

【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】	2022年5月12日提出
【計算期間】	第9期(自 2021年2月18日至 2022年2月17日)
【ファンド名】	野村D C運用戦略ファンド(マイルド)
【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】

「確定拠出年金法」に基づいて、個人又は事業主が拠出した資金を運用するためのファンドです。

受益権の申込みを行なう投資者は、確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会（以下「連合会」といいます。）等に限るものとします。

国内および外国（新興国を含む）の株式、国内および外国（新興国を含む）の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象とし、為替予約取引等を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に運用を行なうことを基本とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「J-REITインデックスマザーファンド」、「海外REITインデックスマザーファンド」、「野村マネー 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5,000億円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

< 商品分類 >

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

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

（野村DC運用戦略ファンド（マイルド））

《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
---------	--------	-------------------

単位型	国内	株式
	海外	債券
		不動産投信
追加型	内外	その他資産 ()
		資産複合

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式	年1回	グローバル (日本を含む)		
一般				
大型株	年2回			
中小型株	年4回	日本		
債券		北米	ファミリーファンド	あり (適時ヘッジ)
一般	年6回 (隔月)	欧州		
公債		アジア		
社債	年12回 (毎月)	オセアニア		
その他債券 クレジット属性 ()	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
不動産投信	その他 ()	アフリカ		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券、 不動産投信) 資産配分変更型))		中近東 (中東)		
資産複合 ()		エマージング		
資産配分固定型				
資産配分変更型				

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ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。

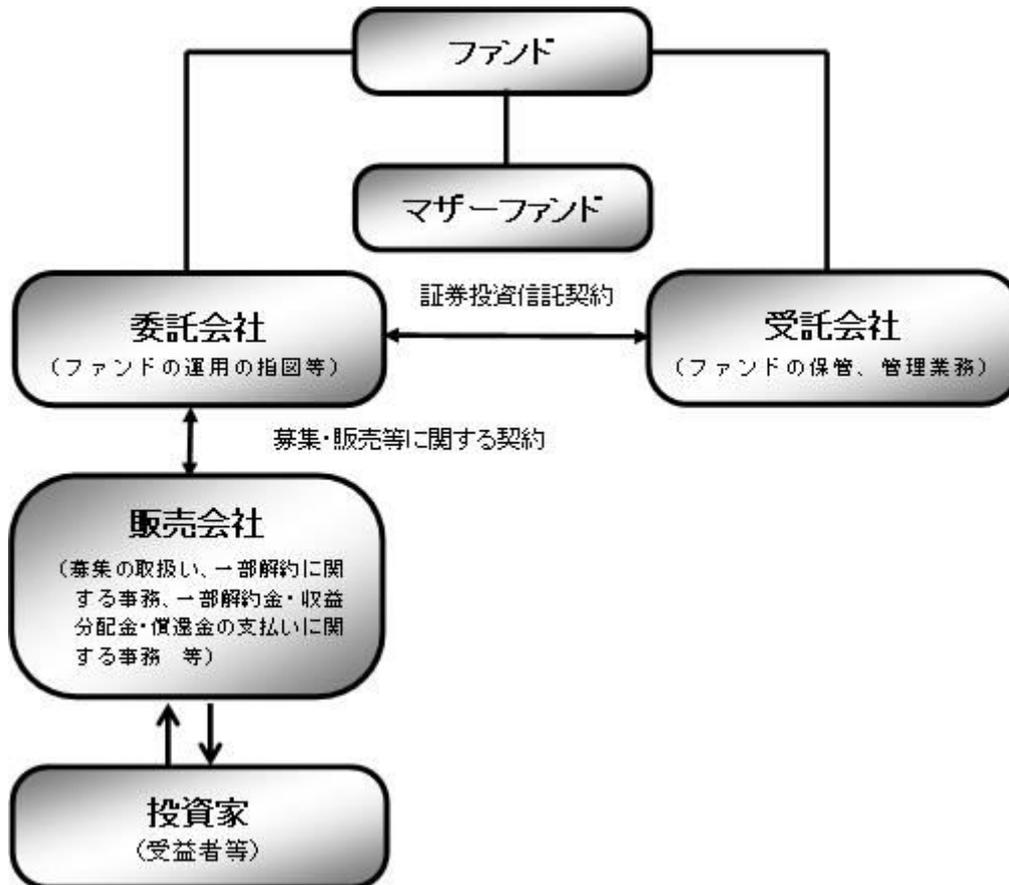
[特殊型]

- (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】

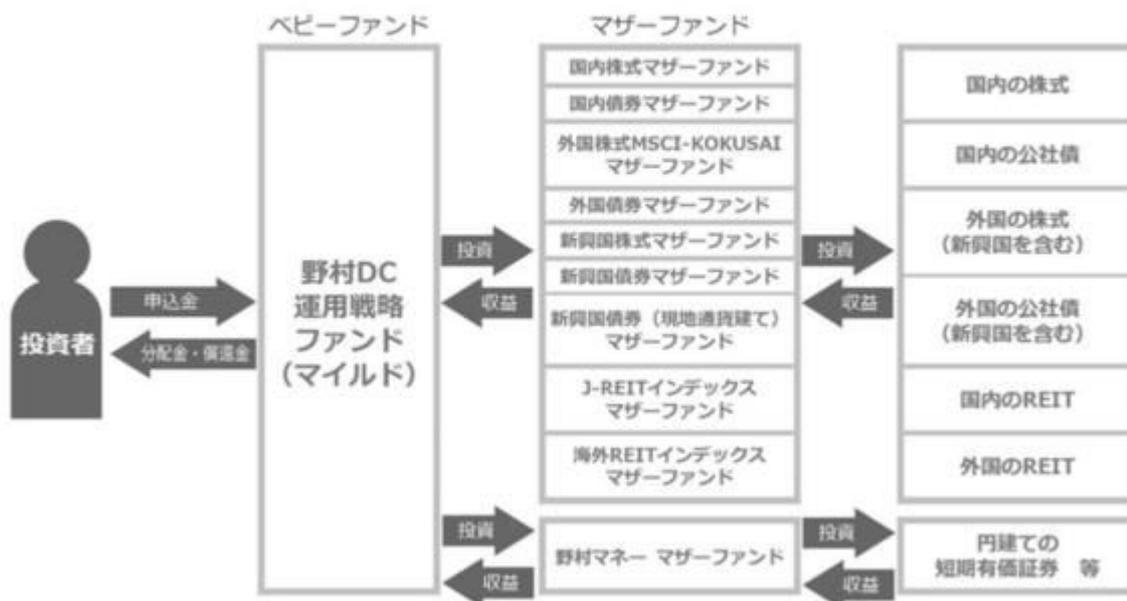
2013年3月29日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始
2016年11月10日 「野村DC運用戦略ファンドM」から「野村DC運用戦略ファンド（マイルド）」へ名称を変更

(3) 【ファンドの仕組み】



ファンド	野村DC運用戦略ファンド（マイルド）
マザーファンド （親投資信託）	国内株式マザーファンド 国内債券マザーファンド 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド 外国債券マザーファンド 新興国株式マザーファンド 新興国債券マザーファンド 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド J-REITインデックス マザーファンド 海外REITインデックス マザーファンド 野村マネー 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。



※ファンドは、各マザーファンドへの投資を行なうと共に、為替予約取引等を活用します。

委託会社の概況(2022年3月末現在)

- ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

- ・資本金の額

17,180百万円

- ・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

- ・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

[1] 運用にあたっては、世界の様々な指標の動きを計量的なアプローチを用いて分析し、リスク水準¹を一定範囲内程度に抑えつつ効率的に収益を獲得することを目指して、各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジション²を決定します。

- 1 リスク水準とは、推定されるポートフォリオの価格の変動の大きさのことです。ファンドでは、推定される基準価額の「振れ幅」（上下変動の程度）を表しています。リスク水準の調整にあたっては、基準価額の目標変動リスク値を、当年度率3%程度以下となることを目指して、リスク水準の異なる資産の配分比率や実質的な外貨のエクスポージャーを変更します。

基準価額の変動の方向は、上昇することも下落することもあり得ます。変動リスクの大きさは、必ずしもファンドの運用成績の良さを意味するものではありません。実際の運用成績は、マイナスとなる可能性があります。

ファンドで組入れる各資産と為替の過去の価格の変動リスク等の統計値から、それらを組み合わせた将来の価格の変動リスク値を推定し、資産配分と通貨配分により目標変動リスク値を調整します。ただし、目標変動リスク値はあくまでも推定に基づく統計的な目安ですので、実際の基準価額の変動リスクは、推定値からはずれる場合があります。したがって、基準価額が目標変動リスク値で示される範囲より小さくしか値動きをしない場合もあれば、目標変動リスク値で示される範囲を超えて大きく値下がりする場合もあります。

変動リスク値は、「ボラティリティ」や「標準偏差」と呼ばれることもあります。

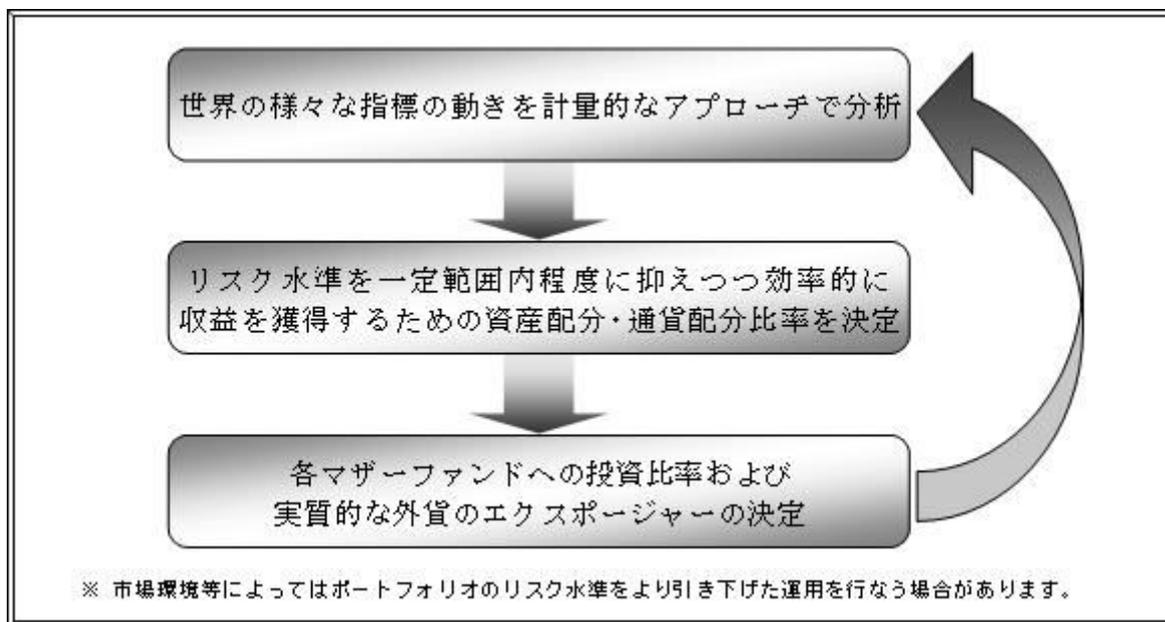
- 2 マザーファンドを通じて実質的に投資を行なう内外の株式およびREITへの投資比率、ファンドが投資する外貨建資産と為替予約取引等を加味した実質的な外貨のエクスポージャーは、原則として、以下の範囲内となります。

