	204,010,000	
大阪府 公募第417回	102,000,000	103,186,260	
大阪府 公募第423回	100,000,000	100,805,000	
大阪府 公募第429回	179,000,000	180,580,570	
大阪府 公募第452回	100,000,000	99,849,000	
大阪府 公募第5回	100,000,000	117,967,000	
大阪府 公募第8回	100,000,000	117,033,000	
大阪府 公募（5年）第173回	200,000,000	199,890,000	
大阪府 公募（5年）第174回	200,000,000	199,888,000	
大阪府 公募（5年）第178回	400,000,000	399,756,000	
京都府 公募平成24年度第6回	100,000,000	100,887,000	
京都府 公募平成25年度第15回	200,000,000	203,290,000	
京都府 公募平成26年度第5回	100,000,000	115,298,000	
京都府 公募平成26年度第7回	200,000,000	203,362,000	
京都府 公募（20年）平成27年度第5回	200,000,000	225,804,000	
京都府 公募（15年）平成27年度第8回	100,000,000	106,245,000	
京都府 公募（15年）平成28年度第2回	200,000,000	201,904,000	
京都府 公募（20年）平成28年度第5回	100,000,000	100,168,000	
京都府 公募平成29年度第4回	100,000,000	100,866,000	
兵庫県 公募平成26年度第17回	100,000,000	101,563,000	
兵庫県 公募平成29年度第22回	100,000,000	100,889,000	
兵庫県 公募（30年）第2回	200,000,000	267,906,000	
兵庫県 公募（15年）第1回	300,000,000	324,210,000	

兵庫県 公募（１５年）第３回	200,000,000	215,314,000	
兵庫県 公募（１２年）第３回	300,000,000	305,949,000	
兵庫県 公募（１５年）第１１回	100,000,000	105,538,000	
兵庫県 公募第２回	100,000,000	113,951,000	
兵庫県 公募第９回	100,000,000	117,786,000	
兵庫県 公募（２０年）第１１回	200,000,000	231,168,000	
兵庫県 公募（２０年）第１４回	100,000,000	116,368,000	
兵庫県 公募（２０年）第２２回	100,000,000	114,695,000	
静岡県 公募平成２４年度第１０回	100,000,000	101,027,000	
静岡県 公募平成２５年度第５回	101,000,000	102,741,240	
静岡県 公募平成２６年度第３回	165,000,000	168,001,350	
静岡県 公募平成２６年度第８回	100,000,000	101,690,000	
静岡県 公募平成２６年度第９回	200,000,000	203,406,000	
静岡県 公募平成２７年度第１１回	115,400,000	115,922,762	
静岡県 公募平成２８年度第２回	300,000,000	300,951,000	
静岡県 公募平成２９年度第３回	100,000,000	100,745,000	
静岡県 公募（３１年）第１回	174,000,000	174,455,880	
静岡県 公募（５年）令和３年度第２回	100,000,000	99,999,000	
静岡県 公募（１５年）第２回	200,000,000	215,812,000	
静岡県 公募（１５年）第５回	200,000,000	214,740,000	
静岡県 公募（１５年）第９回	100,000,000	105,877,000	
静岡県 公募（２０年）第１１回	100,000,000	115,858,000	
静岡県 公募（２０年）第１４回	200,000,000	233,652,000	
静岡県 公募（２０年）第１８回	100,000,000	115,497,000	
静岡県 公募（２０年）第３０回	200,000,000	200,126,000	
愛知県 公募平成２０年度第８回	100,000,000	114,371,000	
愛知県 公募（２０年）平成２２年度第８回	200,000,000	232,462,000	
愛知県 公募（２０年）平成２４年度第４回	100,000,000	116,277,000	
愛知県 公募（１５年）平成２４年度第１４回	400,000,000	431,604,000	
愛知県 公募平成２４年度第１７回	100,000,000	118,526,000	
愛知県 公募（３０年）平成２５年度第８回	120,000,000	156,843,600	
愛知県 公募平成２６年度第８回	100,000,000	126,869,000	
愛知県 公募平成２６年度第１３回	100,000,000	114,276,000	
愛知県 公募平成２６年度第１７回	300,000,000	304,719,000	
愛知県 公募（１５年）平成２７年度第２回	300,000,000	317,112,000	
愛知県 公募平成２７年度第１５回	100,000,000	101,947,000	
愛知県 公募平成２９年度第８回	100,000,000	100,955,000	
愛知県 公募平成２９年度第９回	100,000,000	100,600,000	
愛知県 公募平成３０年度第７回	200,000,000	201,786,000	

広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	100,981,000	
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	203,240,000	
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	110,839,702	
広島県	公募平成26年度第7回	200,000,000	203,192,000	
広島県	公募平成29年度第3回	100,000,000	100,604,000	
広島県	公募平成29年度第4回	211,300,000	213,524,989	
広島県	公募平成30年度第6回	300,000,000	300,072,000	
広島県	公募令和2年度第2回	100,000,000	100,701,000	
広島県	公募令和2年度第7回	300,000,000	303,084,000	
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	101,712,000	
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	150,422,760	
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	101,632,000	
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	101,644,000	
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	101,782,000	
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	203,322,000	
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	406,152,000	
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	101,454,000	
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	100,195,000	
埼玉県	公募平成30年度第4回	200,000,000	202,102,000	
埼玉県	公募平成30年度第7回	200,000,000	200,042,000	
埼玉県	公募令和2年度第4回	300,000,000	301,674,000	
埼玉県	公募（15年）第1回	100,000,000	107,033,000	
埼玉県	公募（15年）第2回	200,000,000	213,728,000	
埼玉県	公募（15年）第3回	100,000,000	102,918,000	
埼玉県	公募（25年）第2回	200,000,000	210,646,000	
埼玉県	公募（30年）第9回	200,000,000	210,040,000	
埼玉県	公募（20年）第6回	100,000,000	115,430,000	
埼玉県	公募（20年）第16回	100,000,000	112,706,000	
埼玉県	公募（20年）第20回	100,000,000	104,258,000	
福岡県	公募平成26年度第1回	100,000,000	101,805,000	
福岡県	公募平成27年度第1回	300,000,000	306,477,000	
福岡県	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,925,000	
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	107,650,000	
福岡県	公募（15年）平成27年度第1回	200,000,000	212,574,000	
福岡県	公募（15年）令和元年度第1回	100,000,000	100,164,000	
福岡県	公募（30年）平成19年度第1回	100,000,000	135,201,000	
福岡県	公募（30年）平成26年度第1回	100,000,000	127,136,000	
福岡県	公募（30年・定時償還）平成29年度第2回	100,000,000	107,400,000	
		300,000,000	345,918,000	

福岡県 公募（２０年）平成２０年度第１回			
福岡県 公募（２０年）平成２０年度第２回	100,000,000	114,444,000	
福岡県 公募（２０年）平成２２年度第１回	300,000,000	344,928,000	
福岡県 公募（２０年）平成２２年度第２回	300,000,000	356,190,000	
福岡県 公募（２０年）平成２４年度第２回	100,000,000	115,864,000	
千葉県 公募平成２４年度第７回	100,000,000	100,943,000	
千葉県 公募平成２４年度第８回	100,000,000	101,150,000	
千葉県 公募平成２５年度第３回	100,000,000	101,579,000	
千葉県 公募平成２５年度第４回	100,000,000	101,712,000	
千葉県 公募平成２６年度第１回	100,000,000	101,761,000	
千葉県 公募平成２６年度第３回	200,000,000	203,462,000	
千葉県 公募平成２７年度第６回	200,000,000	203,946,000	
千葉県 公募平成２８年度第４回	200,000,000	200,604,000	
千葉県 公募平成２９年度第４回	100,000,000	100,603,000	
千葉県 公募平成２９年度第８回	100,000,000	100,978,000	
千葉県 公募（２０年）第１回	400,000,000	435,128,000	
千葉県 公募（２０年）第８回	100,000,000	118,075,000	
千葉県 公募（２０年）第１３回	200,000,000	233,514,000	
千葉県 公募（２０年）第１６回	200,000,000	232,704,000	
千葉県 公募（２０年）第１７回	100,000,000	114,765,000	
長野県 公募令和３年度第１回	300,000,000	302,280,000	
群馬県 公募第１２回	100,000,000	102,005,000	
群馬県 公募（２０年）第３回	100,000,000	116,273,000	
岐阜県 公募平成２６年度第１回	186,670,000	189,781,788	
共同発行市場地方債 公募第１１５回	100,000,000	100,896,000	
共同発行市場地方債 公募第１１６回	200,000,000	201,926,000	
共同発行市場地方債 公募第１１８回	100,000,000	101,150,000	
共同発行市場地方債 公募第１１９回	200,000,000	202,318,000	
共同発行市場地方債 公募第１２０回	300,000,000	303,099,000	
共同発行市場地方債 公募第１２１回	100,000,000	100,913,000	
共同発行市場地方債 公募第１２２回	400,000,000	404,180,000	
共同発行市場地方債 公募第１２４回	300,000,000	305,082,000	
共同発行市場地方債 公募第１２６回	100,000,000	101,642,000	
共同発行市場地方債 公募第１２８回	700,000,000	710,080,000	

共同発行市場地方債 公募第129回	100,000,000	101,611,000	
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	101,789,000	
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	101,655,000	
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	203,462,000	
共同発行市場地方債 公募第137回	500,000,000	508,230,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	157,593,150	
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	548,208,000	
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,014,380,000	
共同発行市場地方債 公募第152回	400,000,000	408,196,000	
共同発行市場地方債 公募第154回	300,000,000	305,187,000	
共同発行市場地方債 公募第156回	200,000,000	200,818,000	
共同発行市場地方債 公募第157回	300,000,000	300,969,000	
共同発行市場地方債 公募第161回	300,000,000	300,744,000	
共同発行市場地方債 公募第172回	600,000,000	606,504,000	
共同発行市場地方債 公募第184回	100,000,000	100,857,000	
共同発行市場地方債 公募第186回	400,000,000	405,336,000	
共同発行市場地方債 公募第188回	300,000,000	304,398,000	
共同発行市場地方債 公募第190回	610,000,000	614,483,500	
共同発行市場地方債 公募第191回	100,000,000	100,594,000	
共同発行市場地方債 公募第200回	100,000,000	99,999,000	
共同発行市場地方債 公募第213回	300,000,000	300,552,000	
共同発行市場地方債 公募第215回	400,000,000	401,120,000	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	116,988,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	123,548,000	
島根県 公募（30年）平成29年度第1回	100,000,000	107,116,000	
佐賀県 公募平成28年度第1回	100,000,000	100,287,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	203,130,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	101,427,000	

滋賀県	公募平成26年度第1回	142,000,000	144,222,300
栃木県	公募平成24年度第1回	100,000,000	100,961,000
栃木県	公募平成25年度第1回	100,000,000	101,427,000
熊本市	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,869,000
新潟市	公募平成25年度第1回	233,200,000	237,015,152
新潟市	公募平成29年度第1回	100,000,000	101,004,000
浜松市	公募平成26年度第1回	100,000,000	101,098,000
大阪市	公募平成25年度第6回	100,000,000	101,512,000
大阪市	公募平成26年度第5回	100,000,000	101,782,000
大阪市	公募平成27年度第6回	100,000,000	101,944,000
大阪市	公募令和3年度第2回	300,000,000	301,293,000
大阪市	公募（15年）第1回	100,000,000	108,469,000
大阪市	公募（20年）第1回	300,000,000	341,676,000
大阪市	公募（20年）第5回	100,000,000	116,902,000
大阪市	公募（20年）第6回	100,000,000	115,605,000
大阪市	公募（20年）第17回	100,000,000	117,185,000
大阪市	公募（20年）第26回	100,000,000	104,430,000
名古屋市	公募第481回	100,000,000	100,945,000
名古屋市	公募第488回	300,000,000	305,358,000
名古屋市	公募第489回	100,000,000	101,482,000
名古屋市	公募第501回	200,000,000	201,510,000
名古屋市	公募第503回	100,000,000	101,011,000
名古屋市	公募第504回	200,000,000	202,096,000
名古屋市	公募第511回	200,000,000	199,998,000
名古屋市	公募第512回	300,000,000	301,803,000
名古屋市	公募（12年）第1回	200,000,000	207,746,000
名古屋市	公募（15年）第2回	100,000,000	106,805,000
京都市	公募平成29年度第1回	100,000,000	101,012,000
京都市	公募平成29年度第4回	101,280,000	102,476,116
京都市	公募（20年）第2回	100,000,000	108,512,000
京都市	公募（20年）第5回	200,000,000	224,638,000
京都市	公募（20年）第6回	100,000,000	114,011,000
京都市	公募（20年）第13回	100,000,000	114,254,000
京都市	公募（20年）第15回	200,000,000	204,696,000
神戸市	公募平成26年度第17回	300,000,000	302,745,000
神戸市	公募平成28年度第1回	200,000,000	200,644,000
神戸市	公募平成30年度第2回	200,000,000	210,040,000
横浜市	公募公債平成24年度2回	200,000,000	201,790,000
横浜市	公募公債平成25年度1回	200,000,000	202,220,000
横浜市	公募公債平成25年度5回	200,000,000	202,834,000
横浜市	公募公債平成26年度5回	200,000,000	203,012,000
横浜市	公募平成28年度第5回	300,000,000	303,348,000
横浜市	公募平成29年度第3回	100,000,000	101,065,000