実質的な内外の株式 およびREITへの投資比率	実質的な外貨の エクスポージャー
純資産総額の30%以内	純資産総額の30%以内

各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジションは適宜見直しを行ないます。

一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

運用プロセスについて



各マザーファンド（「野村マネー マザーファンド」を除く）は、各々以下の指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

「野村マネー マザーファンド」は、円建ての短期有価証券等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。

マザーファンド名	主要投資対象	対象指数
国内株式マザーファンド	わが国の株式	東証株価指数（TOPIX）
国内債券マザーファンド	わが国の公社債	NOMURA-BPI 国債指数
外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSAI 指数（円ベース・為替ヘッジなし）*1
外国債券マザーファンド	外国の公社債	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証券）*1を含みます。）	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）*2
新興国債券マザーファンド	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（円換算ベース）*3
新興国債券（現地通貨建て） マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債	JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）*4
J-REIT インデックス マザーファンド	J-REIT*2	東証 REIT 指数（配当込み）
海外 REIT インデックス マザーファンド	日本を除く世界各国の REIT*3	S&P 先進国 REIT 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）*5

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

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

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

*1 MSCI-KOKUSAI 指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

*2 MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。

*3 JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus (USドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。

*4 JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。

*5 S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。

内外の株式およびREITをそれぞれ主な投資対象とする「国内株式マザーファンド」、「外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」への投資比率の合計は、原則として、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

[2] 為替予約取引等の利用については、外貨建資産の為替変動リスクを回避する目的（ヘッジ目的。代替ヘッジを含みます。）のほか、効率的に収益を獲得する目的（ヘッジ目的外）で活用します。

為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額は信託財産の純資産総額の100%以内とします。

実質的な外貨のエクスポージャーは、原則として、信託財産の純資産総額の30%以内となるように調整を行いません。

各マザーファンド（「野村マネー マザーファンド」を除く）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)、東証REIT指数(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)、東証REIT指数(配当込み)の指数値及び東証株価指数(TOPIX)、東証REIT指数(配当込み)に係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)、東証REIT指数(配当込み)に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数(TOPIX)、東証REIT指数(配当込み)に係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有する。

J P Xは、東証株価指数(TOPIX)、東証REIT指数(配当込み)の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)、東証REIT指数(配当込み)の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証株価指数(TOPIX)、東証REIT指数(配当込み)に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。

J P Xは、東証株価指数(TOPIX)、東証REIT指数(配当込み)の指数値及び東証株価指数(TOPIX)、東証REIT指数(配当込み)に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の東証株価指数(TOPIX)、東証REIT指数(配当込み)の指数値について、何ら保証、言及をするものではない。

J P Xは、東証株価指数(TOPIX)、東証REIT指数(配当込み)の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、J P Xは、東証株価指数(TOPIX)、東証REIT指数(配当込み)の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。

本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではない。

J P Xは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。

J P Xは、当社又は本件商品の購入者のニーズを東証株価指数(TOPIX)、東証REIT指数(配当込み)の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。

以上の項目に限らず、J P Xは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

NOMURA - BPI 国債指数

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権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せん。また、野村證券株式会社は、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

MSCI - KOKUSAI 指数

MSCI エマージング・マーケット・インデックス

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

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

は、本ファンドの所有者に対し、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源から本件指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本件指数またはそれに含まれるいかなるデータの獨創性、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。

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により運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

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

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

ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー(以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。)は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引(以下「該当商品」といいます。)を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、

マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できると思われる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。

本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。

JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・イー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド(英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員)及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。

当情報に関して追加に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。

S&P先進国REIT指数

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

国内および外国(新興国を含む)の株式、国内および外国(新興国を含む)の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券(REIT)を実質的な主要投資対象とし、為替予約取引等を主要取引対象とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券マザー

ファンド」、「新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」および「野村マネー マザーファンド」の各受益証券への投資を通じて、実質的に国内および外国(新興国を含む)の株式、国内および外国(新興国を含む)の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券(REIT)に投資を行ないます。

投資の対象とする資産の種類(信託約款)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲等(信託約款)

委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である国内株式マザーファンド、国内債券マザーファンド、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド、外国債券マザーファンド、新興国株式マザーファンド、新興国債券マザーファンド、新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド、J-REITインデックス マザーファンド、海外REITインデックス マザーファンドおよび野村マネー マザーファンド(以下「各マザーファンド」といいます。)の受益証券のほか、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券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みません。)
6. 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
9. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

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

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

金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(上記 に掲げるものを除く。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
7. 日本の会社に類似した性質を有しない外国の者が発行する債務証券または証書(上記 に定める証券または証書を除きます。)
8. 流動性のあるプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの(上記 第13号に定める証券または証書を除きます。なお、上記 第13号に定める証券または証書を含め、「優先証券」といいます。)
9. リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティ・カンパニー、またはこれらと類

似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するものであって、流動性のある前各号および上記 各号以外のもの

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

(参考)各マザーファンドの概要

(国内株式マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

（国内債券マザーファンド） 運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI 国債指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主としてわが国の国債に投資することにより、NOMURA-BPI 国債指数の動きに連動する投資成果を目指します。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポー

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

(外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

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。

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

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

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

（外国債券マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

（新興国株式マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

この投資信託は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期

的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

（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

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。

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。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

（新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド）

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

(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いません。

2.運用方法

(1)投資対象

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

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

(2)投資態度

J-REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への直接投資は行いません。

株式への直接投資は行いません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行いません。

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

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

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

(海外REITインデックス マザーファンド)
運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

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

2.運用方法

(1)投資対象

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

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

(2)投資態度

REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないません。

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

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

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

(野村マネー 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、本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。

2.運用方法

(1)投資対象

本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行なうことで流動性の確保を図ります。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

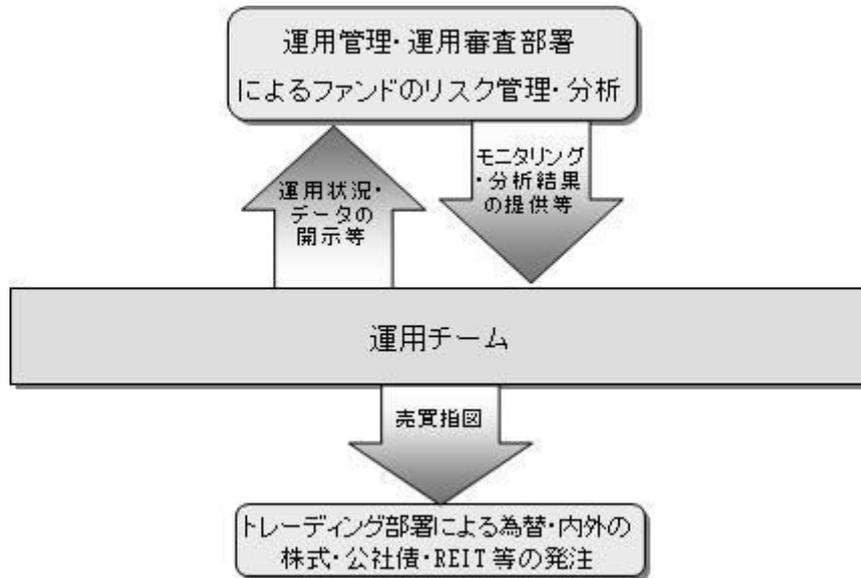
スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

(3)【運用体制】

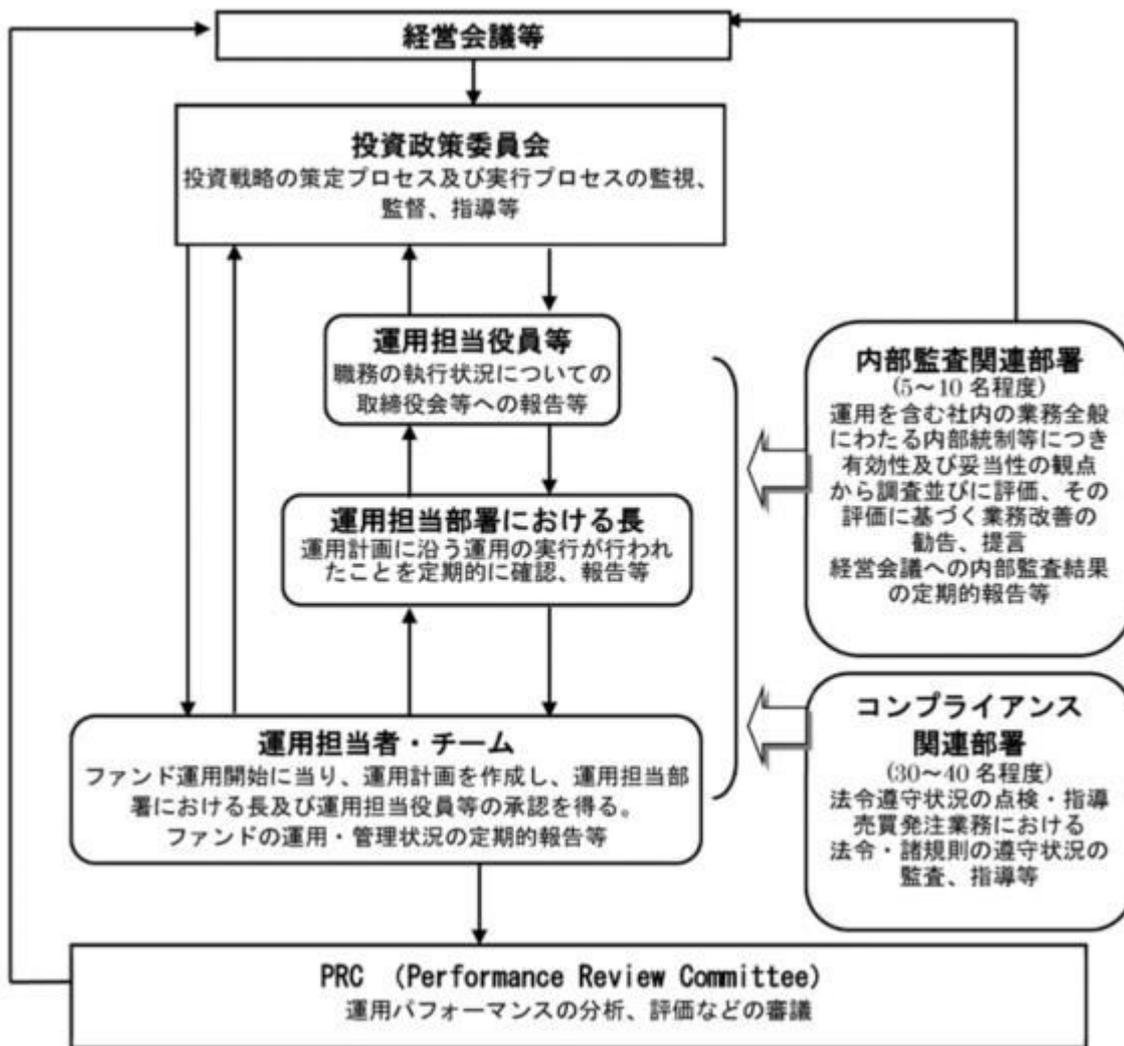
ファンドの運用体制は以下の通りです。



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

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

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

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

ないます。

* 委託会社の判断により分配を行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2月17日（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

（５）【投資制限】

運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限(信託約款)

- ・ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 外国為替予約取引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。

投資する株式等の範囲(信託約款)

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

信用取引の指図範囲(信託約款)

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

先物取引等の運用指図(信託約款)

- () 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)
- () 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- () 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図(信託約款)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

- () 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- ()上記()に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ()委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

公社債の借入れ(信託約款)

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

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

直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

資金の借入れ(信託約款)

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

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

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

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

3【投資リスク】

基準価額の変動要因

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

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

[株価変動リスク]

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

[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、為替変動リスクの低減を図る目的（ヘッジ目的）のほか、効率的に収益を追求する目的（ヘッジ目的外）で為替予約取引等を活用しますので、為替変動の影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいものになることも想定されます。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

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

ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け付けが中止等となる可能性、換金代金の支払いが遅延する可能性等があります。

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

ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが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。

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。

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

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

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

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

パフォーマンスの考査

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

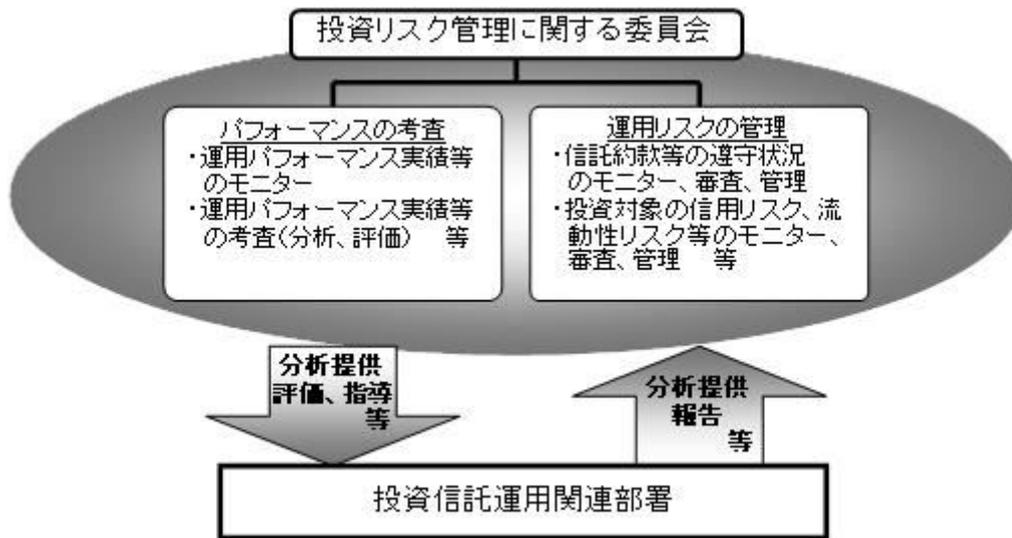
運用リスクの管理

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

流動性リスク管理について

流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。リスク管理関連の委員会が、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について監督します。

リスク管理体制図

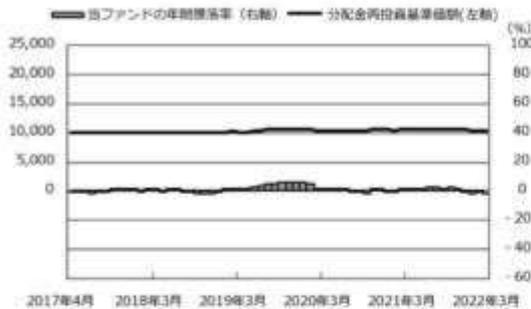


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

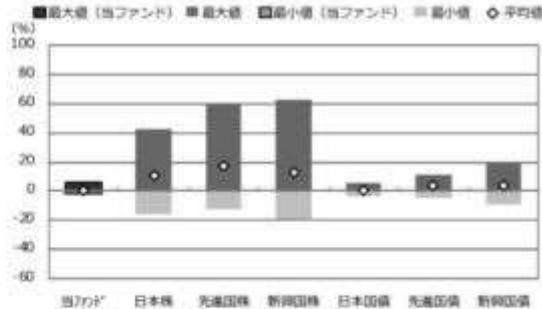


投資リスク

■ リスクの定量的比較（2017年4月末～2022年3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

2017年4月 2018年3月 2019年3月 2020年3月 2021年3月 2022年3月

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 (%)	6.5	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 2.1	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	0.9	10.1	17.3	12.9	0.1	3.7	3.7

＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2017年4月末を10,000として指数化しております。
＊年間騰落率は、2017年4月から2022年3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。
＊2017年4月から2022年3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-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）
- 新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
- 日本国債：NOMURA-BPI 国債
- 先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
- 新興国債：JP モルガン・カバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）

■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る権利又は商標は、株式会社 J P X 証券又は株式会社 J P X 証券の関連会社（以下「J P X」という）の知的財産であり、指数の算出、指数の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る権利又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。
- MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的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・カバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・カバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスは法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国 JP 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せん。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推薦の可否について、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、NASDAQ、NYSE、SIPC の会員です。JP Morgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JP SI, JP Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

申込手数料はありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年0.66%（税抜年0.60%）以内（2022年5月12日現在年0.66%（税抜年0.60%））の率（「信託報酬率」といいます。）を乗じて得た額とします。

ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

信託報酬率の配分は下記の通り（税抜）とします。

< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
年0.30%	年0.25%	年0.05%

* 上記配分は、2022年5月12日現在の信託報酬率における配分です。

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	口座内でのファンドの管理および事務手続き、購入後の情報提供、各種書類の送付等	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

ファンドに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等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用はファンドから支払われます。また、ファンドが投資するマザーファンドに関する有価証券の貸付に係る事務の処理に要する費用が、ファンドから実質的に支払われます。

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。

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

なお、上記以外の受益者(法人)の場合の課税の取扱いは以下の通りです。

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金(解約)時および償還時の個別元本超過額については、15.315%(国税(所得税及び復興特別所得税)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。

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。

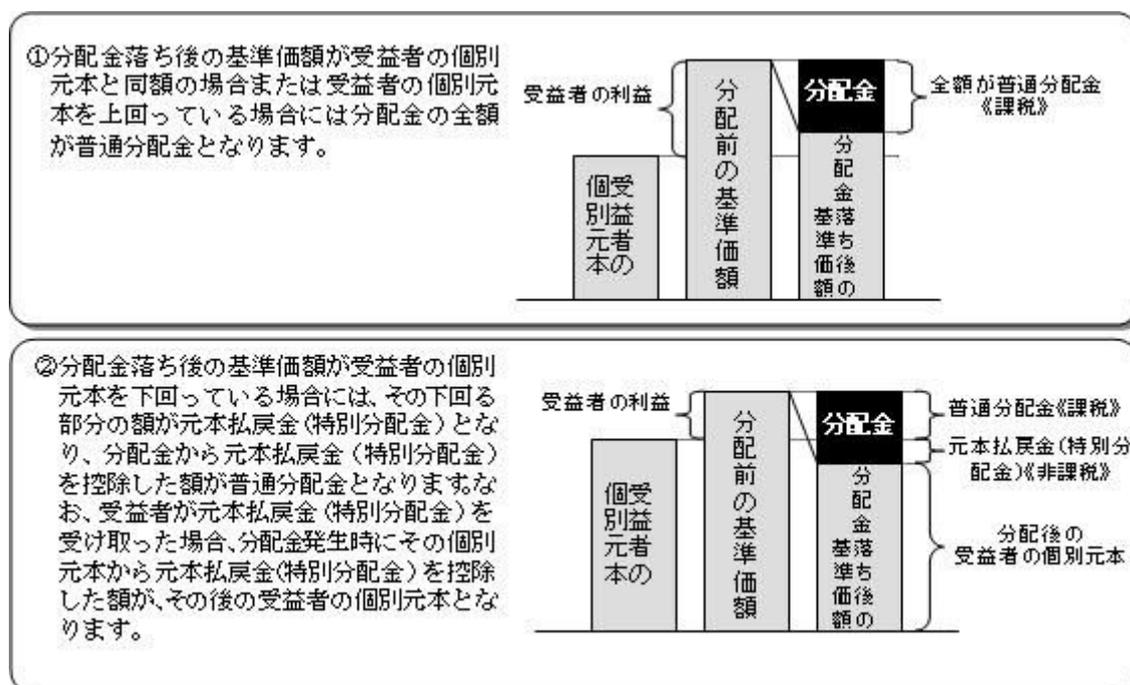
換金(解約)時および償還時の課税について

換金(解約)時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

分配金の課税について

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



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

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

* 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容(2022年3月末現在)が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は2022年3月31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DC運用戦略ファンド(マイルド)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,412,914,485	61.89
現金・預金・その他資産(負債控除後)		1,485,689,205	38.10
合計(純資産総額)		3,898,603,690	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	418,348,703,750	97.21
現金・預金・その他資産(負債控除後)		11,979,927,180	2.78
合計(純資産総額)		430,328,630,930	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	11,951,510,000	2.77

(参考)国内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	日本	19,916,844,100	99.11
現金・預金・その他資産(負債控除後)		177,765,079	0.88
合計(純資産総額)		20,094,609,179	100.00

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	926,519,476,768	70.43
	カナダ	49,086,475,556	3.73
	ドイツ	31,109,007,852	2.36
	イタリア	8,825,674,885	0.67
	フランス	41,456,179,101	3.15
	オランダ	17,286,339,990	1.31
	スペイン	8,672,274,100	0.65
	ベルギー	3,239,686,655	0.24
	オーストリア	763,043,543	0.05
	ルクセンブルグ	476,773,100	0.03
	フィンランド	3,595,282,724	0.27
	アイルランド	2,204,523,991	0.16
	ポルトガル	803,742,687	0.06
	イギリス	56,322,614,361	4.28
	スイス	38,889,867,581	2.95
	スウェーデン	13,477,175,359	1.02
	ノルウェー	2,973,510,536	0.22
	デンマーク	10,070,872,160	0.76
	オーストラリア	28,424,950,476	2.16
	ニュージーランド	760,802,280	0.05
	香港	9,889,098,823	0.75
シンガポール	4,010,819,941	0.30	
イスラエル	1,697,880,479	0.12	
	小計	1,260,556,072,948	95.83
投資証券	アメリカ	26,663,571,971	2.02
	カナダ	149,652,289	0.01
	フランス	596,534,604	0.04
	イギリス	814,883,555	0.06
	オーストラリア	1,953,177,480	0.14
	香港	471,502,208	0.03
	シンガポール	512,866,291	0.03
	小計	31,162,188,398	2.36
現金・預金・その他資産(負債控除後)		23,625,835,025	1.79
合計(純資産総額)		1,315,344,096,371	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	14,400,113,664	1.09
	買建	カナダ	754,803,126	0.05
	買建	ドイツ	1,795,445,140	0.13
	買建	イギリス	858,624,068	0.06
	買建	スイス	592,449,818	0.04
	買建	オーストラリア	481,969,600	0.03