横浜市 公募（３０年）第２回	200,000,000	258,850,000	
横浜市 公募（２０年）第１８回	100,000,000	116,517,000	
横浜市 公募（２０年）第２６回	100,000,000	117,887,000	
横浜市 公募（２０年）第３０回	100,000,000	114,443,000	
札幌市 公募（１５年）平成２３年度第９回	200,000,000	215,940,000	
札幌市 公募（２０年）平成２４年度第１回	100,000,000	117,216,000	
札幌市 公募（２０年）平成２４年度第１１回	100,000,000	118,218,000	
札幌市 公募平成２６年度第４回	100,000,000	101,476,000	
札幌市 公募平成２６年度第９回	200,000,000	202,760,000	
川崎市 公募第８５回	100,000,000	100,914,000	
川崎市 公募（２０年）第１７回	100,000,000	115,332,000	
川崎市 公募（２０年）第１９回	100,000,000	114,178,000	
川崎市 公募（３０年）第１１回	100,000,000	104,382,000	
北九州市 公募（１０年）令和２年度第２回	200,000,000	200,090,000	
北九州市 公募（２０年）第３回	200,000,000	227,334,000	
北九州市 公募（２０年）第１４回	100,000,000	117,082,000	
福岡市 公募（２０年）平成２１年度第３回	200,000,000	233,082,000	
福岡市 公募（２０年）平成２３年度第４回	100,000,000	117,350,000	
福岡市 公募平成２６年度第２回	100,000,000	115,644,000	
福岡市 公募平成２６年度第５回	100,000,000	101,661,000	
福岡市 公募平成２６年度第８回	160,000,000	162,582,400	
広島市 公募平成２６年度第２回	100,000,000	101,472,000	
広島市 公募平成２７年度第２回	500,000,000	509,760,000	
広島市 公募（１０年）平成３０年度第６回	241,000,000	242,539,990	
千葉市 公募平成２６年度第２回	200,000,000	203,190,000	
三重県 公募平成２４年度第１回	140,660,000	141,921,720	
三重県 公募平成２８年度第１回	155,000,000	156,148,550	
福井県 公募平成２４年度第４回	100,000,000	100,735,000	
福井県 公募平成２７年度第４回	200,000,000	200,694,000	
徳島県 公募平成２９年度第２回	200,000,000	201,738,000	
徳島県 公募平成３０年度第２回	300,000,000	304,404,000	
山梨県 公募平成２４年度第１回	200,000,000	201,804,000	
岡山県 公募平成２８年度第２回	168,900,000	170,487,660	
岡山県 公募令和２年度第３回	300,000,000	303,234,000	
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第９６回	100,000,000	115,252,000	
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	350,898,000	
	100,000,000	114,760,000	

	小計	福岡北九州高速道路債券 第 1 1 7 回			
		福岡北九州高速道路債券 第 1 3 6 回	100,000,000	105,178,000	
		銘柄数：296	51,732,340,000	54,264,457,376	
		組入時価比率：6.8%		6.9%	
	合計			54,264,457,376	
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	101,539,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第 2 回	191,000,000	194,073,190	
		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	328,038,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第 9 回	100,000,000	108,146,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第 1 2 回	100,000,000	107,542,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第 2 2 回	200,000,000	200,068,000	
		原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券 政府保証第 1 6 回	700,000,000	699,853,000	
		日本政策投資銀行債券 政府保証第 2 2 回	100,000,000	103,941,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第 4 7 回	100,000,000	107,394,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第 6 6 回	400,000,000	401,196,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第 7 8 回	200,000,000	201,658,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第 8 2 回	100,000,000	101,106,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第 8 6 回	300,000,000	302,730,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第 9 6 回	200,000,000	201,428,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第 1 3 7 回	400,000,000	400,088,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第 1 3 8 回	400,000,000	400,552,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第 1 9 回	159,000,000	160,636,110	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第 3 7 回	400,000,000	401,368,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第 3 8 回	1,500,000,000	1,500,210,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第 4 2 回	300,000,000	302,442,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第 5 2 回	300,000,000	299,907,000	

日本政策投資銀行社債 政府保証第5 5 回	300,000,000	301,575,000	
道路債券 財投機関債第1 7 回	300,000,000	305,892,000	
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	131,555,000	
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	221,954,000	
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	111,491,000	
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	340,488,000	
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	307,302,000	
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	231,822,000	
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	117,517,000	
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	116,068,000	
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	201,980,000	
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	100,997,000	
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	408,068,500	
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	118,425,000	
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	101,643,000	
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	405,680,000	
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	101,718,000	
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	101,682,000	
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	202,978,000	
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	202,806,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第1 3 6 回	200,000,000	203,388,000	
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	358,059,000	
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	121,080,000	
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	106,493,000	
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	111,366,000	
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	93,087,000	
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	103,691,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第260回	200,000,000	196,218,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第90回	100,000,000	116,510,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	200,000,000	233,388,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回	200,000,000	234,038,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回	200,000,000	236,092,000	
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	235,404,000	
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	232,686,000	
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	130,147,000	
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	126,038,000	
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	115,973,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	100,000,000	115,238,000	
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	384,090,000	
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	201,766,000	
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	201,842,000	
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	201,946,000	
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	910,638,000	
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	117,472,000	
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	197,769,880	
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	404,256,000	
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	1,016,170,000	
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	276,556,000	
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	304,731,000	
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	139,207,070	
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	147,354,800	
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	115,645,000	
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	125,019,000	
	100,000,000	115,663,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第219回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	300,000,000	305,340,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第224回	100,000,000	125,158,000	
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	193,091,300	
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	640,495,800	
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	101,507,000	
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	559,340,000	
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	203,136,000	
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	406,240,000	
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	407,283,670	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第271回	151,000,000	151,067,950	
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	100,344,000	
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	100,609,000	
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	604,656,000	
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	100,393,000	
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	105,205,000	
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	505,495,000	
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	132,029,660	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第351回	100,000,000	100,816,000	
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	201,446,000	
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	101,283,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第28回	400,000,000	523,940,000	
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	132,960,000	
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	1,067,860,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	133,171,000	
	100,000,000	114,340,000	

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	116,701,000	
地方公共団体金融機構債券 F１６回	100,000,000	110,545,000	
地方公共団体金融機構債券 ２０年第６回	300,000,000	354,684,000	
地方公共団体金融機構債券 F２４回	100,000,000	102,540,000	
地方公共団体金融機構債券（２０年）第１０回	300,000,000	343,962,000	
地方公共団体金融機構債券 F１０４回	100,000,000	104,506,000	
地方公共団体金融機構債券 F１０６回	100,000,000	103,122,000	
地方公共団体金融機構債券 F１２２回	100,000,000	107,729,000	
地方公共団体金融機構債券 F１２４回	100,000,000	107,716,000	
地方公共団体金融機構債券 F１３２回	500,000,000	520,725,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第４１回	102,000,000	102,909,840	
地方公共団体金融機構債券 第４１回	600,000,000	605,388,000	
地方公共団体金融機構債券 F１４２回	100,000,000	103,196,000	
地方公共団体金融機構債券 F１４５回	200,000,000	207,296,000	
地方公共団体金融機構債券 F１４７回	100,000,000	106,758,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第４２回	108,000,000	109,046,520	
地方公共団体金融機構債券 第４２回	100,000,000	100,964,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第４３回	202,000,000	203,916,980	
政保 地方公共団体金融機構債券第４４回	145,000,000	146,677,650	
地方公共団体金融機構債券 第４４回	100,000,000	101,079,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第４５回	223,000,000	225,662,620	
地方公共団体金融機構債券 F１６０回	100,000,000	106,461,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第４８回	500,000,000	505,190,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第４９回	13,000,000	13,205,790	
地方公共団体金融機構債券（２０年）第２９回	100,000,000	117,393,000	
	100,000,000	101,705,000	

政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 0 回			
地方公共団体金融機構債券 第 5 1 回	600,000,000	609,786,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 2 回	300,000,000	304,803,000	
地方公共団体金融機構債券（1 5 年） 第 2 回	200,000,000	215,558,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 6 回	591,000,000	601,318,860	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 9 回	116,000,000	117,984,760	
地方公共団体金融機構債券（2 0 年） 第 3 8 回	100,000,000	115,297,000	
地方公共団体金融機構債券 F 2 4 0 回	300,000,000	324,588,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	101,612,000	
地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	101,677,000	
地方公共団体金融機構債券（2 0 年） 第 3 9 回	100,000,000	114,708,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 5 回	400,000,000	406,576,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 9 回	320,000,000	324,457,600	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 2 回	189,000,000	192,496,500	
地方公共団体金融機構債券 第 7 4 回	300,000,000	305,760,000	
地方公共団体金融機構債券 第 7 7 回	100,000,000	101,928,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 8 回	509,000,000	516,925,130	
地方公共団体金融機構債券 第 7 9 回	400,000,000	407,892,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 （8 年） 第 5 回	500,000,000	501,950,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 8 3 回	116,000,000	116,053,360	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 9 1 回	300,000,000	301,026,000	
地方公共団体金融機構債券 第 9 5 回	200,000,000	201,492,000	
地方公共団体金融機構債券 第 1 0 1 回	400,000,000	403,912,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 0 8 回	157,000,000	158,259,140	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 0 回	100,000,000	100,719,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 3 回	110,000,000	111,435,500	
	100,000,000	101,847,000	

公営企業債券（２０年） 第２回財 投機関債			
公営企業債券（２０年） 第５回財 投機関債	200,000,000	208,496,000	
公営企業債券（２０年） 第１９回 財投機関債	100,000,000	112,164,000	
公営企業債券（２０年） 第２０回 財投機関債	100,000,000	112,073,000	
公営企業債券（２０年） 第２４回 財投機関債	100,000,000	114,585,000	
公営企業債券（２０年） 第２５回 財投機関債	100,000,000	116,299,000	
都市再生債券 財投機関債第９６回	200,000,000	203,484,000	
都市再生債券 財投機関債第９７回	100,000,000	107,314,000	
都市再生債券 財投機関債第１０１ 回	100,000,000	106,798,000	
都市再生債券 財投機関債第１０９ 回	100,000,000	107,024,000	
都市再生債券 財投機関債第１１３ 回	300,000,000	319,641,000	
都市再生債券 財投機関債第１２１ 回	200,000,000	206,578,000	
都市再生債券 財投機関債第１２７ 回	100,000,000	100,075,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第 ７回	100,000,000	108,352,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第 １６回	360,000,000	365,259,600	
民間都市開発推進機構 政府保証第 １７回	400,000,000	402,412,000	
東京交通債券 第３４７回	157,000,000	164,802,900	
関西国際空港債券 政府保証第５４ 回	300,000,000	348,345,000	
中部国際空港債券 政府保証第１８ 回	368,000,000	371,830,880	
中部国際空港債券 政府保証第２２ 回	300,000,000	299,931,000	
預金保険機構債券 政府保証第２３ ０回	600,000,000	601,572,000	
預金保険機構債券 政府保証第２３ １回	300,000,000	300,828,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第３回	400,000,000	448,148,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第６回	200,000,000	227,398,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第１８回	100,000,000	104,329,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第４２回	100,000,000	106,757,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第４９回	100,000,000	117,442,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第５９回	100,000,000	116,550,000	

住宅金融支援機構債券 財投機関債 第75回	100,000,000	118,504,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第77回	300,000,000	324,741,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	118,435,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第85回	200,000,000	233,230,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	216,052,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第120回	100,000,000	117,835,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第123回	100,000,000	117,281,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	133,236,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第132回	200,000,000	213,004,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第137回	100,000,000	108,231,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第143回	100,000,000	107,761,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回	250,000,000	254,910,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第188回	300,000,000	300,915,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第198回	300,000,000	301,341,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第223回	100,000,000	102,056,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第244回	130,000,000	131,605,500	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第301回	300,000,000	300,192,000	
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	202,210,000	
成田国際空港 第17回	400,000,000	405,988,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第6回	200,000,000	215,246,000	
商工債券 利付第811回い号	300,000,000	300,528,000	
商工債券 利付第815回い号	100,000,000	100,211,000	
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	100,235,000	
商工債券 利付第819回い号	300,000,000	300,795,000	
商工債券 利付第829回い号	200,000,000	200,476,000	
商工債券 利付第831回い号	200,000,000	200,206,000	
商工債券 利付第833回い号	100,000,000	99,984,000	
商工債券 利付第845回い号	300,000,000	300,555,000	
しんきん中金債券 利付第335回	200,000,000	200,170,000	
しんきん中金債券 利付第374回	300,000,000	300,129,000	
商工債券 利付（10年）第15回	200,000,000	203,258,000	

国際協力機構債券 第6回財投機関債	200,000,000	236,264,000	
東日本高速道路 第61回	200,000,000	200,468,000	
中日本高速道路 第63回	100,000,000	102,197,000	
中日本高速道路 第79回	300,000,000	299,955,000	
西日本高速道路 第20回	200,000,000	202,948,000	
西日本高速道路 第22回	400,000,000	407,120,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	101,550,000	
西日本高速道路 第30回	300,000,000	301,689,000	
西日本高速道路 第50回	200,000,000	199,972,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第57回	300,000,000	304,392,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第62回	100,000,000	101,575,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第68回	200,000,000	203,264,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第69回	100,000,000	114,672,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第71回	500,000,000	508,055,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第90回	300,000,000	301,437,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第135回	300,000,000	300,249,000	
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	51,705,000	52,058,145	
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	30,303,000	30,349,666	
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	33,843,000	34,531,705	
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	10,560,000	10,665,177	
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	23,126,000	23,580,194	
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	26,578,000	27,493,346	
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券	28,947,000	28,977,394	
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	47,908,000	48,749,264	
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	51,430,000	51,872,812	
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	45,628,000	46,538,278	
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	74,370,000	76,303,620	
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	12,715,000	13,098,993	
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	19,374,000	20,681,163	
	63,861,000	67,916,173	

貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券	10,342,000	10,407,671	
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	60,604,000	63,711,167	
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券	20,916,000	21,058,437	
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	72,468,000	76,513,888	
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	58,352,000	61,270,767	
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	35,102,000	37,286,397	
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	68,406,000	72,132,758	
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	76,677,000	80,001,714	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	119,355,000	125,136,556	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	114,357,000	120,345,876	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	74,092,000	77,753,626	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	26,191,000	27,516,264	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	59,642,000	63,097,061	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	38,436,000	40,075,679	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	84,264,000	87,947,179	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	37,374,000	38,975,102	
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	21,264,000	21,438,577	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	113,190,000	118,865,346	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	24,100,000	25,645,774	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	25,652,000	27,330,153	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	23,915,000	25,384,815	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	23,990,000	25,385,498	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	73,374,000	77,410,303	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	104,016,000	109,557,972	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	34,786,000	36,676,271	
	73,478,000	76,990,983	

貸付債権担保第7 6回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	9,725,000	9,737,350	
貸付債権担保第2 3回住宅金融支援機構債券	69,128,000	73,142,262	
貸付債権担保第3 2回住宅金融支援機構債券	69,801,000	74,029,544	
貸付債権担保第3 9回住宅金融支援機構債券	126,200,000	132,294,198	
貸付債権担保第5 8回住宅金融支援機構債券	76,876,000	81,118,786	
貸付債権担保第6 4回住宅金融支援機構債券	126,717,000	132,744,927	
貸付債権担保第7 1回住宅金融支援機構債券	109,521,000	114,137,310	
貸付債権担保第7 3回住宅金融支援機構債券	85,968,000	90,725,469	
貸付債権担保第7 5回住宅金融支援機構債券	72,412,000	76,057,220	
貸付債権担保第8 3回住宅金融支援機構債券	177,920,000	185,547,430	
貸付債権担保第8 4回住宅金融支援機構債券	306,313,000	318,979,042	
貸付債権担保第8 8回住宅金融支援機構債券	47,011,000	48,801,648	
貸付債権担保第8 9回住宅金融支援機構債券	48,578,000	50,488,086	
貸付債権担保第9 0回住宅金融支援機構債券	49,761,000	51,518,060	
貸付債権担保第9 2回住宅金融支援機構債券	104,116,000	107,129,117	
貸付債権担保第9 3回住宅金融支援機構債券	110,844,000	113,227,146	
貸付債権担保第9 4回住宅金融支援機構債券	58,380,000	60,268,009	
貸付債権担保第9 6回住宅金融支援機構債券	61,922,000	63,763,560	
貸付債権担保第9 7回住宅金融支援機構債券	184,773,000	191,182,775	
貸付債権担保第9 8回住宅金融支援機構債券	190,758,000	198,157,502	
貸付債権担保第9 9回住宅金融支援機構債券	128,198,000	133,032,346	
貸付債権担保第1 0 0回住宅金融支援機構債券	62,140,000	64,355,912	
貸付債権担保第1 0 1回住宅金融支援機構債券	63,114,000	65,538,839	
貸付債権担保第1 1 5回住宅金融支援機構債券	236,523,000	239,075,083	
貸付債権担保第1 1 6回住宅金融支援機構債券	158,504,000	160,910,090	
	160,042,000	162,234,575	

小計	貸付債権担保第 1 1 7 回住宅金融支援機構債券			
	貸付債権担保第 1 1 8 回住宅金融支援機構債券	79,845,000	80,993,969	
	貸付債権担保第 1 1 9 回住宅金融支援機構債券	159,286,000	161,477,775	
	貸付債権担保第 1 2 0 回住宅金融支援機構債券	80,453,000	81,337,178	
	貸付債権担保第 1 2 1 回住宅金融支援機構債券	80,925,000	81,964,886	
	貸付債権担保第 1 2 3 回住宅金融支援機構債券	82,189,000	83,393,890	
	貸付債権担保第 1 2 5 回住宅金融支援機構債券	329,256,000	333,190,609	
	貸付債権担保第 1 2 6 回住宅金融支援機構債券	248,466,000	251,581,763	
	貸付債権担保第 1 2 8 回住宅金融支援機構債券	165,918,000	167,885,787	
	貸付債権担保第 1 2 9 回住宅金融支援機構債券	168,846,000	171,268,940	
	貸付債権担保第 1 3 4 回住宅金融支援機構債券	171,556,000	173,259,551	
	貸付債権担保第 1 3 5 回住宅金融支援機構債券	86,298,000	87,148,035	
	貸付債権担保第 1 3 6 回住宅金融支援機構債券	86,946,000	88,128,465	
	貸付債権担保第 1 4 0 回住宅金融支援機構債券	87,210,000	88,052,448	
	貸付債権担保第 1 4 2 回住宅金融支援機構債券	268,392,000	269,886,943	
	貸付債権担保第 1 4 4 回住宅金融支援機構債券	267,939,000	269,576,107	
	貸付債権担保第 1 5 0 回住宅金融支援機構債券	463,255,000	462,087,597	
	貸付債権担保第 1 5 2 回住宅金融支援機構債券	186,886,000	188,095,152	
	貸付債権担保第 1 5 4 回住宅金融支援機構債券	188,950,000	189,692,573	
	貸付債権担保第 1 6 4 回住宅金融支援機構債券	293,838,000	295,512,876	
	貸付債権担保第 1 6 5 回住宅金融支援機構債券	196,216,000	197,826,933	
	貸付債権担保第 1 6 6 回住宅金融支援機構債券	294,981,000	298,621,065	
	貸付債権担保第 1 6 7 回住宅金融支援機構債券	197,392,000	199,802,156	
	貸付債権担保第 1 6 8 回住宅金融支援機構債券	198,094,000	200,342,366	
	貸付債権担保第 1 6 9 回住宅金融支援機構債券	298,308,000	301,419,352	
	貸付債権担保第 1 7 0 回住宅金融支援機構債券	499,550,000	503,491,449	
	銘柄数：319	61,709,931,000	64,433,102,175	

		組入時価比率：8.1%		8.1%	
	合計			64,433,102,175	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行（B F C M） 第29回円貨社債	200,000,000	199,708,000	
		フランス相互信用連合銀行（B F C M） 第31回円貨社債	100,000,000	99,779,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第14回円貨社債	100,000,000	100,219,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債（2014）	100,000,000	101,829,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第15回円貨社債（2018）	100,000,000	99,904,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第16回円貨社債（2018）	100,000,000	100,218,000	
		スタンダード・チャータード 第3回円貨社債（2015）	100,000,000	100,699,000	
		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	100,917,000	
		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	102,509,000	
		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	100,449,000	
		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	100,919,000	
		サンタンデール銀行 第1回円貨社債	100,000,000	100,249,000	
		フランス電力 第4回円貨社債（2017）	100,000,000	102,838,000	
		現代キャピタル・サービスズ・インク 第15回円貨社債	200,000,000	198,664,000	
		ビー・エヌ・ピー・パリバ 第1回円貨社債（2017）	100,000,000	101,038,000	
		ウエストパック・バンキング・コーポレーション 第12回円貨社	200,000,000	200,108,000	
		オーストラリア・ニュージーランド銀行 第10回円貨社債	200,000,000	200,232,000	
		I N P E X 第1回社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,507,000	
		長谷工コーポレーション 第14回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,612,000	
		大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,875,000	
		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	199,782,000	
		明治ホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,284,000	
		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	299,493,000	
		味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,299,000	
		日本たばこ産業 第13回	100,000,000	100,861,000	

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	99,921,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,117,000	
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約付	200,000,000	199,578,000	
森ビル 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,416,000	
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付	100,000,000	99,955,000	
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付	600,000,000	601,470,000	
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付	200,000,000	201,072,000	
東レ 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,808,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,706,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,860,000	
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	101,172,000	
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	599,790,000	
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,630,000	
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,572,000	
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	100,685,000	
三菱ケミカルホールディングス 第33回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,158,000	
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	102,259,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,155,000	
電通 第6回社債間限定同順位特約付	300,000,000	304,491,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,055,000	
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	100,092,000	
オリエンタルランド 第18回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,600,000	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,094,000	
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,913,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,406,000	
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,565,000	
	300,000,000	301,617,000	

新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付			
ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順位	100,000,000	100,010,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第34回社債間限定同順位	100,000,000	100,222,000	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,072,000	
LIXILグループ 第11回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,643,000	
荏原製作所 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,909,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	216,318,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,964,000	
パナソニック 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,955,000	
パナソニック 第21回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,203,000	
パナソニック 第22回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,198,000	
ソニー 第32回	100,000,000	100,417,000	
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	99,699,000	
三菱重工業 第35回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,381,000	
三菱重工業 第38回社債間限定同順位特約付（第2回グリーンボ	300,000,000	299,700,000	
J A三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,541,000	
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	100,153,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	101,453,000	
トヨタ自動車 第26回社債間限定同順位特約付	700,000,000	700,469,000	
トヨタ自動車 第27回社債間限定同順位特約付	300,000,000	301,800,000	
楽天カード 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,650,000	
ドンキホーテホールディングス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,506,000	
ニコン 第22回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,864,000	
丸紅 第113回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,984,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,570,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	207,500,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,173,000	

住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,298,000	
住友商事 第53回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,560,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,056,000	
クレディセゾン 第65回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,852,000	
イオン 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,803,000	
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	101,483,000	
りそなホールディングス 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,281,000	
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	200,000,000	202,928,000	
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	113,630,000	
東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,466,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	300,000,000	303,786,000	
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	101,529,000	
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	105,072,000	
三井住友信託銀行 第18回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,066,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,088,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,377,000	
セブン銀行 第12回社債間限定同順位特約付	300,000,000	303,786,000	
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	202,564,000	
みずほ銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	111,613,000	
芙蓉総合リース 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,644,000	
みずほリース 第3回社債間限定同順位特約付	300,000,000	301,014,000	
みずほリース 第7回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,020,000	
N T Tファイナンス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,613,000	
N T Tファイナンス 第17回日本電信電話保証付	200,000,000	201,322,000	
N T Tファイナンス 第18回日本電信電話保証付	200,000,000	202,370,000	
トヨタファイナンス 第81回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,667,000	
トヨタファイナンス 第96回社債間限定同順位特約付	500,000,000	500,340,000	

リコーリース 第28回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,646,000	
アコム 第77回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,207,000	
ジャックス 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,179,000	
日立キャピタル 第61回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,770,000	
日立キャピタル 第80回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,920,000	
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	100,263,000	
三菱UFJリース 第52回社債間限定同順位特約付	300,000,000	303,063,000	
三菱UFJリース 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,548,000	
三菱UFJリース 第76回社債間限定同順位特約付	300,000,000	301,707,000	
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	102,319,000	
三井不動産 第71回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,916,000	
三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	100,439,000	
東京建物 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,631,000	
ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,289,000	
エス・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	107,297,000	
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	101,778,000	
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	115,399,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人 第5回特定投資法人債	100,000,000	101,807,000	
東武鉄道 第124回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,759,000	
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	202,454,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,888,000	
東京急行電鉄 第83回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,326,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	214,446,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,808,000	
京成電鉄 第58回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,826,000	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	200,000,000	232,008,000	
	100,000,000	115,340,000	