（参考）外国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	308,104,047,273	47.73
	カナダ	13,108,850,637	2.03
	メキシコ	4,921,911,926	0.76
	ドイツ	39,213,905,156	6.07
	イタリア	61,223,669,443	9.48
	フランス	56,178,967,541	8.70
	オランダ	9,271,728,131	1.43
	スペイン	41,698,874,787	6.45
	ベルギー	13,969,630,949	2.16
	オーストリア	8,544,527,763	1.32
	フィンランド	2,651,382,361	0.41
	アイルランド	9,269,895,757	1.43
	イギリス	34,861,896,038	5.40
	スウェーデン	1,743,047,757	0.27
	ノルウェー	1,728,402,250	0.26
	デンマーク	2,653,595,241	0.41
	ポーランド	2,852,349,754	0.44
	オーストラリア	10,361,221,320	1.60
	シンガポール	2,695,444,155	0.41
	マレーシア	3,293,850,842	0.51
中国	7,730,472,255	1.19	
イスラエル	2,758,045,185	0.42	
	小計	638,835,716,521	98.96
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,675,976,437	1.03
合計（純資産総額）		645,511,692,958	100.00

（参考）新興国株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
-------	------	---------	---------

株式	アメリカ	3,263,958,476	4.40
	メキシコ	1,575,618,494	2.12
	ブラジル	4,099,241,007	5.52
	チリ	106,717,899	0.14
	コロンビア	63,305,734	0.08
	ギリシャ	156,243,452	0.21
	トルコ	176,163,934	0.23
	チェコ	108,015,643	0.14
	ハンガリー	142,535,851	0.19
	ポーランド	532,402,707	0.71
	香港	15,785,024,789	21.28
	マレーシア	1,052,891,954	1.41
	タイ	1,314,791,454	1.77
	フィリピン	531,423,306	0.71
	インドネシア	1,248,228,395	1.68
	韓国	8,892,983,289	11.98
	台湾	11,452,743,546	15.44
	インド	9,188,268,317	12.38
	カタール	689,039,755	0.92
	エジプト	44,176,486	0.05
	南アフリカ	2,856,624,605	3.85
	アラブ首長国連邦	1,001,919,768	1.35
	クウェート	549,561,904	0.74
サウジアラビア	2,974,412,148	4.01	
小計	67,806,292,913	91.41	
投資信託受益証券	アメリカ	2,974,788,881	4.01
投資証券	メキシコ	50,795,447	0.06
	南アフリカ	37,220,400	0.05
	小計	88,015,847	0.11
現金・預金・その他資産（負債控除後）		3,301,963,857	4.45
合計（純資産総額）		74,171,061,498	100.00

その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,643,029,175	3.56
	買建	香港	583,761,747	0.78

（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	21,804,279,434	97.35
現金・預金・その他資産（負債控除後）		592,863,659	2.64
合計（純資産総額）		22,397,143,093	100.00

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	メキシコ	883,110,187	9.92
	ブラジル	875,410,077	9.83
	チリ	187,872,271	2.11
	コロンビア	373,805,226	4.19
	ペルー	207,658,148	2.33
	ウルグアイ	11,819,661	0.13
	ドミニカ共和国	18,208,358	0.20
	セルビア	22,930,907	0.25
	トルコ	76,725,560	0.86
	チェコ	408,913,236	4.59
	ハンガリー	292,541,715	3.28
	ポーランド	599,067,568	6.73
	ロシア	6,240,040	0.07
	ルーマニア	274,499,126	3.08
	マレーシア	836,790,534	9.40
	タイ	844,242,262	9.48
	インドネシア	882,903,075	9.91
	中国	872,670,421	9.80
	エジプト	121,579,287	1.36
南アフリカ	838,545,849	9.42	
	小計	8,635,533,508	97.01
現金・預金・その他資産（負債控除後）		265,648,759	2.98
合計（純資産総額）		8,901,182,267	100.00

（参考）J-REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	41,808,243,500	96.25
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,628,788,781	3.74
合計（純資産総額）		43,437,032,281	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	1,302,408,500	2.99

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	43,446,245,036	75.27
	カナダ	1,091,463,848	1.89
	ドイツ	32,887,286	0.05
	イタリア	14,749,930	0.02
	フランス	1,011,780,266	1.75
	オランダ	113,726,471	0.19
	スペイン	238,408,217	0.41
	ベルギー	733,604,241	1.27
	アイルランド	64,287,276	0.11
	シンガポール	25,910,118	0.04
	イギリス	3,164,775,402	5.48
	オーストラリア	3,887,980,168	6.73
	ニュージーランド	209,269,265	0.36
	香港	769,204,352	1.33
	シンガポール	1,802,938,840	3.12
	韓国	119,093,171	0.20
	イスラエル	43,578,116	0.07
	小計	56,769,902,003	98.35
現金・預金・その他資産（負債控除後）		950,508,916	1.64
合計（純資産総額）		57,720,410,919	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	832,252,000	1.44

（参考）野村マネー マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
地方債証券	日本	1,302,163,948	15.31
特殊債券	日本	2,384,772,082	28.04
社債券	日本	1,373,554,681	16.15
現金・預金・その他資産(負債控除後)		3,442,983,502	40.48
合計(純資産総額)		8,503,474,213	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

野村DC運用戦略ファンド(マイルド)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	453,289,889	2.5030	1,134,584,593	2.5743	1,166,904,161	29.93
2	日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド	777,842,844	1.3372	1,040,141,738	1.3424	1,044,176,233	26.78
3	日本	親投資信託受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	10,066,762	4.4601	44,899,391	4.7511	47,828,192	1.22
4	日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	22,618,391	2.0542	46,463,333	2.0821	47,093,751	1.20
5	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	11,303,064	2.5943	29,323,665	2.7089	30,618,870	0.78
6	日本	親投資信託受益証券	新興国債券マザーファンド	11,130,886	2.0366	22,669,162	1.9277	21,457,008	0.55
7	日本	親投資信託受益証券	海外REITインデックスマザーファンド	5,863,264	3.1995	18,759,682	3.5230	20,656,279	0.52
8	日本	親投資信託受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	10,780,051	1.4333	15,451,047	1.3963	15,052,185	0.38
9	日本	親投資信託受益証券	新興国株式マザーファンド	7,056,336	1.6471	11,622,880	1.6278	11,486,303	0.29
10	日本	親投資信託受益証券	野村マネーマザーファンド	7,492,405	1.0199	7,641,503	1.0199	7,641,503	0.19

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	61.89
合計	61.89

(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	7,971,800	1,738.20	13,856,648,849	2,222.50	17,717,325,500	4.11
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	985,900	10,978.03	10,823,247,916	12,730.00	12,550,507,000	2.91

3	日本	株式	キーエンス	電気機器	142,600	54,652.14	7,793,395,426	57,250.00	8,163,850,000	1.89
4	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,734,800	610.45	5,942,670,275	760.30	7,401,368,440	1.71
5	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	99,900	50,522.14	5,047,162,080	63,250.00	6,318,675,000	1.46
6	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,160,200	5,532.93	6,419,308,018	5,414.00	6,281,322,800	1.45
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,615,600	2,880.32	4,653,451,813	3,545.00	5,727,302,000	1.33
8	日本	株式	任天堂	その他製品	88,800	61,538.39	5,464,609,074	61,670.00	5,476,296,000	1.27
9	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,161,500	3,155.75	3,665,408,847	4,601.00	5,344,061,500	1.24
10	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	926,100	9,713.35	8,995,537,375	5,559.00	5,148,189,900	1.19
11	日本	株式	信越化学工業	化学	264,700	18,612.56	4,926,745,172	18,790.00	4,973,713,000	1.15
12	日本	株式	日立製作所	電気機器	757,000	5,499.68	4,163,260,524	6,165.00	4,666,905,000	1.08
13	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,125,900	3,450.23	3,884,614,684	4,005.00	4,509,229,500	1.04
14	日本	株式	ダイキン工業	機械	200,500	23,158.85	4,643,349,476	22,410.00	4,493,205,000	1.04
15	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,084,200	3,537.15	3,834,984,290	4,144.00	4,492,924,800	1.04
16	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,237,000	3,688.88	4,563,156,645	3,498.00	4,327,026,000	1.00
17	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,239,100	3,420.36	4,238,169,597	3,487.00	4,320,741,700	1.00
18	日本	株式	HOYA	精密機器	307,100	13,531.42	4,155,500,942	14,030.00	4,308,613,000	1.00
19	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,074,500	3,956.67	4,251,444,576	3,907.00	4,198,071,500	0.97
20	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	177,700	15,784.38	2,804,884,410	23,510.00	4,177,727,000	0.97
21	日本	株式	三井物産	卸売業	1,203,700	2,545.20	3,063,664,426	3,328.00	4,005,913,600	0.93
22	日本	株式	日本電産	電気機器	407,900	12,457.39	5,081,370,284	9,748.00	3,976,209,200	0.92
23	日本	株式	村田製作所	電気機器	462,300	8,680.85	4,013,160,581	8,117.00	3,752,489,100	0.87
24	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	511,200	5,512.38	2,817,931,666	7,128.00	3,643,833,600	0.84
25	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	606,400	4,738.96	2,873,708,155	5,813.00	3,525,003,200	0.81
26	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,339,100	1,490.75	3,487,025,416	1,428.00	3,340,234,800	0.77
27	日本	株式	第一三共	医薬品	1,236,800	2,888.32	3,572,283,267	2,680.00	3,314,624,000	0.77
28	日本	株式	SMC	機械	46,100	65,594.89	3,023,924,445	68,840.00	3,173,524,000	0.73
29	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,985,200	1,612.72	3,201,589,098	1,567.00	3,110,808,400	0.72
30	日本	株式	ファナック	電気機器	138,100	26,250.46	3,625,189,564	21,645.00	2,989,174,500	0.69

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	0.30
		建設業	2.14
		食料品	3.15
		繊維製品	0.42
		パルプ・紙	0.20
		化学	6.26
		医薬品	4.78

石油・石炭製品	0.43
ゴム製品	0.64
ガラス・土石製品	0.71
鉄鋼	0.81
非鉄金属	0.79
金属製品	0.55
機械	5.19
電気機器	17.57
輸送用機器	8.13
精密機器	2.45
その他製品	2.35
電気・ガス業	1.09
陸運業	2.99
海運業	0.62
空運業	0.40
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	8.01
卸売業	5.93
小売業	4.10
銀行業	5.15
証券、商品先物取引業	0.74
保険業	2.17
その他金融業	1.10
不動産業	1.91
サービス業	5.72
合 計	97.21

(参考) 国内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	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 9回	420,000,000	100.70	422,940,000	100.27	421,155,000	0.1	2024/3/20	2.09
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 0回	370,000,000	100.62	372,305,000	100.31	371,147,000	0.1	2024/6/20	1.84
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	350,000,000	101.93	356,786,500	101.11	353,916,500	0.6	2023/12/20	1.76
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 1回	340,000,000	100.69	342,370,200	100.33	341,132,200	0.1	2024/9/20	1.69
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 50回	320,000,000	101.16	323,743,500	100.20	320,665,600	0.1	2028/3/20	1.59
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	300,000,000	100.99	302,988,000	100.37	301,137,000	0.1	2026/9/20	1.49