東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付			
東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,862,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,182,000	
東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,821,000	
東日本旅客鉄道 第145回社債間限定同順位特約付	200,000,000	185,990,000	
西日本旅客鉄道 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,001,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	300,000,000	339,861,000	
西日本旅客鉄道 第65回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,888,000	
西日本旅客鉄道 第66回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,400,000	
東海旅客鉄道 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	212,848,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	234,132,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,512,000	
東海旅客鉄道 第73回社債間限定同順位特約付	300,000,000	322,773,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	120,610,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	100,517,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	103,335,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	106,724,000	
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	201,480,000	
西日本鉄道 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,596,000	
阪急阪神ホールディングス 第47回	400,000,000	430,044,000	
阪急阪神ホールディングス 第49回	100,000,000	103,670,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,650,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,034,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,523,000	
日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,122,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,924,000	
九州旅客鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,360,000	
九州旅客鉄道 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,295,000	

ANAホールディングス 第32回 社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,720,000	
澁澤倉庫 第8回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	99,651,000	
KDDI 第20回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	101,536,000	
KDDI 第25回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	100,783,000	
東京電力 第548回	100,000,000	112,182,000	
東京電力 第560回	100,000,000	111,654,000	
中部電力 第500回	200,000,000	204,358,000	
中部電力 第524回	100,000,000	101,253,000	
中部電力 第530回	200,000,000	200,672,000	
関西電力 第509回	100,000,000	101,591,000	
関西電力 第511回	300,000,000	303,663,000	
関西電力 第527回	200,000,000	200,970,000	
関西電力 第535回	200,000,000	200,424,000	
中国電力 第377回	100,000,000	102,084,000	
中国電力 第400回	100,000,000	101,048,000	
中国電力 第402回	100,000,000	100,500,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	101,701,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	104,412,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	102,066,000	
北陸電力 第326回	100,000,000	102,570,000	
東北電力 第475回	100,000,000	102,188,000	
東北電力 第481回	200,000,000	205,318,000	
東北電力 第484回	100,000,000	103,532,000	
東北電力 第491回	100,000,000	101,382,000	
東北電力 第521回	300,000,000	303,669,000	
東北電力 第529回	200,000,000	199,676,000	
四国電力 第281回	100,000,000	102,143,000	
九州電力 第424回	100,000,000	102,562,000	
九州電力 第428回	105,000,000	107,568,300	
九州電力 第449回	200,000,000	202,708,000	
九州電力 第451回	100,000,000	101,564,000	
九州電力 第476回	100,000,000	101,400,000	
九州電力 第481回	300,000,000	301,596,000	
九州電力 第484回	200,000,000	201,522,000	
北海道電力 第321回	100,000,000	102,552,000	
北海道電力 第323回	100,000,000	108,508,000	
北海道電力 第338回	100,000,000	104,070,000	
北海道電力 第345回	300,000,000	301,506,000	
電源開発 第40回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	102,235,000	

	電源開発 第 4 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,023,000	
	電源開発 第 5 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,403,000	
	電源開発 第 5 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,141,000	
	東京電力パワーグリッド 第 6 回	100,000,000	102,879,000	
	東京電力パワーグリッド 第 1 1 回	300,000,000	307,023,000	
	東京電力パワーグリッド 第 1 4 回	100,000,000	100,480,000	
	東京電力パワーグリッド 第 2 8 回	100,000,000	103,537,000	
	東京電力パワーグリッド 第 3 5 回	100,000,000	105,176,000	
	東京電力パワーグリッド 第 3 8 回	400,000,000	405,324,000	
	東京電力パワーグリッド 第 4 0 回	400,000,000	427,620,000	
	東京瓦斯 第 3 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	126,217,000	
	東京瓦斯 第 5 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,877,000	
	大阪瓦斯 第 3 6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,408,000	
	大阪瓦斯 第 4 3 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,478,000	
	北海道瓦斯 第 1 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,189,000	
	北海道瓦斯 第 2 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,260,000	
	広島ガス 第 1 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,076,000	
	東京都競馬 第 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,893,000	
	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	101,339,000	
	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	100,933,000	
	小計	銘柄数：218 組入時価比率：4.2%	33,105,000,000	33,787,731,300 4.3%
	合計			33,787,731,300
	合計			790,764,480,901

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

第 2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2021年 9月 6日現在)

資産の部

(2021年 9月 6日現在)

流動資産	
預金	154,629,075
コール・ローン	806,878,899
国債証券	85,145,425,312
派生商品評価勘定	32,486,686
未収入金	208,379,707
未収利息	422,399,606
前払費用	24,251,911
差入委託証拠金	2,124,011
流動資産合計	86,796,575,207
資産合計	86,796,575,207
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	291,239,160
未払金	781,877,312
未払解約金	4,104,481
未払利息	632
その他未払費用	752,100
流動負債合計	1,077,973,685
負債合計	1,077,973,685
純資産の部	
元本等	
元本	69,507,998,280
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	16,210,603,242
元本等合計	85,718,601,522
純資産合計	85,718,601,522
負債純資産合計	86,796,575,207

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。 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 9月 6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	1,2332円
(10,000口当たり純資産額)	(12,332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 9月 8日 至 2021年 9月 6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、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 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 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2020年 9月 8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	55,714,203,773円
同期中における追加設定元本額	26,603,112,010円
同期中における一部解約元本額	12,809,317,503円
期末元本額	69,507,998,280円
期末元本額の内訳＊	
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,556,273,232円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	876,355,232円
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	30,562,537円
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	8,244,243円
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	4,469,776円
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	2,854,239円
野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）	12,342,972,136円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	7,314,172円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	3,791,671円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	14,815,568円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	3,114,434円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	5,424,084円
野村外国債券インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	33,969,196,969円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	8,452,456,658円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	4,660,804,118円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	186,323,900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）	568,452,306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）	294,994,115円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信（適格機関投資家専用）	6,047,758,615円
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	471,820,275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9月6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9月6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	70,000.00	78,211.32	
		US TREASURY BOND	500,000.00	528,984.35	
		US TREASURY BOND	610,000.00	752,301.53	
		US TREASURY BOND	1,800,000.00	2,360,531.16	
		US TREASURY BOND	2,280,000.00	2,960,259.20	
		US TREASURY BOND	20,000.00	25,785.93	
		US TREASURY BOND	510,000.00	600,365.62	
		US TREASURY BOND	3,450,000.00	4,632,028.99	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,051,913.80	
		US TREASURY N/B	700,000.00	713,097.63	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,530,292.95	
		US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,860,156.04	
		US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,188,128.74	
		US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,318,442.01	
		US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,425,921.84	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,022,304.60	
		US TREASURY N/B	700,000.00	721,683.55	
		US TREASURY N/B	4,110,000.00	4,219,011.17	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,036,328.10	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,512,792.75	
		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,143,066.38	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,539,375.00	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	999,218.70	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,050,625.00	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,501,464.75	
		US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,109,960.50	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	998,789.00	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,570,273.35	
		US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,297,538.98	
		US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,094,671.72	

US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,068,906.10	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,675,273.35	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,992,031.20	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,117,578.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,990,468.40	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,750,269.51	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,635,742.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,123,984.30	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,701,659.85	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,091,015.60	
US TREASURY N/B	500,000.00	523,535.15	
US TREASURY N/B	400,000.00	423,828.12	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,204,374.80	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,091,796.80	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,088,046.80	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,585,605.45	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,089,453.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,180,781.20	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,077,109.20	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,999,062.50	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,150,351.30	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,087,187.40	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,074,765.40	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,103,281.20	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,112,109.20	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,526,562.32	
US TREASURY N/B	800,000.00	846,000.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,083,593.60	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,101,953.00	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,683,691.25	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,333,437.20	
US TREASURY N/B	500,000.00	496,660.15	
US TREASURY N/B	800,000.00	845,187.44	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,169,609.20	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,324,374.80	

US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,173,750.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,972,109.20	
US TREASURY N/B	2,780,000.00	2,929,750.53	
US TREASURY N/B	600,000.00	650,085.90	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,283,710.90	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,936,093.60	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,933,593.60	
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,747,688.96	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,708,105.25	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,448,456.90	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,287,570.12	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,777,538.80	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,205,898.40	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,372,265.52	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,724,355.25	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,156,796.80	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,632,128.75	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,794,605.30	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,114,218.40	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,163,750.00	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,757,421.68	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,612,148.40	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,113,648.20	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,954,140.60	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,464,609.30	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,445,749.76	
US TREASURY N/B	600,000.00	646,242.18	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,549,874.88	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,053,124.80	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,796,582.00	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,473,816.29	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,701,757.50	
US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,979,234.24	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,489,124.80	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,620,585.85	

US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,776,101.52	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,413,378.75	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,091,406.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	708,984.35	
US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,131,519.49	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,203,730.40	
US TREASURY N/B	500,000.00	684,570.30	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,436,366.85	
US TREASURY N/B	400,000.00	411,875.00	
US TREASURY N/B	340,000.00	504,235.91	
US TREASURY N/B	1,760,000.00	2,507,037.45	
US TREASURY N/B	400,000.00	511,281.24	
US TREASURY N/B	800,000.00	1,117,812.48	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,684,121.06	
US TREASURY N/B	340,000.00	456,928.10	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,062,937.44	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,945,156.04	
US TREASURY N/B	300,000.00	449,507.79	
US TREASURY N/B	500,000.00	610,195.30	
US TREASURY N/B	500,000.00	577,128.90	
US TREASURY N/B	800,000.00	978,062.48	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,974,375.00	
US TREASURY N/B	700,000.00	924,519.47	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	3,073,339.75	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,929,874.88	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,888,128.80	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	3,072,308.56	
US TREASURY N/B	2,760,000.00	3,272,864.02	
US TREASURY N/B	3,020,000.00	3,662,457.58	
US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,815,119.10	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,787,546.62	
US TREASURY N/B	4,030,000.00	4,286,597.35	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,741,671.76	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,220,195.30	
US TREASURY N/B	3,520,000.00	4,112,487.45	

小計	US TREASURY N/B	2,600,000.00	3,039,663.90	
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,712,101.44	
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,254,007.70	
	US TREASURY N/B	900,000.00	1,103,203.08	
	US TREASURY N/B	500,000.00	601,699.20	
	US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,387,242.09	
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,534,913.94	
	US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,450,500.00	
	US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,352,375.00	
	US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,761,433.57	
	US TREASURY N/B	400,000.00	393,343.72	
	銘柄数：146	330,270,000.00	353,477,648.24	
			(38,822,450,106)	
	組入時価比率：45.3%		45.5%	
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,021,524.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,020,179.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	154,732.35	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	626,245.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	1,117,277.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	3,083,463.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,021,819.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	585,984.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,033,315.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,006,696.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	427,102.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	1,376,048.34	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,854,465.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	884,504.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	598,921.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	780,000.00	1,099,207.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,540,000.00	1,886,452.26	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	211,894.40	
	銘柄数：18	17,050,000.00	19,009,831.45	
			(1,664,690,940)	
	組入時価比率：1.9%		2.0%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,100,000.00	13,737,708.00	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	11,000,000.00	12,202,367.10	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,000,000.00	13,558,462.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	20,100,000.00	20,799,459.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	12,400,000.00	13,074,188.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,100,000.00	3,256,333.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,000,000.00	7,506,156.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,200,000.00	11,261,089.68	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	5,144,480.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,300,000.00	4,522,439.86	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,300,000.00	9,705,674.37	
	銘柄数：11	108,500,000.00	114,768,358.31	
	組入時価比率：0.7%		(632,786,820)	0.7%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	736,890.00	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	210,680.00	
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	611,850.00	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	251,413.00	
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	311,308.35	
	BELGIUM KINGDOM	1,100,000.00	1,184,267.04	
	BELGIUM KINGDOM	950,000.00	1,023,416.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,029,365.00	
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	325,119.60	
	BELGIUM KINGDOM	1,400,000.00	1,532,952.40	
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,333,272.00	
	BELGIUM KINGDOM	550,000.00	788,999.20	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	589,719.00	
	BELGIUM KINGDOM	720,000.00	903,405.60	
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	512,494.20	
	BELGIUM KINGDOM	650,000.00	1,106,077.70	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	608,753.50	
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	873,595.80	
	BELGIUM KINGDOM	370,000.00	542,014.11	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	370,000.00	613,717.15	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,400,000.00	3,435,700.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	976,446.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	606,186.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	305,489.58	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,940,000.00	2,150,866.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,920,000.00	2,143,584.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,546,502.86	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	861,488.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,202,005.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	776,149.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	720,000.00	798,335.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	523,758.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,084,984.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	1,650,975.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	847,560.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	1,432,990.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,600,000.00	1,761,771.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	994,140.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	330,000.00	454,278.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	835,364.08	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,065,706.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,160,585.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	658,680.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,100,000.00	2,556,750.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	465,658.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	685,134.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	521,315.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,689,505.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,667,881.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	950,000.00	1,324,335.81	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	813,092.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000.00	1,126,548.00	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,007,810.00	
BUNDES OblIGATION	1,100,000.00	1,117,732.00	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,019,570.00	
BUNDES OblIGATION	1,500,000.00	1,540,228.50	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,033,000.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,310,000.00	1,359,897.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	737,863.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	466,028.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	647,813.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	742,959.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	463,060.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,043,740.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000.00	2,139,160.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	949,527.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	310,557.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,270,000.00	2,386,496.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,300,000.00	3,284,469.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	909,177.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,073,630.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,375,830.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	1,458,912.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	790,735.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,562,880.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000.00	2,081,860.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,731,499.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	2,332,485.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	102,258.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	2,317,753.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,310,000.00	2,353,394.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	60,000.00	115,873.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	1,273,836.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,737,296.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,410,000.00	2,275,514.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	785,034.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,250,496.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	213,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,813,194.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000.00	2,145,591.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,150,000.00	1,245,249.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000.00	2,647,500.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,022,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	216,558.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,466,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,681,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	738,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,633,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,038,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,350,000.00	1,596,915.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	530,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	850,161.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,076,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,530,000.00	1,666,323.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,049,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,205,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	592,075.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,168,860.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,678,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	553,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	889,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	607,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,040,000.00	2,659,548.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,386,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	999,440.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,069,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,201,370.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	1,858,292.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	1,053,220.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	545,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,535,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,070,000.00	1,257,785.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,610,000.00	2,395,036.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	1,031,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	314,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	115,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,580,000.00	2,201,730.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	504,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	555,975.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	482,220.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	851,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,180,000.00	3,537,268.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	860,000.00	1,149,390.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	612,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	1,116,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	1,338,930.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	299,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000.00	12,071.48	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	307,257.00	
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	155,465.70	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	214,370.00	
FINNISH GOVERNMENT	810,000.00	852,514.47	
FINNISH GOVERNMENT	740,000.00	905,646.78	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	306,226.20	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	572,067.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	400,955.20	
FINNISH GOVERNMENT	160,000.00	239,305.60	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	253,262.60	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	505,125.00	
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	312,684.30	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,034,300.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,010,000.00	2,171,616.06	
FRANCE (GOVT OF)	3,100,000.00	3,169,080.40	
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	625,383.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,155,196.90	
FRANCE (GOVT OF)	1,050,000.00	1,092,135.45	
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	867,952.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,300,000.00	2,476,341.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,078,886.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,590,531.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,700,000.00	3,766,899.70	
FRANCE (GOVT OF)	2,720,000.00	3,367,047.20	

FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,517,017.50	
FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	1,365,582.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,550,000.00	1,771,650.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,260,000.00	1,564,720.92	
FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	704,191.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,510,000.00	2,000,718.29	
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	719,960.40	
FRANCE (GOVT OF)	2,400,000.00	2,378,342.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	610,000.00	630,520.33	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,800,000.00	1,991,880.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,100,000.00	2,264,524.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,100,000.00	1,404,260.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,100,000.00	2,242,695.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,025,180.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,410,000.00	2,870,912.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	900,000.00	1,079,190.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,200,000.00	1,740,135.12	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,640,000.00	1,895,771.12	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	493,303.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,290,000.00	3,717,393.64	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	645,357.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	720,000.00	1,270,761.12	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,800,000.00	2,873,368.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	779,481.08	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	900,000.00	1,836,611.10	
IRISH GOVERNMENT	800,000.00	867,560.00	
IRISH TSY 0.2% 2030	1,100,000.00	1,129,713.20	
IRISH TSY 1.5% 2050	200,000.00	238,158.80	
IRISH TSY 1.7% 2037	550,000.00	665,230.83	
IRISH TSY 1% 2026	650,000.00	697,095.75	
IRISH TSY 2% 2045	450,000.00	589,545.90	
IRISH TSY 2022	1,000,000.00	1,007,114.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	500,000.00	551,570.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	630,000.00	668,556.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	333,865.50	

小計	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	314,066.28	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,080,900.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	700,000.00	725,958.80	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	422,920.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,100,000.00	1,186,827.84	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,100,000.00	1,529,660.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,028,870.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,150,000.00	1,507,670.70	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	650,638.40	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	297,987.60	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	610,000.00	1,068,337.53	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,050,000.00	1,744,450.05	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	284,718.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	705,197.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	126,469.48	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,613,296.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	320,628.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	423,729.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	754,983.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,592,850.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	530,000.00	689,744.65	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	372,742.83	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	650,273.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	503,640.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	428,686.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	710,454.36	
	REPUBLIC OF IRELAND	80,000.00	85,648.57	
	SPANISH GOVERNMENT	90,000.00	130,586.42	
	SPANISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,739,980.00	
	SPANISH GOVERNMENT	710,000.00	1,078,078.20	
	銘柄数：227	222,390,000.00	264,123,975.15	
			(34,449,690,078)	
	組入時価比率：40.2%		40.5%	
英債券	UK TREASURY	600,000.00	600,174.72	
	UK TREASURY	1,100,000.00	1,113,358.62	

		UK TREASURY	950,000.00	990,649.74	
		UK TREASURY	500,000.00	511,094.50	
		UK TREASURY	1,200,000.00	1,292,532.96	
		UK TREASURY	1,000,000.00	1,015,217.60	
		UK TREASURY	1,370,000.00	1,450,428.31	
		UK TREASURY	1,000,000.00	1,050,840.00	
		UK TREASURY	300,000.00	371,275.68	
		UK TREASURY	900,000.00	973,852.20	
		UK TREASURY	90,000.00	125,382.42	
		UK TREASURY	1,200,000.00	1,230,636.00	
		UK TREASURY	1,700,000.00	1,660,492.00	
		UK TREASURY	600,000.00	822,783.12	
		UK TREASURY	600,000.00	818,453.52	
		UK TREASURY	200,000.00	290,301.20	
		UK TREASURY	1,160,000.00	1,688,550.28	
		UK TREASURY	1,170,000.00	1,304,433.00	
		UK TREASURY	400,000.00	615,187.52	
		UK TREASURY	700,000.00	724,990.00	
		UK TREASURY	850,000.00	1,411,528.36	
		UK TREASURY	1,000,000.00	1,503,518.40	
		UK TREASURY	2,180,000.00	3,713,364.91	
		UK TREASURY	1,400,000.00	1,535,791.04	
		UK TREASURY	1,150,000.00	1,337,090.74	
		UK TREASURY	1,240,000.00	2,208,750.74	
		UK TREASURY	860,000.00	1,473,095.03	
		UK TREASURY	300,000.00	348,656.16	
		UK TREASURY	200,000.00	393,403.44	
		UK TREASURY	530,000.00	1,044,852.60	
		UK TSY 0 5/8% 2050	500,000.00	445,567.20	
		UK TSY 3 1/4% 2044	100,000.00	143,450.60	
		UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	780,000.00	1,508,312.52	
	小計	銘柄数：33	27,830,000.00	35,718,015.13	
				(5,433,781,641)	
		組入時価比率：6.3%		6.4%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	3,000,000.00	3,118,482.90		
	SWEDISH GOVERNMENT	250,000.00	274,925.00		

小計	SWEDISH GOVERNMENT	2,700,000.00	2,853,522.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,197,012.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	3,500,000.00	3,679,200.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	4,000,000.00	3,964,782.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,600,000.00	2,406,320.16	
	銘柄数：7	19,050,000.00	20,494,244.06	
	組入時価比率：0.3%		(262,941,151)	0.3%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,944,772.55	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,750,000.00	2,895,997.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,735,046.52	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,750,000.00	1,807,312.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,580,625.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,016,970.00	
	銘柄数：6	11,600,000.00	11,980,724.07	
デンマーククロネ	KINGDOM OF DENMARK	1,650,000.00	1,722,270.00	
	KINGDOM OF DENMARK	3,400,000.00	3,721,300.00	
	KINGDOM OF DENMARK	2,300,000.00	2,421,440.00	
	KINGDOM OF DENMARK	6,400,000.00	6,781,440.00	
	KINGDOM OF DENMARK	4,900,000.00	8,745,497.46	
	KINGDOM OF DENMARK	1,000,000.00	958,000.00	
	銘柄数：6	19,650,000.00	24,349,947.46	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	8,700,000.00	8,960,665.92	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,129,846.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	4,775,000.00	
	銘柄数：3	16,700,000.00	16,865,512.52	
	組入時価比率：0.6%		(488,040,708)	0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,232,160.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	871,161.92	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,071,500.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,098,930.36	

小計	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,340,000.00	1,478,531.61	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	607,617.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	820,000.00	1,002,683.78	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	1,006,295.94	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	820,000.00	891,791.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	1,014,980.85	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,168,246.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	905,840.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,788,807.52	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	197,315.18	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,235,174.28	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	146,340.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	499,847.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,170,000.00	1,577,164.68	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	347,581.23	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	193,977.73	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	390,304.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,255,258.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	270,000.00	318,654.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	456,450.00	
	銘柄数：24	18,660,000.00	20,756,613.88	
			(1,694,569,957)	
	組入時価比率：2.0%		2.0%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,460,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	429,960.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	426,240.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	743,932.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	730,000.00	829,280.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	329,700.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	450,120.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,210,000.00	1,368,389.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	900,000.00	969,840.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	767,900.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	587,750.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	405,322.00	

	小計	銘柄数：12	8,040,000.00	8,768,633.00	
				(717,624,924)	
		組入時価比率：0.8%		0.8%	
	新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	1,500,000.00	1,546,714.80	
		ISRAEL FIXED BOND	1,500,000.00	1,638,021.60	
		ISRAEL FIXED BOND	2,500,000.00	2,523,457.25	
		ISRAEL FIXED BOND	2,000,000.00	2,159,375.40	
		ISRAEL FIXED BOND	1,000,000.00	998,193.80	
		ISRAEL FIXED BOND	1,100,000.00	1,767,810.77	
		ISRAEL FIXED BOND	800,000.00	1,043,171.52	
	小計	銘柄数：7	10,400,000.00	11,676,745.14	
				(400,194,750)	
		組入時価比率：0.5%		0.5%	
	合計			85,145,425,312	
				(85,145,425,312)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2021年 9月 6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	528,571,200	—	527,175,200	△1,396,000
米ドル	528,571,200	—	527,175,200	△1,396,000
売建	85,468,393,697	—	85,725,750,171	△257,356,474
米ドル	39,053,749,680	—	39,021,602,400	32,147,280
カナダドル	1,643,312,884	—	1,650,580,150	△7,267,266
メキシコペソ	632,803,269	—	638,883,662	△6,080,393
ユーロ	34,500,421,319	—	34,700,422,760	△200,001,441
英ポンド	5,485,079,258	—	5,515,173,958	△30,094,700
スウェーデンクローナ	258,571,441	—	260,269,380	△1,697,939
ノルウェークローネ	150,869,166	—	150,529,760	339,406
デンマーククローネ	449,038,063	—	451,652,760	△2,614,697

ズロチ	494,353,987	—	502,901,238	△8,547,251
豪ドル	1,686,343,737	—	1,717,215,760	△30,872,023
シンガポールドル	704,194,893	—	705,226,743	△1,031,850
新シェケル	409,656,000	—	411,291,600	△1,635,600
合計	—	—	—	△258,752,474

(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。

① 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。

② 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。

新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2021年 9月 6日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	83,893,324
コール・ローン	178,695,462
国債証券	26,508,284,822
未収入金	602,556,704
未収利息	268,118,667
前払費用	24,637,405
流動資産合計	27,666,186,384
資産合計	27,666,186,384
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	511,697
未払金	726,886,681
未払解約金	376,165
未払利息	140
その他未払費用	131,000
流動負債合計	727,905,683
負債合計	727,905,683
純資産の部	
元本等	
元本	12,694,661,375
剰余金	

(2021年 9月 6日現在)

期末剰余金又は期末欠損金（△）	14,243,619,326
元本等合計	26,938,280,701
純資産合計	26,938,280,701
負債純資産合計	27,666,186,384

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 9月 6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	2.1220円
(10,000口当たり純資産額)	(21,220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 9月 8日 至 2021年 9月 6日	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

○市場リスクの管理

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

○信用リスクの管理

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

○流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2021年 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2020年 9月 8日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	10,502,758,252円
同期中における追加設定元本額	4,871,700,396円
同期中における一部解約元本額	2,679,797,273円
期末元本額	12,694,661,375円
期末元本額の内訳※	
野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型	628,345,729円
ネクストコア	33,544,890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	908,665,498円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	4,255,859円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	3,756,336円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	21,023,835円

インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	5,183,870円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	12,859,945円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	870,910,731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）	1,356,296,604円
NEXT FUNDS 新興国債券・J. P. モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（為替ヘッジなし）連動型上場投信	659,625,810円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	779,843,787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）	5,544,233円
ノムラ新興国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,140,805円
新興国債券・インデックスF（適格機関投資家専用）	1,455,392,515円
野村新興国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	4,991,290,582円
野村DC運用戦略ファンド	764,344,393円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	81,422,432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）	110,213,521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9月6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9月6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	BRAZIL GLOBAL	650,000.00	805,636.00	
		BRAZIL GLOBAL	1,070,000.00	1,472,041.80	
		BRAZIL GLOBAL	1,200,000.00	1,503,498.00	
		CROATIA	1,100,000.00	1,185,527.20	
		CROATIA	1,100,000.00	1,237,837.70	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,400,000.00	2,482,032.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	300,000.00	350,812.50	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,400,000.00	2,595,156.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,500,000.00	1,592,760.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,100,000.00	2,109,807.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,200,000.00	1,278,000.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,800,000.00	1,777,428.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	3,400,000.00	3,618,994.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,600,000.00	1,516,000.00	
		HUNGARY	700,000.00	750,900.50	
		HUNGARY	1,250,000.00	1,393,700.00	
		HUNGARY	1,400,000.00	1,568,452.20	
		INDONESIA GLOBAL	900,000.00	1,011,123.18	

MEXICO GLOBAL	2,000,000.00	1,870,280.00	
PANAMA GLOBAL	700,000.00	868,910.00	
PANAMA GLOBAL	1,550,000.00	2,132,590.75	
PHILIPPINES GLOBAL	300,000.00	327,112.44	
PHILIPPINES GLOBAL	1,750,000.00	2,777,278.87	
PHILIPPINES GLOBAL	1,000,000.00	1,484,355.70	
REPUBLIC OF ARGENTINA	3,975,113.00	1,669,587.21	
REPUBLIC OF ARGENTINA	10,365,309.00	4,140,837.29	
REPUBLIC OF ARGENTINA	14,537,686.00	5,197,368.12	
REPUBLIC OF ARGENTINA	6,886,159.00	2,902,722.60	
REPUBLIC OF ARGENTINA	6,100,000.00	2,433,107.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,000,000.00	360,120.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000.00	1,522,031.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,700,000.00	1,854,615.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	900,000.00	884,875.50	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000.00	1,370,516.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,720,000.00	2,013,027.80	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,700,000.00	1,902,453.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,500,000.00	2,624,650.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,200,000.00	1,291,512.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,100,000.00	1,027,851.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,200,000.00	1,052,892.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	800,000.00	1,361,695.20	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,435,558.54	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000.00	2,179,835.23	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,100,000.00	1,257,080.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	662,221.62	
REPUBLIC OF INDONESIA	300,000.00	342,133.74	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,422,774.48	
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	767,282.95	
REPUBLIC OF INDONESIA	300,000.00	316,139.01	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	908,824.08	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,750,000.00	2,691,105.02	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,525,062.72	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000.00	2,862,904.99	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	1,014,177.60	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000.00	2,676,932.61	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,500,000.00	1,754,556.30	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000.00	2,523,852.46	
REPUBLIC OF INDONESIA	500,000.00	583,264.95	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,205,127.70	
REPUBLIC OF PANAMA	700,000.00	758,275.00	

REPUBLIC OF PANAMA	1,300,000.00	1,440,107.50
REPUBLIC OF PANAMA	1,900,000.00	2,019,871.00
REPUBLIC OF PANAMA	700,000.00	685,013.00
REPUBLIC OF PANAMA	1,000,000.00	1,153,990.00
REPUBLIC OF PANAMA	2,200,000.00	2,529,758.00
REPUBLIC OF PERU	800,000.00	829,336.00
REPUBLIC OF PERU	700,000.00	789,663.00
REPUBLIC OF PERU	500,000.00	513,180.00
REPUBLIC OF PERU	2,600,000.00	2,655,484.00
REPUBLIC OF PERU	600,000.00	564,984.00
REPUBLIC OF PERU	2,000,000.00	2,783,460.00
REPUBLIC OF PERU	1,100,000.00	986,392.00
REPUBLIC OF PHILIPPINES	500,000.00	541,720.55
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,200,000.00	1,371,346.80
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,700,000.00	1,795,246.41
REPUBLIC OF PHILIPPINES	500,000.00	492,047.70
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,000,000.00	1,425,864.90
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	1,024,109.28
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,100,000.00	1,254,651.64
REPUBLIC OF PHILIPPINES	2,000,000.00	2,215,189.80
REPUBLIC OF PHILIPPINES	600,000.00	604,318.98
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,200,000.00	1,157,090.16
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	350,000.00	363,709.50
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,150,000.00	1,304,870.50
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	900,000.00	982,679.40
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,500,000.00	1,555,150.50
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	850,900.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,300,000.00	1,484,563.60
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	900,000.00	908,775.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	759,710.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000.00	1,826,375.40
REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000.00	1,770,087.60
REPUBLIC OF TURKEY	2,000,000.00	2,115,800.00
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	414,964.00
REPUBLIC OF TURKEY	1,500,000.00	1,494,003.00
REPUBLIC OF TURKEY	2,900,000.00	3,066,750.00
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,292,873.40
REPUBLIC OF TURKEY	2,300,000.00	2,379,005.00
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	1,089,084.70
REPUBLIC OF TURKEY	1,400,000.00	1,450,715.00
REPUBLIC OF TURKEY	2,700,000.00	3,006,722.70
REPUBLIC OF TURKEY	1,000,000.00	966,270.00
REPUBLIC OF TURKEY	1,800,000.00	1,792,249.20

REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000.00	1,187,724.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000.00	1,109,653.20	
REPUBLIC OF TURKEY	2,200,000.00	1,797,411.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,600,000.00	2,534,272.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,200,000.00	1,940,857.60	
ROMANIA	400,000.00	438,324.00	
ROMANIA	1,600,000.00	1,669,360.00	
ROMANIA	800,000.00	1,090,422.40	
ROMANIA	800,000.00	989,964.00	
ROMANIA	1,000,000.00	1,051,210.00	
RUSSIA	787,500.00	904,731.97	
RUSSIAN FEDERATION	1,000,000.00	1,023,750.00	
RUSSIAN FEDERATION	2,000,000.00	2,170,178.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,400,000.00	1,590,386.00	
RUSSIAN FEDERATION	3,600,000.00	4,051,936.80	
RUSSIAN FEDERATION	2,000,000.00	2,293,474.00	
RUSSIAN FEDERATION	2,800,000.00	3,422,115.20	
RUSSIAN FEDERATION	2,000,000.00	2,659,220.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,000,000.00	1,389,803.00	
RUSSIAN FEDERATION	4,400,000.00	5,707,495.20	
TURKEY GLOBAL	1,500,000.00	1,564,725.00	
TURKEY GLOBAL	3,200,000.00	3,491,424.00	
UKRAINE GOVERNMENT	600,000.00	670,932.00	
UKRAINE GOVERNMENT	2,000,000.00	2,431,000.00	
UKRAINE GOVERNMENT	1,600,000.00	1,720,209.60	
UKRAINE GOVERNMENT	1,700,000.00	1,812,698.10	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	755,409.90	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,323,450.00	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	200,000.00	222,035.44	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	780,640.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,587,742.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,315,188.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,359,840.00	
UNITED MEXICAN STATES	2,400,000.00	2,743,260.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,436,896.50	
UNITED MEXICAN STATES	2,200,000.00	2,520,111.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,362,972.00	
UNITED MEXICAN STATES	2,600,000.00	2,575,118.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,600,000.00	1,852,800.00	
UNITED MEXICAN STATES	2,010,000.00	2,570,729.70	
UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,865,682.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,866,183.50	

		UNITED MEXICAN STATES	2,000,000.00	2,175,060.00	
		UNITED MEXICAN STATES	2,400,000.00	2,792,088.00	
		UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,623,644.50	
	小計	銘柄数：148	243,701,767.00	241,357,414.39	
				(26,508,284,822)	
		組入時価比率：98.4%		100.0%	
合計				26,508,284,822	
				(26,508,284,822)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2021年 9月 6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	159,763,397	—	159,251,700	△511,697
米ドル	159,763,397	—	159,251,700	△511,697
合計	159,763,397	—	159,251,700	△511,697

(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。

①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。

②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-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2021年 9月 6日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	829,294,748
投資証券	45,765,699,840
派生商品評価勘定	24,364,640
未収入金	6,949,180
未収配当金	497,459,353
差入委託証拠金	52,587,480

(2021年 9月 6日現在)

流動資産合計	47,176,355,241
資産合計	47,176,355,241
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	388,100
未払金	7,235,152
未払解約金	62,589,139
未払利息	650
流動負債合計	70,213,041
負債合計	70,213,041
純資産の部	
元本等	
元本	16,447,427,958
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	30,658,714,242
元本等合計	47,106,142,200
純資産合計	47,106,142,200
負債純資産合計	47,176,355,241

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 9月 6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	2,8640円
(10,000口当たり純資産額)	(28,640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 9月 8日 至 2021年 9月 6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 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2020年 9月 8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	16,400,051,651円
同期中における追加設定元本額	4,650,471,442円
同期中における一部解約元本額	4,603,095,135円
期末元本額	16,447,427,958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）	1,654,792,425円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,137,240,256円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	797,914,457円
野村資産設計ファンド2015	13,874,073円
野村資産設計ファンド2020	13,940,352円
野村資産設計ファンド2025	17,631,717円
野村資産設計ファンド2030	18,263,613円
野村資産設計ファンド2035	19,171,559円
野村資産設計ファンド2040	35,078,620円
野村資産設計ファンド2045	3,644,656円
野村インデックスファンド・J-REIT	3,178,864,646円
ネクストコア	19,002,938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	1,017,828,787円
野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）	2,212,273,897円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	823,609,079円
野村資産設計ファンド2050	4,452,842円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	985,977円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	989,702円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	5,583,978円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	1,164,412円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	3,632,680円
野村6資産均等バランス	1,627,730,209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）	92,017,743円
野村資産設計ファンド2060	2,093,677円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	190,149,737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）	73,476,700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）	153,844,128円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,704,122,931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）	79,517,085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）	438,822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	450,792,633円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	37,345,971円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	7,323,042円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	3,313,677円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	7,603,342円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	3,912,839円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	4,233,891円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	1,710,301円

野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,066,712円
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	24,686,241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9月6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9月6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	779	107,502,000	
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,226	154,966,400	
		S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	1,624	306,611,200	
		東海道リート投資法人 投資証券	296	31,790,400	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	1,336	880,424,000	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,551	720,423,300	
		産業ファンド投資法人 投資証券	5,495	1,217,692,000	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,870	1,462,860,000	
		ケネディクス・レジデンシャル・ネ クスト投資法人 投資証券	2,643	610,004,400	
		アクティビア・プロパティーズ投資 法人 投資証券	1,990	916,395,000	
		G L P 投資法人 投資証券	12,535	2,527,056,000	
		コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	1,743	610,921,500	
		日本プロロジスリート投資法人 投 資証券	6,132	2,474,262,000	
		星野リゾート・リート投資法人 投 資証券	597	431,034,000	

Oneリート投資法人 投資証券	603	193,261,500	
イオンリート投資法人 投資証券	4,552	680,979,200	
ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,402	615,081,600	
日本リート投資法人 投資証券	1,194	526,554,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	8,608	195,659,840	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,384	1,054,158,400	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	809	113,421,800	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,545	463,191,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	826	124,808,600	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	877	105,941,600	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,516	2,142,739,200	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	641	59,997,600	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,738	945,231,000	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	4,000	230,000,000	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	363	47,298,900	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,439	935,350,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	625	51,062,500	
投資法人みらい 投資証券	4,412	237,806,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	908	122,761,600	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	984	516,600,000	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,328	296,409,600	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	562	64,180,400	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,526	167,860,000	

伊藤忠アドバンス・ロジスティクス 投資法人 投資証券	1,509	248,985,000	
日本ビルファンド投資法人 投資証 券	4,386	3,236,868,000	
ジャパンリアルエステイト投資法 人 投資証券	3,870	2,689,650,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証 券	19,528	2,191,041,600	
オリックス不動産投資法人 投資証 券	7,712	1,512,323,200	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,544	1,049,400,000	
N T T都市開発リート投資法人	3,496	553,067,200	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,595	497,461,500	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,688	334,118,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,713	1,370,554,900	
森トラスト総合リート投資法人 投 資証券	2,766	427,900,200	
インヴィンシブル投資法人 投資証 券	17,035	744,429,500	
フロンティア不動産投資法人 投資 証券	1,357	648,646,000	
平和不動産リート投資法人 投資証 券	2,507	417,415,500	
日本ロジスティクスファンド投資法 人 投資証券	2,529	883,885,500	
福岡リート投資法人 投資証券	2,002	352,352,000	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,197	948,024,000	
いちごオフィスリート投資法人 投 資証券	3,171	303,147,600	
大和証券オフィス投資法人 投資証 券	818	638,858,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,748	295,586,800	
スターツプロシード投資法人 投資 証券	603	161,724,600	
大和ハウスリート投資法人 投資証 券	5,811	1,981,551,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法	11,857	795,604,700	

		人 投資証券			
		大和証券リビング投資法人 投資証券	5,062	622,626,000	
		ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,591	518,181,300	
	小計	銘柄数：62	231,754	45,765,699,840	
		組入時価比率：97.2%		100.0%	
合計				45,765,699,840	

(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 9月 6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	1,311,762,480	—	1,335,807,000	23,976,540
合計	1,311,762,480	—	1,335,807,000	23,976,540

(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インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2021年 9月 6日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	61,634,687
コール・ローン	70,090,042
投資証券	7,203,374,795
派生商品評価勘定	25,672,405
未収入金	3,946,983
未収配当金	6,602,596
差入委託証拠金	64,356,500
流動資産合計	7,435,678,008
資産合計	7,435,678,008

(2021年 9月 6日現在)

負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,591,730
未払金	38,969,248
未払解約金	4,389,895
未払利息	54
その他未払費用	475,300
流動負債合計	54,426,227
負債合計	54,426,227
純資産の部	
元本等	
元本	4,017,291,831
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,363,959,950
元本等合計	7,381,251,781
純資産合計	7,381,251,781
負債純資産合計	7,435,678,008

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。 配当株式 配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価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 9月 6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	1.8374円
(10,000口当たり純資産額)	(18,374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 9月 8日 至 2021年 9月 6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効率的な運用に資することを目的として、REIT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REIT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、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2021年 9月 6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 9月 6日現在

期首	2020年 9月 8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	4,523,883,866円
同期中における追加設定元本額	1,371,228,924円
同期中における一部解約元本額	1,877,820,959円
期末元本額	4,017,291,831円
期末元本額の内訳＊	
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,605,263,780円
野村インデックスファンド・外国REIT・為替ヘッジ型	425,601,704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）	1,549,373,845円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	66,824,438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）	186,103,978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）	96,859,186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）	87,264,900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9月6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9月6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	3,800	81,206.00	
		AGREE REALTY CORP	2,700	201,447.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	2,900	66,381.00	
		ALEXANDERS INC	90	23,214.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,620	1,171,320.40	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,000	79,580.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	5,500	285,945.00	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	4,400	37,488.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	11,290	479,937.90	
		AMERICOLD REALTY TRUST	10,140	382,075.20	
		APARTMENT INCOME REIT CO	6,500	340,015.00	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	6,800	50,388.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	8,100	122,553.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	2,700	36,855.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,710	1,329,573.50	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1,300	14,183.00	
		BOSTON PROPERTIES	5,850	666,198.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	6,800	95,200.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,300	290,649.00	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	6,300	175,266.00	
		BRT APARTMENTS CORP	500	10,260.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,940	604,553.60	
		CARETRUST REIT INC ACQUIRES	4,000	89,280.00	
		CENTERSPACE	580	60,853.60	
		CHATHAM LODGING TRUST	2,000	23,780.00	
		CIM COMMERCIAL TRUST CORP	1,200	8,400.00	
		CITY OFFICE REIT INC	1,800	29,358.00	
		CLIPPER REALTY INC	790	6,849.30	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	4,400	72,776.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1,040	51,552.80	
		COREPOINT LODGING INC	1,800	25,668.00	
		CORESITE REALTY CORP	1,710	263,989.80	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4,500	127,395.00	
		COUSINS PROPERTIES INC	6,130	239,376.50	
		CTO REALTY GROWTH INC	260	14,775.80	

CUBESMART	8,300	455,255.00	
CYRUSONE INC	5,040	406,728.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	8,900	79,032.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	11,510	1,929,076.00	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	19,700	134,945.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	10,600	39,432.00	
DOUGLAS EMMETT INC	6,720	224,649.60	
DUKE REALTY CORP	15,430	827,356.60	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	22,000	0.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	3,300	71,676.00	
EASTGROUP PROPERTIES	1,600	295,232.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	5,600	56,784.00	
EPR PROPERTIES	2,940	152,292.00	
EQUINIX INC	3,659	3,230,274.97	
EQUITY COMMONWEALTH	4,800	127,104.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,840	602,809.20	
EQUITY RESIDENTIAL	14,090	1,205,963.10	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	4,700	153,596.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,669	895,663.02	
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,480	1,061,530.80	
FARMLAND PARTNERS INC	1,500	18,810.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,840	348,922.40	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	5,160	292,520.40	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,100	89,900.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	4,000	17,720.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	9,010	462,483.30	
GEO GROUP INC/THE	4,900	38,759.00	
GETTY REALTY CORP	1,700	54,009.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1,700	38,573.00	
GLADSTONE LAND CORP	1,200	28,632.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	2,500	39,725.00	
GLOBAL NET LEASE INC	3,800	65,550.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,900	182,546.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	9,000	281,520.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	22,170	805,879.50	

HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,700	15,912.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	4,270	197,530.20	
HOST HOTELS & RESORTS INC	29,100	470,547.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	6,300	172,305.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4,300	89,999.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	2,500	69,600.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	950	239,476.00	
INVITATION HOMES INC	23,260	975,757.00	
IRON MOUNTAIN INC	11,640	574,783.20	
JBG SMITH PROPERTIES	4,700	143,350.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	27,000	20,520.00	
KILROY REALTY CORP	4,390	292,286.20	
KIMCO REALTY CORP	24,300	537,759.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	3,700	76,886.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	11,300	157,748.00	
LIFE STORAGE INC	3,160	407,924.40	
LTC PROPERTIES INC	1,770	61,188.90	
MACERICH CO /THE	7,100	122,617.00	
MACK-CALI REALTY CORP	3,800	67,982.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	56,301	41,099.73	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	23,700	513,105.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,700	921,858.00	
MONMOUTH REIT-CLASS A	3,900	74,100.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	7,040	334,188.80	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3,240	190,414.80	
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,950	119,613.00	
NETSTREIT CORP	1,200	31,332.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	3,200	28,032.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	940	63,055.20	
OFFICE PROPERTIES INCOME	2,100	55,986.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9,670	327,039.40	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	760	24,266.80	
PARAMOUNT GROUP INC	6,600	58,146.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	9,700	181,196.00	

PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	5,400	117,450.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	3,000	6,270.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	8,700	164,604.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	4,800	85,728.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	1,400	33,068.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	2,100	26,754.00	
PRIME US REIT	21,000	17,850.00	
PROLOGIS INC	30,320	4,214,176.80	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	780	124,714.20	
PUBLIC STORAGE	6,224	2,058,650.24	
REALTY INCOME CORP	15,310	1,106,913.00	
REGENCY CENTERS CORP	6,510	451,403.40	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	4,800	87,504.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	8,800	118,448.00	
RETAIL VALUE INC	714	18,449.76	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	5,370	340,672.80	
RLJ LODGING TRUST	7,000	100,800.00	
RPT REALTY	3,300	42,999.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,250	185,557.50	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	8,900	145,960.00	
SAFEHOLD INC	630	53,442.90	
SAUL CENTERS INC	600	27,282.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	1,900	29,925.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	6,700	75,710.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	13,440	1,824,480.00	
SITE CENTERS CORP	7,000	113,120.00	
SL GREEN REALTY CORP	2,750	193,050.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	4,740	246,243.00	
STAG INDUSTRIAL INC	6,590	285,149.30	
STORE CAPITAL CORP	9,760	351,945.60	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,900	44,835.00	
SUN COMMUNITIES INC	4,590	959,906.70	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	9,200	108,560.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	4,100	71,422.00	

小計	TERRENO REALTY CORP	2,820	195,313.20	
	UDR INC	12,200	675,514.00	
	UMH PROPERTIES INC	1,900	47,462.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	580	33,587.80	
	URBAN EDGE PROPERTIES	4,400	83,556.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	1,300	24,908.00	
	VENTAS INC	15,400	867,174.00	
	VEREIT INC	9,220	466,808.60	
	VICI PROPERTIES INC	22,100	707,863.00	
	VORNADO REALTY TRUST	6,270	262,462.20	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	3,400	87,006.00	
	WELLTOWER INC	17,090	1,482,557.50	
	WHITESTONE REIT	1,900	18,658.00	
	WP CAREY INC	7,340	582,135.40	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	4,500	77,130.00	
	銘柄数：153	1,032,047	49,376,076.42	
			(5,422,974,473)	
	組入時価比率：73.5%		75.2%	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2,480	107,185.60	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2,800	32,144.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST	900	11,700.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	960	46,089.60	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,450	214,417.50	
	CHOICE PROPERTIES REIT	6,700	102,108.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	3,700	39,923.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	1,900	34,865.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2,200	39,490.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	3,600	60,660.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,100	25,718.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	4,200	76,104.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,240	114,117.20	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	5,700	93,936.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	2,800	49,532.00	

小計	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,300	50,025.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	700	16,415.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	900	16,065.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	3,600	48,204.00	
	PLAZA RETAIL REIT	2,000	9,160.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	6,400	144,384.00	
	SLATE GROCERY REIT	906	12,357.84	
	SLATE OFFICE REIT	1,400	7,462.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,900	88,798.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	3,600	77,688.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	1,600	11,984.00	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	1,800	48,924.00	
	銘柄数：27	71,836	1,579,456.74	
			(138,313,026)	
	組入時価比率：1.9%		1.9%	
ユーロ	AEDIFICA	1,440	176,112.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	7,100	116,582.00	
	ALTAREA	150	30,375.00	
	BEFIMMO S.C.A.	1,000	35,050.00	
	CARE PROPERTY INVEST	1,040	28,964.00	
	CARMILA	1,900	22,534.00	
	COFINIMMO	1,210	167,585.00	
	COVIVIO	1,990	154,503.60	
	CROMWELL REIT EUR	11,600	30,276.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	1,600	33,888.00	
	GECINA SA	2,240	288,064.00	
	HAMBORNER REIT AG	3,000	28,698.00	
	HIBERNIA REIT PLC	26,000	33,280.00	
	ICADE	1,250	89,375.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	2,600	10,348.00	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	10,600	93,068.00	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,000	25,700.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	19,000	29,830.00	
	KLEPIERRE	8,300	169,818.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	2,400	13,224.00	
	MERCIALYS	1,800	17,298.00	

小計	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	13,300	130,739.00	
	MONTEA	420	53,088.00	
	NSI NV	720	25,560.00	
	RETAIL ESTATES	450	30,960.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,580	391,381.20	
	VASTNED RETAIL NV	800	19,080.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	5,600	217,616.00	
	WERELDHAVE NV	1,700	22,593.00	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	690	35,880.00	
	銘柄数：30	136,480	2,521,469.80	
英ボンド			(328,875,306)	
	組入時価比率：4.5%		4.6%	
英ボンド	AEW UK REIT PLC	7,000	7,434.00	
	ASSURA PLC	113,000	88,366.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	6,500	102,245.00	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	32,000	30,304.00	
	BRITISH LAND	38,700	209,676.60	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	36,000	64,368.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	25,000	24,925.00	
	CUSTODIAN REIT PLC	20,000	19,320.00	
	DERWENT LONDON PLC	4,670	176,899.60	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	26,000	25,428.00	
	GCP STUDENT LIVING PLC	18,000	38,160.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	10,400	82,576.00	
	HAMMERSON PLC	164,000	59,187.60	
	HOME REIT PLC	10,000	11,350.00	
	HOME REIT PLC-ENT RTS	10,000	450.00	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	14,000	16,156.00	
	INTU PROPERTIES PLC	39,000	0.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	30,700	225,767.80	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	37,600	98,286.40	
	LXI REIT PLC	25,000	37,250.00	
	NEWRIVER REIT PLC	13,000	10,283.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	23,000	21,620.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	55,000	91,685.00	

小計	REGIONAL REIT LTD	20,000	18,220.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	8,500	101,065.00	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	25,000	13,250.00	
	SEGRO PLC	49,100	636,336.00	
	SHAFTESBURY PLC	12,400	81,716.00	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	19,000	13,243.00	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	32,000	37,920.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	15,000	15,810.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	70,000	166,600.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	30,000	24,000.00	
	UNITE GROUP PLC	16,000	197,280.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	5,200	49,660.00	
	銘柄数：35	1,060,770	2,796,838.00	
			(425,482,964)	
	組入時価比率：5.8%		5.9%	
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	16,000	55,360.00	
	APN INDUSTRIA REIT	7,000	26,110.00	
	ARENA REIT	14,000	62,300.00	
	AVENTUS GROUP	16,000	56,800.00	
	BWP TRUST	20,000	82,200.00	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	23,666	82,121.02	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	18,000	72,000.00	
	CENTURIA OFFICE REIT	15,000	38,850.00	
	CHARTER HALL GROUP	19,000	344,660.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	22,156	118,534.60	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	21,000	81,690.00	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	14,000	54,460.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	74,000	68,080.00	
	DEXUS/AU	44,200	470,288.00	
	GDI PROPERTY GROUP	22,000	25,960.00	
	GOODMAN GROUP	68,900	1,592,968.00	
	GPT GROUP	79,500	396,705.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	13,000	57,590.00	
	HOME CONSORTIUM	8,000	56,720.00	