7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 7回	300,000,000	100.52	301,563,200	100.23	300,705,000	0.1	2023/9/20	1.49
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 5回	270,000,000	100.98	272,646,000	100.41	271,123,200	0.1	2025/9/20	1.34
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 46回	270,000,000	101.03	272,790,300	100.34	270,936,900	0.1	2027/3/20	1.34
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 33回	250,000,000	102.13	255,342,500	101.25	253,147,500	0.6	2024/3/20	1.25
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 6回	250,000,000	100.97	252,432,500	100.42	251,070,000	0.1	2025/12/20	1.24
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 7回	250,000,000	100.44	251,117,000	100.03	250,097,500	0.005	2026/3/20	1.24
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 9回	250,000,000	100.48	251,223,500	99.95	249,887,500	0.005	2026/9/20	1.24
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	240,000,000	101.01	242,424,000	100.35	240,847,200	0.1	2026/12/20	1.19
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	230,000,000	100.97	232,231,000	100.41	230,956,800	0.1	2026/3/20	1.14
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	220,000,000	102.31	225,082,000	101.42	223,126,200	0.6	2024/6/20	1.11
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 30回	220,000,000	102.22	224,899,400	101.26	222,785,200	0.8	2023/9/20	1.10
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	200,000,000	102.14	204,288,000	101.32	202,646,000	0.5	2024/9/20	1.00
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	200,000,000	101.92	203,840,000	101.17	202,344,000	0.3	2025/12/20	1.00
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	200,000,000	101.04	202,081,300	100.40	200,800,000	0.1	2026/6/20	0.99
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 47回	200,000,000	101.08	202,166,100	100.31	200,624,000	0.1	2027/6/20	0.99
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (30年)第3 2回	150,000,000	131.90	197,863,000	128.50	192,763,500	2.3	2040/3/20	0.95
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 13回	160,000,000	117.46	187,937,600	114.70	183,526,400	2.1	2029/9/20	0.91
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 51回	180,000,000	101.14	182,066,000	100.15	180,277,200	0.1	2028/6/20	0.89
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 45回	150,000,000	118.36	177,540,000	115.76	173,640,000	1.7	2033/6/20	0.86
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 47回	150,000,000	117.58	176,373,000	114.97	172,468,500	1.6	2033/12/20	0.85
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 48回	150,000,000	116.58	174,870,000	113.99	170,991,000	1.5	2034/3/20	0.85
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 59回	170,000,000	100.82	171,394,000	99.55	169,240,100	0.1	2030/6/20	0.84
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 52回	150,000,000	113.17	169,755,000	110.61	165,918,000	1.2	2035/3/20	0.82

30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 46回	140,000,000	118.59	166,033,000	115.97	162,365,000	1.7	2033/9/20	0.80
----	----	------	---------------------------	-------------	--------	-------------	--------	-------------	-----	-----------	------

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.11
合計	99.11

(参考)外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	3,087,400	15,087.48	46,581,086,170	21,757.27	67,173,396,324	5.10
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,342,200	29,206.01	39,200,318,070	38,413.32	51,558,365,352	3.91
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	85,890	379,210.26	32,570,369,410	407,071.58	34,963,378,676	2.65
4	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	160,640	82,642.97	13,275,766,740	133,893.43	21,508,641,575	1.63
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	56,610	259,274.40	14,677,524,336	347,437.06	19,668,411,984	1.49
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	53,810	259,768.27	13,978,130,699	349,165.20	18,788,579,794	1.42
7	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	470,440	17,152.93	8,069,426,484	33,889.79	15,943,113,278	1.21
8	アメリカ	株式	META PLATFORMS INC	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	445,300	35,586.89	15,846,844,376	27,886.56	12,417,885,836	0.94
9	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	177,240	46,710.49	8,278,967,489	63,743.15	11,297,837,643	0.85
10	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	495,400	20,236.57	10,025,197,712	21,980.02	10,888,901,958	0.82
11	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	245,300	32,103.36	7,874,956,066	43,767.88	10,736,262,902	0.81
12	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	556,100	18,917.95	10,520,273,522	17,200.69	9,565,304,043	0.72
13	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	314,200	26,100.14	8,200,664,062	27,409.24	8,611,983,365	0.65
14	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	455,400	16,745.80	7,626,040,641	18,895.79	8,605,143,722	0.65
15	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	529,700	14,189.91	7,516,396,707	15,981.67	8,465,492,294	0.64
16	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	796,700	7,085.48	5,645,003,450	10,253.83	8,169,229,707	0.62

17	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	196,500	37,828.82	7,433,364,151	37,752.41	7,418,350,412	0.56
18	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	362,800	13,136.73	4,766,006,432	20,253.09	7,347,823,664	0.55
19	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	165,100	43,883.78	7,245,213,144	44,334.55	7,319,634,799	0.55
20	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,386,000	4,820.37	6,681,042,944	5,262.77	7,294,199,220	0.55
21	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	1,056,300	4,582.01	4,839,985,876	6,418.13	6,779,472,409	0.51
22	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	332,700	13,342.84	4,439,165,504	20,041.36	6,667,761,304	0.50
23	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	77,780	71,941.99	5,595,648,497	85,054.73	6,615,557,677	0.50
24	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	132,200	40,900.13	5,406,997,684	49,145.83	6,497,078,990	0.49
25	アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	77,460	56,917.68	4,408,844,104	77,239.10	5,982,941,081	0.45
26	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	342,100	22,362.43	7,650,188,096	17,252.09	5,901,941,494	0.44
27	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	772,200	6,569.50	5,072,969,192	7,613.88	5,879,439,603	0.44
28	アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORPORATION	食品・生活必需品小売り	83,140	44,473.08	3,697,491,992	70,554.16	5,865,873,137	0.44
29	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	793,700	6,393.78	5,074,747,391	6,859.95	5,444,749,855	0.41
30	アメリカ	株式	ELI LILLY & CO.	医薬品	153,000	23,423.00	3,583,720,052	35,479.63	5,428,384,476	0.41

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.16
		メディア	0.91
		娯楽	1.18
		不動産管理・開発	0.36
		エネルギー設備・サービス	0.23
		石油・ガス・消耗燃料	4.17
		化学	2.02
		建設資材	0.22
		容器・包装	0.26
		金属・鉱業	1.72
		紙製品・林産品	0.10
		航空宇宙・防衛	1.47
		建設関連製品	0.53
		建設・土木	0.20
		電気設備	0.80
		コングロマリット	0.98
		機械	1.57
		商社・流通業	0.34
商業サービス・用品	0.43		
航空貨物・物流サービス	0.60		

旅客航空輸送業	0.05
海運業	0.08
陸運・鉄道	1.14
運送インフラ	0.12
自動車部品	0.18
自動車	2.28
家庭用耐久財	0.27
レジャー用品	0.03
繊維・アパレル・贅沢品	1.34
ホテル・レストラン・レジャー	1.73
販売	0.08
インターネット販売・通信販売	3.03
複合小売り	0.48
専門小売り	1.48
食品・生活必需品小売り	1.50
飲料	1.60
食品	1.54
タバコ	0.64
家庭用品	1.06
パーソナル用品	0.52
ヘルスケア機器・用品	2.42
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.17
バイオテクノロジー	1.73
医薬品	4.91
銀行	5.86
各種金融サービス	1.07
保険	3.06
情報技術サービス	3.78
ソフトウェア	7.26
通信機器	0.68
コンピュータ・周辺機器	5.37
電子装置・機器・部品	0.53
半導体・半導体製造装置	4.96
各種電気通信サービス	1.22
無線通信サービス	0.26
電力	1.73
ガス	0.13
総合公益事業	0.87
水道	0.10
消費者金融	0.45
資本市場	3.21
各種消費者サービス	0.00

		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.09
		ヘルスケア・テクノロジー	0.11
		ライフサイエンス・ツール/サービス	1.45
		専門サービス	0.68
投資証券			2.36
合計			98.20

(参考) 外国債券マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	151,700,000	16,541.53	25,093,515,910	15,199.30	23,057,350,426	5.375	2031/2/15	3.57
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	129,400,000	15,510.09	20,070,067,861	14,313.89	18,522,176,709	5.25	2028/11/15	2.86
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	81,000,000	12,610.53	10,214,535,735	11,766.65	9,530,986,891	1.625	2026/11/30	1.47
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	66,600,000	15,257.92	10,161,776,841	13,815.72	9,201,274,259	6	2026/2/15	1.42
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	69,800,000	12,969.75	9,052,891,394	12,265.77	8,561,509,423	2.5	2024/5/15	1.32
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	67,500,000	12,948.91	8,740,514,627	12,199.79	8,234,862,323	2.375	2027/5/15	1.27
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,100,000	16,916.29	8,136,738,875	15,736.67	7,569,341,207	6.25	2030/5/15	1.17
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	57,850,000	12,923.07	7,475,999,369	12,159.63	7,034,350,253	2.25	2024/11/15	1.08
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	53,600,000	13,604.14	7,291,821,861	12,516.76	6,708,987,528	2.875	2028/5/15	1.03
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	54,850,000	13,264.32	7,275,480,377	11,925.37	6,541,068,529	2.375	2051/5/15	1.01
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,100,000	13,096.58	6,561,386,993	12,098.44	6,061,319,657	2.25	2025/11/15	0.93
12	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	35,000,000	18,657.03	6,529,963,381	17,200.96	6,020,336,350	5.25	2029/11/1	0.93
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,700,000	12,813.00	6,368,065,523	11,974.13	5,951,147,318	2.5	2046/2/15	0.92
14	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	30,100,000	21,859.82	6,579,808,796	19,654.91	5,916,130,133	4.75	2035/4/25	0.91
15	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,650,000	17,913.20	6,206,925,610	16,634.98	5,764,021,261	5.9	2026/7/30	0.89
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	46,700,000	13,037.71	6,088,612,913	12,213.18	5,703,556,486	2.375	2024/8/15	0.88
17	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	32,800,000	18,929.47	6,208,868,971	17,365.00	5,695,720,328	6.5	2027/11/1	0.88
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,900,000	12,862.28	5,903,788,597	12,257.16	5,626,039,353	2.25	2023/12/31	0.87
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,100,000	16,525.33	5,965,645,138	15,452.69	5,578,422,304	4.5	2036/2/15	0.86
20	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,700,000	19,808.22	5,883,042,252	18,044.40	5,359,186,800	5.5	2029/4/25	0.83
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,600,000	12,957.33	5,649,395,955	12,136.68	5,291,596,536	2.125	2024/9/30	0.81

22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,950,000	14,473.79	5,782,279,761	13,211.42	5,277,964,883	3.125	2044/8/15	0.81
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	13,016.36	5,544,972,524	12,341.30	5,257,397,835	2.75	2023/11/15	0.81
24	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	27,100,000	21,367.80	5,790,674,608	19,288.37	5,227,148,270	5.75	2032/7/30	0.80
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,700,000	12,751.69	5,572,490,019	11,915.81	5,207,210,408	2.5	2045/2/15	0.80
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,300,000	13,170.33	5,571,052,767	12,156.76	5,142,313,121	2.375	2026/4/30	0.79
27	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000	16,373.92	5,419,769,506	15,295.36	5,062,765,153	3.5	2026/4/25	0.78
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,900,000	12,635.83	5,294,415,521	11,721.71	4,911,396,531	1.5	2026/8/15	0.76
29	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	31,600,000	16,208.73	5,121,961,027	15,302.19	4,835,494,568	5	2025/3/1	0.74
30	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	23,850,000	22,246.65	5,305,827,974	20,123.21	4,799,385,721	5.75	2032/10/25	0.74

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.96
合計	98.96

(参考)新興国株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半 導体製造装 置	1,939,000	2,571.49	4,986,129,289	2,571.36	4,985,867,040	6.72
2	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF		4,381,400	760.76	3,333,226,454	678.95	2,974,788,881	4.01
3	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	453,600	8,955.52	4,062,226,706	5,952.58	2,700,092,102	3.64
4	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュー タ・周辺機 器	375,930	8,254.38	3,103,069,553	7,080.86	2,661,911,459	3.58
5	香港	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	インター ネット販 売・通信販 売	1,194,980	3,311.97	3,957,740,796	1,781.39	2,128,732,592	2.87

6	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	225,000	3,217.10	723,848,920	4,356.90	980,304,413	1.32
7	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	262,700	2,244.80	589,710,322	3,103.43	815,273,294	1.09
8	香港	株式	MEITUAN-CLASS B	インターネット販売・通信販売	322,100	4,300.90	1,385,321,913	2,503.96	806,526,804	1.08
9	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	323,652	2,899.55	938,445,876	2,458.88	795,822,513	1.07
10	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	7,570,000	97.00	734,306,559	90.71	686,689,840	0.92
11	香港	株式	JD.COM, INC.	インターネット販売・通信販売	157,967	4,738.75	748,567,051	3,722.31	588,003,723	0.79
12	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	135,600	4,083.18	553,679,234	3,888.28	527,251,243	0.71
13	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	42,980	13,081.89	562,259,982	12,257.30	526,818,754	0.71
14	サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	97,700	3,354.88	327,771,782	5,220.66	510,059,068	0.68
15	インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	404,900	1,010.73	409,245,923	1,191.36	482,384,498	0.65
16	台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	119,538	4,466.34	533,897,588	3,921.32	468,747,228	0.63
17	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・機器・部品	997,649	498.90	497,735,748	452.13	451,067,840	0.60
18	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	498,500	1,252.15	624,201,723	882.09	439,724,856	0.59
19	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術サービス	72,247	5,181.62	374,356,738	6,082.42	439,437,067	0.59
20	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	64,800	7,532.69	488,118,730	6,432.55	416,829,240	0.56
21	サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	172,100	1,793.49	308,660,856	2,345.70	403,696,002	0.54
22	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インタラクティブ・メディアおよびサービス	22,170	22,956.37	508,942,726	17,603.35	390,266,352	0.52
23	香港	株式	NETEASE, INC.	娯楽	165,950	2,652.61	440,201,169	2,277.18	377,898,685	0.50

24	韓国	株式	NAVER CORP	インタラクティブ・メディアおよびサービス	9,910	36,528.42	361,996,732	34,340.70	340,316,337	0.45
25	アラブ首長国連邦	株式	EMIRATES TELECOM CORPORATION	各種電気通信サービス	274,900	882.58	242,623,557	1,201.68	330,341,832	0.44
26	ブラジル	株式	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	石油・ガス・消耗燃料	383,000	644.81	246,964,740	846.13	324,068,104	0.43
27	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,350,000	78.42	341,160,451	74.44	323,841,840	0.43
28	香港	株式	MUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	ライフサイエンス・ツール/サービス	288,000	1,606.23	462,595,956	1,082.28	311,698,944	0.42
29	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信サービス	2,426,000	92.22	223,747,225	127.75	309,930,234	0.41
30	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	6,240,000	48.78	304,407,208	48.79	304,492,032	0.41

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	5.33
		メディア	0.21
		娯楽	1.00
		不動産管理・開発	1.80
		エネルギー設備・サービス	0.05
		石油・ガス・消耗燃料	4.49
		化学	2.99
		建設資材	0.94
		容器・包装	0.07
		金属・鋳業	4.30
		紙製品・林産品	0.19
		航空宇宙・防衛	0.09
		建設関連製品	0.01
		建設・土木	0.47
		電気設備	0.49
		コングロマリット	0.99
機械	0.31		

商社・流通業	0.10
商業サービス・用品	0.08
航空貨物・物流サービス	0.26
旅客航空輸送業	0.11
海運業	0.50
陸運・鉄道	0.22
運送インフラ	0.66
自動車部品	0.40
自動車	2.58
家庭用耐久財	0.30
レジャー用品	0.05
繊維・アパレル・贅沢品	1.00
ホテル・レストラン・レジャー	0.82
インターネット販売・通信販売	5.61
複合小売り	0.29
専門小売り	0.49
食品・生活必需品小売り	1.19
飲料	0.91
食品	1.58
タバコ	0.32
家庭用品	0.05
パーソナル用品	0.68
ヘルスケア機器・用品	0.14
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.67
バイオテクノロジー	0.59
医薬品	1.02
銀行	14.66
各種金融サービス	0.92
保険	2.60
情報技術サービス	2.51
ソフトウェア	0.17
通信機器	0.08
コンピュータ・周辺機器	5.24
電子装置・機器・部品	2.53
半導体・半導体製造装置	9.47
各種電気通信サービス	1.45

		無線通信サービス	1.77
		電力	0.94
		ガス	0.49
		総合公益事業	0.02
		水道	0.13
		貯蓄・抵当・不動産金融	0.71
		消費者金融	0.58
		資本市場	0.81
		各種消費者サービス	0.04
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.72
		ヘルスケア・テクノロジー	0.03
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.86
		専門サービス	0.02
		その他の業種	0.00
	投資信託受益証券		4.01
	投資証券		0.11
	合 計		95.54

(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	REPUBLIC OF ARGENTINA	13,537,686	3,856.50	522,082,064	3,731.18	505,115,640	1.125	2035/7/9	2.25
2	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	10,365,309	4,396.51	455,712,460	4,149.14	430,071,533	0.5	2030/7/9	1.92
3	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	3,200,000	13,175.45	421,614,555	12,397.65	396,724,933	7.375	2025/2/5	1.77
4	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	7,186,159	4,649.59	334,127,368	4,602.47	330,741,239	2	2038/1/9	1.47
5	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	2,000,000	16,489.72	329,794,480	15,515.86	310,317,397	5.625	2050/11/18	1.38
6	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	1,750,000	19,314.67	338,006,758	17,357.98	303,764,780	9.5	2030/2/2	1.35
7	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	2,600,000	12,405.63	322,546,606	11,544.92	300,168,084	2.783	2031/1/23	1.34
8	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,500,000	12,860.74	321,518,530	11,979.77	299,494,450	6.375	2025/10/14	1.33
9	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,500,000	13,302.56	332,564,227	11,636.22	290,905,731	5.625	2047/2/21	1.29
10	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	2,200,000	13,750.68	302,515,035	11,965.21	263,234,699	4.5	2056/4/1	1.17
11	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,600,000	11,560.46	300,571,996	10,087.00	262,262,019	6.625	2045/2/17	1.17
12	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	6,100,000	4,348.94	265,285,343	4,294.78	261,982,037	2.5	2041/7/9	1.16

13	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,500,000	13,054.75	326,368,846	10,474.62	261,865,644	5	2045/6/15	1.16
14	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,300,000	12,401.16	285,226,835	11,384.04	261,833,027	6	2027/3/25	1.16
15	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,000,000	13,856.68	277,133,797	13,060.11	261,202,291	4.75	2032/4/27	1.16
16	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,550,000	18,385.42	284,974,100	16,758.15	259,751,387	7.75	2038/1/17	1.15
17	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000	13,267.07	278,608,596	11,909.75	250,104,932	7.625	2029/4/26	1.11
18	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,000,000	13,692.99	273,859,864	12,504.70	250,094,174	5	2051/4/27	1.11
19	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000	13,999.94	265,999,000	13,025.15	247,477,853	4.75	2026/1/8	1.10
20	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,600,000	16,510.41	264,166,576	14,971.92	239,550,833	5.95	2046/1/8	1.06
21	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,700,000	15,685.50	266,653,541	14,073.81	239,254,869	5.35	2049/2/11	1.06
22	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,800,000	13,797.02	248,346,444	12,978.29	233,609,342	4.5	2029/4/22	1.04
23	アメリカ	国債証券	PANAMA GLOBAL	1,550,000	16,571.85	256,863,718	15,051.46	233,297,646	6.7	2036/1/26	1.04
24	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000	12,628.39	239,939,476	12,033.87	228,643,613	2.875	2025/6/6	1.02
25	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,800,000	13,292.51	239,265,351	12,673.21	228,117,941	4.125	2025/1/15	1.01
26	アメリカ	国債証券	HUNGARY	1,750,000	13,574.34	237,551,034	12,820.53	224,359,381	5.75	2023/11/22	1.00
27	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	13,564.80	230,601,607	12,908.59	219,446,126	4.125	2026/1/21	0.97
28	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,100,000	11,611.13	243,833,925	10,358.96	217,538,311	4.75	2050/1/14	0.97
29	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,900,000	12,075.70	229,438,414	11,230.75	213,384,273	2.659	2031/5/24	0.95
30	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,000,000	12,488.67	249,773,512	10,612.92	212,258,529	5.2	2049/5/15	0.94

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.35
合計	97.35

(参考)新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	13,500,000	1,938.38	261,681,865	1,932.17	260,843,202	2.47	2024/9/2	2.93
2	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	12,800,000	1,945.77	249,058,843	1,939.06	248,200,828	2.69	2026/8/12	2.78
3	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	6,800,000	2,756.72	187,457,408	2,724.39	185,258,741	2.25	2024/10/25	2.08
4	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	8,900,000	2,076.87	184,841,756	2,071.42	184,356,811		2024/1/1	2.07
5	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000	1,948.94	175,405,086	1,943.90	174,951,098	2.91	2028/10/14	1.96

6	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	7,100,000	2,189.35	155,444,545	2,178.17	154,650,152		2023/7/1	1.73
7	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5,500,000	2,579.63	141,879,773	2,514.24	138,283,574	2.75	2029/10/25	1.55
8	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,900,000	942.30	140,404,184	918.84	136,908,444	10.5	2026/12/21	1.53
9	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	480,000	2,549.42	122,378,469	2,576.43	123,668,991	10	2023/1/1	1.38
10	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	490,000	2,485.30	121,780,649	2,501.20	122,558,971	10	2027/1/1	1.37
11	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	481,000	2,519.41	121,186,806	2,538.53	122,103,475	10	2025/1/1	1.37
12	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000	1,959.03	117,542,041	1,954.04	117,242,855	3.02	2031/5/27	1.31
13	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,700,000	790.52	116,207,075	773.37	113,686,226	8	2030/1/31	1.27
14	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000	2,965.75	103,801,592	2,883.38	100,918,300	4	2023/10/25	1.13
15	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,900,000	730.01	101,471,947	716.96	99,657,467	8.75	2048/2/28	1.11
16	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	16,700,000	573.13	95,714,150	559.50	93,437,703	5.75	2026/3/5	1.04
17	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,650,000	609.41	95,372,854	588.71	92,134,485	7.5	2027/6/3	1.03
18	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,100,000	649.93	91,640,768	637.43	89,878,568	10	2024/12/5	1.00
19	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,700,000	619.21	91,024,459	609.34	89,573,664	8	2024/9/5	1.00
20	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000	729.98	86,137,788	718.61	84,796,154	8.75	2044/1/31	0.95
21	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	16,600,000	510.06	84,671,108	490.16	81,368,048	1	2026/6/26	0.91
22	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,200,000	741.03	82,995,584	724.74	81,171,194	8.5	2037/1/31	0.91
23	マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	2,900,000	2,855.03	82,796,151	2,774.16	80,450,814	3.828	2034/7/5	0.90
24	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	17,800,000	482.02	85,800,871	451.76	80,413,416	1.2	2031/3/13	0.90
25	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,300,000	614.07	81,672,538	590.80	78,577,269	7.75	2031/5/29	0.88
26	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000	2,952.91	79,728,659	2,902.01	78,354,289	3.885	2029/8/15	0.88
27	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000	3,004.17	78,108,451	2,992.95	77,816,780	4.181	2024/7/15	0.87
28	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,200,000	777.91	79,347,284	757.38	77,253,193	8.25	2032/3/31	0.86
29	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000	781.47	77,366,422	764.52	75,688,283	8.875	2035/2/28	0.85
30	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	14,000,000	529.28	74,099,791	523.74	73,324,742	0.45	2023/10/25	0.82