小計	HOMECO DAILY NEEDS REIT	21,000	33,810.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	7,000	24,990.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	11,500	74,060.00	
	IRONGATE GROUP	22,000	33,440.00	
	MIRVAC GROUP	162,000	503,820.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	47,336	113,606.40	
	RURAL FUNDS GROUP	15,023	39,360.26	
	SCENTRE GROUP	209,000	606,100.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	42,000	114,660.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	97,600	454,816.00	
	VICINITY CENTRES	158,000	280,450.00	
	WAYPOINT REIT LTD	31,000	88,040.00	
	銘柄数：31	1,338,881	6,110,549.28	
			(498,865,243)	
	組入時価比率：6.8%		6.9%	
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	34,000	57,290.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	44,000	113,520.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	67,000	78,390.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	49,000	83,790.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	15,000	47,700.00	
小計	銘柄数：5	209,000	380,690.00	
			(29,895,585)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
香港ドル	CHAMPION REIT	78,000	340,860.00	
	FORTUNE REIT	61,000	508,740.00	
	LINK REIT	85,400	6,076,210.00	
	PROSPERITY REIT	56,000	175,280.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	43,000	211,130.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	65,000	261,950.00	
	銘柄数：6	388,400	7,574,170.00	
小計			(107,023,022)	
	組入時価比率：1.4%		1.5%	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	20,025	31,839.75	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	54,927	50,258.20	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	136,108	421,934.80	

小計	ASCOTT RESIDENCE TRUST	75,562	77,828.86	
	CAPITALAND CHINA TRUST	39,750	52,470.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	185,609	387,922.81	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	31,000	37,510.00	
	EC WORLD REIT	12,000	9,780.00	
	ESR REIT	118,495	56,877.60	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	47,000	29,375.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	55,440	14,691.60	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	52,566	125,632.74	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	31,000	15,810.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	116,019	177,509.07	
	IREIT GLOBAL	28,242	18,216.09	
	KEPPEL DC REIT	52,230	132,141.90	
	KEPPEL REIT	82,000	88,560.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	36,000	32,580.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	234,000	14,508.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	89,319	185,783.52	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	77,050	225,756.50	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	119,641	250,049.69	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	80,000	80,000.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	100,259	43,612.66	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	15,600	76,284.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	30,000	13,500.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	20,000	18,300.00	
	SPH REIT	40,000	37,800.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	55,000	35,200.00	
	SUNTEC REIT	92,000	134,320.00	
	銘柄数：30	2,126,842	2,876,052.79	
			(235,376,160)	
	組入時価比率：3.2%		3.3%	
ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	3,900	25,857,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	1,000	5,530,000.00	
	JR REIT XXVII	4,400	23,408,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	1,500	9,210,000.00	

小計	LOTTE REIT CO LTD	5,000	28,250,000.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	3,200	14,944,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	1,900	15,580,000.00	
	銘柄数：7	20,900	122,779,000.00	
			(11,651,727)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
新シェケル	REIT 1 LTD	7,500	143,475.00	
小計	銘柄数：1	7,500	143,475.00	
			(4,917,289)	
	組入時価比率：0.1%		0.1%	
合計			7,203,374,795	
			(7,203,374,795)	

(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 9月 6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	181,950,968	—	190,225,560	8,274,592
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	7,176,810,095	—	7,170,004,012	6,806,083
米ドル	5,408,801,165	—	5,391,948,600	16,852,565
カナダドル	138,443,380	—	139,029,400	△586,020
ユーロ	337,697,492	—	338,752,040	△1,054,548
英ポンド	419,737,823	—	421,953,140	△2,215,317
豪ドル	486,521,226	—	492,860,680	△6,339,454
ニュージーランドドル	31,243,139	—	31,639,530	△396,391
香港ドル	111,154,555	—	110,906,370	248,185
シンガポールドル	236,969,969	—	236,676,330	293,639
新シェケル	6,241,346	—	6,237,922	3,424

合計	—	—	—	15,080,675
----	---	---	---	------------

(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。

① 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。

② 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

2021年9月30日現在

I 資産総額	19,015,285,807円
II 負債総額	1,879,825,747円
III 純資産総額（I－II）	17,135,460,060円
IV 発行済口数	10,110,071,949口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.6949円

（参考）国内株式マザーファンド

2021年9月30日現在

I 資産総額	445,693,630,004円
II 負債総額	25,858,406,908円
III 純資産総額（I－II）	419,835,223,096円
IV 発行済口数	195,950,247,914口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.1426円

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

2021年9月30日現在

I 資産総額	176,109,881,735円
II 負債総額	88,435,889,243円
III 純資産総額（I－II）	87,673,992,492円
IV 発行済口数	31,564,045,132口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.7777円

（参考）国内債券NOMURA－BP I 総合 マザーファンド

2021年9月30日現在

I 資産総額	808,354,286,308円
II 負債総額	6,405,668,281円
III 純資産総額（I－II）	801,948,618,027円
IV 発行済口数	603,135,208,078口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3296円

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

2021年9月30日現在

I 資産総額	174,087,501,574円
II 負債総額	88,416,589,172円
III 純資産総額（I－II）	85,670,912,402円
IV 発行済口数	70,305,464,486口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.2186円

（参考）新興国債券マザーファンド

2021年9月30日現在

I 資産総額	26,908,714,694円
II 負債総額	136,211,364円
III 純資産総額（I－II）	26,772,503,330円
IV 発行済口数	12,759,591,676口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.0982円

（参考）J－REITインデックス マザーファンド

2021年9月30日現在

I 資産総額	46,808,506,442円
II 負債総額	1,907,798,327円
III 純資産総額（I－II）	44,900,708,115円
IV 発行済口数	16,324,782,138口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.7505円

（参考）海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

2021年9月30日現在

I 資産総額	14,243,177,208円
II 負債総額	7,225,236,455円
III 純資産総額（I－II）	7,017,940,753円
IV 発行済口数	4,051,562,669口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.7322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

① 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。

② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③ 上記①の振替について、委託者は、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た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り扱い

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10月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間に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。

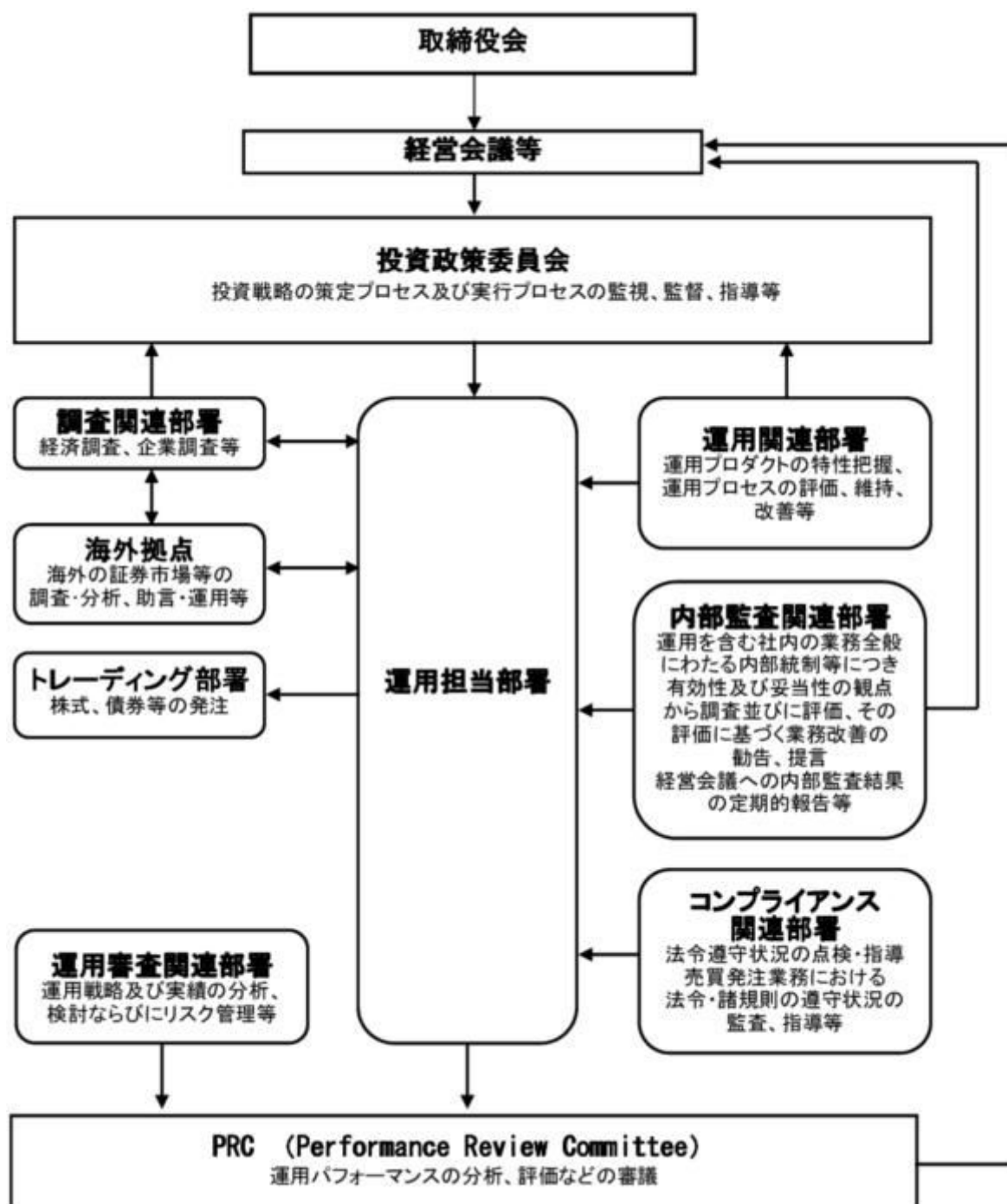
代表取締役・業務執行取締役

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9月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)。

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

追加型株式投資信託	989	39,313,559
単位型株式投資信託	198	820,184
追加型公社債投資信託	14	6,430,213
単位型公社債投資信託	506	1,591,773
合計	1,707	48,155,729

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 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。 ① 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。 ② 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 ソフトウェア 59 ア 合計 67	※ 2. 固定資産除却損 器具備品 2百万円 ソフトウェア 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

①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%

②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

①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%

②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

① 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。

② 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

① 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。

② 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出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1)	31,378	未払手数料	5,536
							コマーシャル・ペーパーの購入(*2)	20,000	有価証券	19,999
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 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(株)（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、
ニューヨーク証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

◇ 1株当たり情報

前事業年度 (自 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。

- ①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。)
- ②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。)
- ③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④⑤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。

④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。

⑤上記③④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9月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
今村証券株式会社	857百万円	
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
岡三証券株式会社 ^{※2}	5,000百万円	
岡三オンライン証券株式会社 ^{※3}	2,500百万円	
香川証券株式会社	555百万円	
a u カブコム証券株式会社	7,196百万円	
株式会社証券ジャパン	3,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
西日本シティ T T 証券株式会社	3,000百万円	

北洋証券株式会社	500百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
丸近証券株式会社	200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
八十二証券株式会社	3,000百万円	
山和証券株式会社	585百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社イオン銀行	51,250百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	
株式会社岩手銀行	12,089百万円	
株式会社七十七銀行	24,658百万円	
株式会社新生銀行	512,204百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社但馬銀行	5,481百万円	
株式会社筑波銀行	48,868百万円	
株式会社東京スター銀行	26,000百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
株式会社百五銀行	20,000百万円	
株式会社北洋銀行	121,101百万円	
株式会社北陸銀行	140,409百万円	
岡崎信用金庫	3,096百万円 ^{※1}	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

※2021年9月末現在

※1 岡崎信用金庫の資本金の額の箇所には、出資の総額を記載しております。

※2 岡三証券株式会社は、2022年1月1日より募集・販売等の事務を開始します。

※3 岡三オンライン証券株式会社は、2022年1月1日付をもって岡三証券株式会社と経営統合し、岡三証券株式会社（資本金：5,000百万円）となる予定です。

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

委託会社は、丸近証券株式会社の株式の10.9%を保有しています。

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11月26日	有価証券届出書
2020年11月26日	有価証券報告書
2021年 5月25日	有価証券届出書の訂正届出書
2021年 5月25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10月22日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

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・為替ヘッジ型の2020年9月8日から2021年9月6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・為替ヘッジ型の2021年9月6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。