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.01
合計	97.01

(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	4,395	722,107	3,173,660,265	692,000	3,041,340,000	7.00
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	3,770	682,554	2,573,230,728	639,000	2,409,030,000	5.54
3	日本	投資証券	GLP投資法人 投資証券	12,210	187,794	2,292,970,845	185,400	2,263,734,000	5.21
4	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	6,168	357,678	2,206,162,098	356,500	2,198,892,000	5.06
5	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	12,191	180,061	2,195,129,868	161,200	1,965,189,200	4.52
6	日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	19,021	113,482	2,158,551,583	103,000	1,959,163,000	4.51
7	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,661	326,975	1,851,007,399	328,000	1,856,808,000	4.27
8	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,769	365,519	1,377,641,789	344,500	1,298,420,500	2.98
9	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	7,512	209,349	1,572,635,021	165,300	1,241,733,600	2.85
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	8,487	158,458	1,344,837,713	140,700	1,194,120,900	2.74
11	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,576	440,091	1,133,675,729	399,500	1,029,112,000	2.36
12	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	5,352	205,199	1,098,228,312	184,900	989,584,800	2.27
13	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,443	91,425	1,046,180,165	80,700	923,450,100	2.12
14	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	1,485	587,938	873,089,370	575,000	853,875,000	1.96
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	1,166	795,811	927,916,395	731,000	852,346,000	1.96
16	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,009	495,205	994,868,492	424,000	851,816,000	1.96
17	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,302	648,865	844,823,401	640,000	833,280,000	1.91
18	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,615	181,571	837,950,165	175,200	808,548,000	1.86
19	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,542	322,672	820,232,300	317,500	807,085,000	1.85
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	11,549	69,081	797,817,161	62,300	719,502,700	1.65
21	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	16,593	45,597	756,601,806	42,200	700,224,600	1.61
22	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,322	517,188	683,722,536	507,000	670,254,000	1.54
23	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,433	162,458	720,179,816	151,100	669,826,300	1.54
24	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,434	157,524	698,464,697	151,000	669,534,000	1.54
25	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	797	785,834	626,310,327	757,000	603,329,000	1.38
26	日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	5,094	118,543	603,859,009	115,100	586,319,400	1.34
27	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,517	182,369	641,393,988	166,600	585,932,200	1.34
28	日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	3,614	163,630	591,361,530	161,100	582,215,400	1.34
29	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	1,754	351,533	616,589,320	328,500	576,189,000	1.32
30	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	2,698	229,196	618,372,399	213,500	576,023,000	1.32

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.25
合 計	96.25

(参考) 海外REITインデックス マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	208,750	15,576.83	3,251,664,509	20,089.09	4,193,598,498	7.26
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	25,370	98,381.93	2,495,949,793	92,258.80	2,340,605,906	4.05
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	42,990	36,880.70	1,585,501,647	48,486.02	2,084,414,103	3.61
4	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	92,600	16,777.33	1,553,581,013	16,496.94	1,527,617,394	2.64
5	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	122,700	9,793.60	1,201,675,567	11,977.08	1,469,588,379	2.54
6	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	80,120	19,530.00	1,564,744,143	17,643.74	1,413,616,641	2.44
7	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	159,700	8,373.91	1,337,313,672	8,601.56	1,373,670,601	2.37
8	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	39,390	26,353.53	1,038,065,570	30,836.16	1,214,636,362	2.10
9	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	96,200	9,845.14	947,102,531	11,198.68	1,077,313,497	1.86
10	オースト ラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	479,400	1,912.90	917,045,696	2,121.52	1,017,056,688	1.76
11	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	41,110	23,514.46	966,679,546	24,732.57	1,016,756,002	1.76
12	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	37,820	20,131.30	761,365,781	25,573.39	967,185,629	1.67
13	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	112,300	6,937.04	779,030,463	7,689.76	863,560,463	1.49
14	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	32,590	21,386.71	696,992,985	26,070.29	849,630,878	1.47
15	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	167,800	4,671.95	783,953,968	5,006.97	840,170,388	1.45
16	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	18,440	38,467.38	709,338,636	42,679.84	787,016,264	1.36
17	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	107,100	6,117.48	655,182,554	7,234.47	774,812,048	1.34
18	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	338,300	1,795.22	607,324,221	2,188.90	740,507,729	1.28
19	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	32,630	21,882.45	714,024,398	21,798.88	711,297,549	1.23
20	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	151,700	4,227.48	641,309,770	4,262.84	646,673,389	1.12
21	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	40,000	14,840.35	593,614,020	16,015.95	640,638,216	1.10
22	香港	投資証券	LINK REIT	594,000	1,167.71	693,625,597	1,058.04	628,479,324	1.08
23	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	176,700	3,868.74	683,607,754	3,541.96	625,865,498	1.08
24	アメリカ	投資証券	UDR INC	84,600	6,262.19	529,781,760	7,101.06	600,750,336	1.04
25	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	28,770	16,918.40	486,742,410	20,758.56	597,223,998	1.03
26	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	81,500	5,726.48	466,708,441	6,787.74	553,201,576	0.95
27	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	53,900	9,451.88	509,456,453	10,065.35	542,522,559	0.93
28	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	173,100	2,730.52	472,653,168	3,059.75	529,642,725	0.91
29	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	201,200	2,158.59	434,309,727	2,439.23	490,773,619	0.85
30	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	48,900	9,418.92	460,585,636	9,472.98	463,229,015	0.80

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.35
合 計	98.35

(参考)野村マネー 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	特殊債券	日本学生支援債券 財投機関債 第59回	510,000,000	100.00	510,022,335	100.00	510,022,335	0.001	2022/6/20	5.99
2	日本	社債券	東日本旅客鉄道 第85回社債間限定同順位特約付	300,000,000	100.27	300,825,370	100.27	300,825,370	0.874	2022/7/22	3.53
3	日本	地方債証券	大阪府 公募第361回	300,000,000	100.22	300,681,690	100.22	300,681,690	0.92	2022/6/28	3.53
4	日本	特殊債券	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第49回	300,000,000	100.17	300,514,302	100.17	300,514,302	0.767	2022/6/20	3.53
5	日本	特殊債券	商工債券 利付(3年)第236回	300,000,000	100.01	300,047,500	100.01	300,047,500	0.02	2022/9/27	3.52
6	日本	社債券	中部電力 第522回	300,000,000	100.01	300,031,290	100.01	300,031,290	0.13	2022/4/25	3.52
7	日本	特殊債券	公営企業債券(20年) 第1回財投機関債	200,000,000	100.44	200,893,637	100.44	200,893,637	2.1	2022/6/20	2.36
8	日本	社債券	三井不動産 第46回社債間限定同順位特約付	200,000,000	100.39	200,799,600	100.39	200,799,600	0.964	2022/8/30	2.36
9	日本	特殊債券	日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第96回	200,000,000	100.37	200,759,046	100.37	200,759,046	0.796	2022/9/20	2.36
10	日本	地方債証券	共同発行市場地方債 公募第112回	200,000,000	100.26	200,535,280	100.26	200,535,280	0.84	2022/7/25	2.35
11	日本	地方債証券	東京都 公募第708回	200,000,000	100.19	200,392,362	100.19	200,392,362	0.89	2022/6/20	2.35
12	日本	地方債証券	共同発行市場地方債 公募第110回	200,000,000	100.13	200,274,269	100.13	200,274,269	0.89	2022/5/25	2.35
13	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第333回	200,000,000	100.03	200,074,782	100.03	200,074,782	0.09	2022/8/26	2.35
14	日本	地方債証券	京都府 公募平成29年度第3回	200,000,000	100.00	200,014,870	100.00	200,014,870	0.01	2022/6/21	2.35
15	日本	社債券	トヨタ自動車 第20回社債間限定同順位特約付	200,000,000	100.00	200,010,000	100.00	200,010,000	0.03	2022/6/2	2.35
16	日本	社債券	クレディセゾン 第62回社債間限定同順位特約付	170,000,000	100.02	170,036,594	100.02	170,036,594	0.16	2022/5/31	1.99
17	日本	特殊債券	日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第13回	150,000,000	101.06	151,604,388	101.06	151,604,388	2.28	2022/9/20	1.78
18	日本	社債券	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	101.23	101,236,638	101.23	101,236,638	2.22	2022/10/27	1.19
19	日本	社債券	電源開発 第35回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100.61	100,615,189	100.61	100,615,189	1.126	2022/10/20	1.18
20	日本	特殊債券	東京交通債券 第342回	100,000,000	100.53	100,533,427	100.53	100,533,427	2.4	2022/6/21	1.18

21	日本	地方債証券	福岡県 公募平成24年度第1回	100,000,000	100.19	100,194,000	100.19	100,194,000	0.88	2022/6/22	1.17
22	日本	地方債証券	共同発行市場地方債 公募第109回	100,000,000	100.07	100,071,477	100.07	100,071,477	1.05	2022/4/25	1.17
23	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第332回	100,000,000	100.03	100,032,102	100.03	100,032,102	0.09	2022/7/27	1.17
24	日本	特殊債券	商工債券 利付(3年)第234回	100,000,000	100.02	100,024,902	100.02	100,024,902	0.06	2022/7/27	1.17
25	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第329回	100,000,000	100.00	100,008,192	100.00	100,008,192	0.06	2022/4/27	1.17
26	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第331回	50,000,000	100.02	50,011,935	100.02	50,011,935	0.08	2022/6/27	0.58
27	日本	特殊債券	地方公共団体金融機構債券 第42回	40,000,000	100.51	40,207,974	100.51	40,207,974	0.801	2022/11/28	0.47
28	日本	特殊債券	商工債券 利付第811回い号	30,000,000	100.12	30,037,560	100.12	30,037,560	0.17	2022/12/27	0.35

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
地方債証券	15.31
特殊債券	28.04
社債券	16.15
合計	59.51

【投資不動産物件】

野村DC運用戦略ファンド(マイルド)

該当事項はありません。

(参考)国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新興国株式マザーファンド

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）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J - R E I T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R E I T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）野村マネー マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

野村D C運用戦略ファンド（マイルド）

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （%）
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2022年06月限)	買建	614	日本円	11,644,790,130	11,951,510,000	2.77

（参考）国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

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

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資 比率 （%）
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取引 所	E-mini S&P500株 価指数先物(2022 年06月限)	買建	512	米ドル	110,926,177.5	13,576,254,874	117,657,600	14,400,113,664	1.09
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2022年06 月限)	買建	29	カナダド ル	7,558,374	739,964,815	7,709,940	754,803,126	0.05

ドイツ	ユーロレックス・ドイツ金融先物取引所	ユーロ50株価指数先物(2022年06月限)	買建	340	ユーロ	12,677,720	1,733,044,325	13,134,200	1,795,445,140	0.13
オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200株価指数先物(2022年06月限)	買建	28	豪ドル	5,054,575	465,020,900	5,238,800	481,969,600	0.03
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2022年06月限)	買建	71	英ポンド	5,159,730	830,148,958	5,336,715	858,624,068	0.06
スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SMI株価指数先物(2022年06月限)	買建	37	スイスフラン	4,311,520	571,448,860	4,469,970	592,449,818	0.04

(参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新興国株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額(円)	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCIエマージング・マーケット指数先物(2022年06月限)	買建	378	米ドル	20,273,360	2,481,256,531	21,595,140	2,643,029,175	3.56
	香港	香港先物取引所	MSCI China A 50 Connect 指数先物(2022年04月限)	買建	81	米ドル	4,708,530	576,276,987	4,769,685	583,761,747	0.78

(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) 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 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(2022年06月限)	買建	653	日本円	1,222,985,270	1,302,408,500	2.99
------------	-------	---------------------	----	-----	-----	---------------	---------------	------

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額(円)	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴボード オブトレード	ダウ・ジョーンズ米国不動産指数先物(2022年06月限)	買建	160	米ドル	6,554,670	802,226,063	6,800,000	832,252,000	1.44

（参考）野村マネー マザーファンド

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

2022年3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 2月17日)	34	34	0.9888	0.9888
第2計算期間	(2015年 2月17日)	36	36	1.0396	1.0401
第3計算期間	(2016年 2月17日)	35	35	1.0274	1.0279
第4計算期間	(2017年 2月17日)	47	48	1.0353	1.0358
第5計算期間	(2018年 2月19日)	948	949	1.0379	1.0384
第6計算期間	(2019年 2月18日)	1,645	1,646	1.0463	1.0468
第7計算期間	(2020年 2月17日)	2,625	2,626	1.1050	1.1055
第8計算期間	(2021年 2月17日)	3,452	3,453	1.0985	1.0990
第9計算期間	(2022年 2月17日)	3,910	3,911	1.0707	1.0712
	2021年 3月末日	3,522		1.0877	
	4月末日	3,602		1.0897	
	5月末日	3,640		1.0917	
	6月末日	3,725		1.0977	
	7月末日	3,839		1.1056	
	8月末日	3,877		1.1087	

9月末日	3,867		1.0973
10月末日	3,900		1.0979
11月末日	3,937		1.0974
12月末日	3,976		1.0955
2022年 1月末日	3,962		1.0827
2月末日	3,910		1.0720
3月末日	3,898		1.0642

【分配の推移】

野村DC運用戦略ファンド(マイルド)

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2013年 3月29日～2014年 2月17日	0.0000円
第2計算期間	2014年 2月18日～2015年 2月17日	0.0005円
第3計算期間	2015年 2月18日～2016年 2月17日	0.0005円
第4計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	0.0005円
第5計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	0.0005円
第6計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0005円
第7計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	0.0005円
第8計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	0.0005円
第9計算期間	2021年 2月18日～2022年 2月17日	0.0005円

【収益率の推移】

野村DC運用戦略ファンド(マイルド)

	計算期間	収益率
第1計算期間	2013年 3月29日～2014年 2月17日	1.1%
第2計算期間	2014年 2月18日～2015年 2月17日	5.2%
第3計算期間	2015年 2月18日～2016年 2月17日	1.1%
第4計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	0.8%
第5計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	0.3%
第6計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.9%
第7計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	5.7%
第8計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	0.5%
第9計算期間	2021年 2月18日～2022年 2月17日	2.5%

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DC運用戦略ファンド（マイルド）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2013年 3月29日～2014年 2月17日	35,000,000		35,000,000
第2計算期間	2014年 2月18日～2015年 2月17日			35,000,000
第3計算期間	2015年 2月18日～2016年 2月17日			35,000,000
第4計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	11,359,814		46,359,814
第5計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	1,085,833,763	217,945,007	914,248,570
第6計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	922,864,885	264,607,400	1,572,506,055
第7計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	1,044,057,179	240,724,073	2,375,839,161
第8計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	1,279,818,925	512,962,915	3,142,695,171
第9計算期間	2021年 2月18日～2022年 2月17日	919,816,988	410,427,376	3,652,084,783

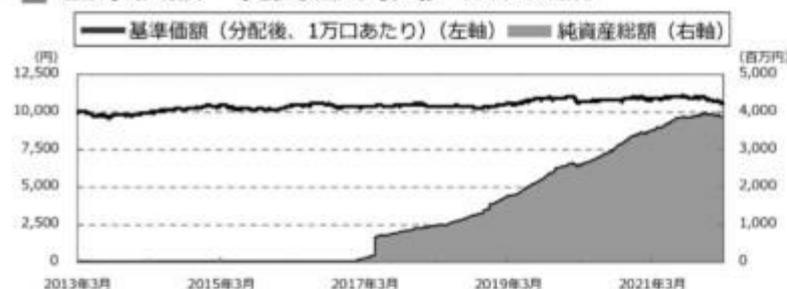
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報



運用実績（2022年3月31日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次；設定来）



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2022年2月	5 円
2021年2月	5 円
2020年2月	5 円
2019年2月	5 円
2018年2月	5 円
設定来累計	40 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	1.2
国内債券マザーファンド	26.8
外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	1.2
外国債券マザーファンド	29.9
新興国株式マザーファンド	0.3
新興国債券マザーファンド	0.6
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	0.4
J-REITインデックス マザーファンド	0.8
海外REITインデックス マザーファンド	0.5
野村マネー マザーファンド	0.2

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	0.0
2	ソニーグループ	電気機器	0.0
3	キーエンス	電気機器	0.0
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.0
5	東京エレクトロン	電気機器	0.0

・「国内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	国庫債券 利付（5年）第139回	国債証券	0.6
2	国庫債券 利付（5年）第140回	国債証券	0.5
3	国庫債券 利付（10年）第332回	国債証券	0.5
4	国庫債券 利付（5年）第141回	国債証券	0.5
5	国庫債券 利付（10年）第350回	国債証券	0.4



運用実績（2022年3月31日現在）

・「外国株式MSCI-KOKUSAマザーファンド」を通じた投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.1
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.0
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.0
4	TESLA INC	自動車	0.0
5	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.0

・「外国債券マザーファンド」を通じた投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	US TREASURY N/B	国債証券	1.1
2	US TREASURY BOND	国債証券	0.9
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.4
4	US TREASURY BOND	国債証券	0.4
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.4

・「新興国株式マザーファンド」を通じた投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.0
2	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	—	0.0
3	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.0
4	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.0
5	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	インターネット販売・通信販売	0.0

・「新興国債券マザーファンド」を通じた投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.0
2	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.0
3	TURKEY GLOBAL	国債証券	0.0
4	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.0
5	REPUBLIC OF PERU	国債証券	0.0

・「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」を通じた投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0
2	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0
3	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0
4	LETRA TESOURO NACIONAL	国債証券	0.0
5	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0

・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じた投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.1
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	0.0
3	GLP投資法人 投資証券	投資証券	0.0
4	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	投資証券	0.0
5	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.0



運用実績（2022年3月31日現在）

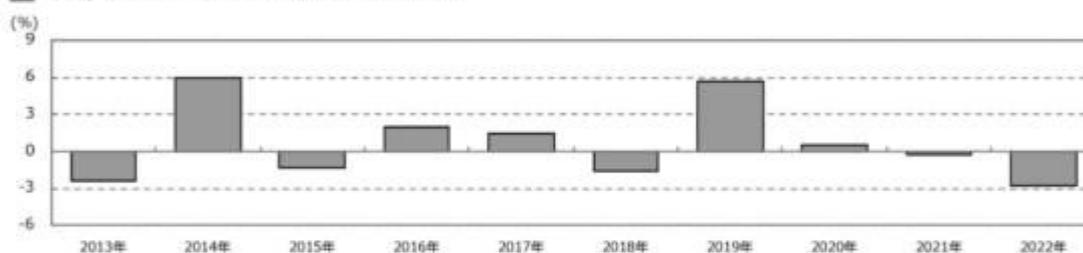
・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	0.0
2	EQUINIX INC	投資証券	0.0
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.0
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.0
5	WELLTOWER INC	投資証券	0.0

・「野村マネー 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	日本学生支援債券 財投機関債第59回	特殊債券	0.0
2	東日本旅客鉄道 第85回社債間限定同順位特約付	社債券	0.0
3	大阪府 公券第361回	地方債証券	0.0
4	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第49回	特殊債券	0.0
5	商工債券 利付（3年）第236回	特殊債券	0.0

年間収益率の推移（暦年ベース）



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2013年は設定日（2013年3月29日）から年末までの収益率。
- ・2022年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- ・ 申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。
- ・ 取得申込みの受付については、午後3時まで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。
- ・ 取得申込日の翌々営業日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。
詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

野村アセットマネジメント株式会社
サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)
< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

- ・ 販売の単位は、1円以上1円単位(当初元本1口=1円)とします。
- ・ 受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・ 金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。)等における取引の停止(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、受益権の取得申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込みの受付を取り消す場合があります。

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

2【換金(解約)手続等】

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社
サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)
< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

- ・当ファンドは、買取りは行いません。
- ・信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口解約には制限を設ける場合があります。
- ・解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して6営業日目から販売会社において支払います。

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、信託約款の規定に従い、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

- ・金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。
- ・一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして信託約款の規定に準じて計算された価額とします。

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

< 基準価額の計算方法 >

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。

公社債等	原則として、基準価額計算日 ¹ における以下のいずれかの価額で評価します。 ² 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く) 価格情報会社の提供する価額
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いません。

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

(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3月29日設定)。

(4) 【計算期間】

原則として、毎年2月18日から翌年2月17日までとします。

また、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。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

(a) ファンドの繰上償還条項

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

(b) 信託期間の終了

()委託者は、上記「(a)ファンドの繰上償還条項」に従い信託期間を終了させるには、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決

議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

(c) 運用報告書

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

(d) 信託約款の変更等

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

- () 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- () 上記()から()までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- () 上記()から()の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

(g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示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。

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、原則、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

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

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2021年2月18日から2022年2月17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DC運用戦略ファンド（マイルド）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 (2021年 2月17日現在)	第9期 (2022年 2月17日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	93,557,927	1,592,052,708
親投資信託受益証券	3,428,331,099	2,367,239,858
流動資産合計	3,521,889,026	3,959,292,566
資産合計	3,521,889,026	3,959,292,566
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	33,392,332	21,729,239
未払金	-	784,736
未払収益分配金	1,571,347	1,826,042
未払解約金	24,062,452	11,735,747
未払受託者報酬	889,391	1,083,827
未払委託者報酬	9,783,220	11,922,002
未払利息	79	1,078
その他未払費用	53,302	64,966
流動負債合計	69,752,123	49,147,637
負債合計	69,752,123	49,147,637
純資産の部		
元本等		
元本	3,142,695,171	3,652,084,783
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	309,441,732	258,060,146
（分配準備積立金）	120,563,589	146,351,334
元本等合計	3,452,136,903	3,910,144,929
純資産合計	3,452,136,903	3,910,144,929
負債純資産合計	3,521,889,026	3,959,292,566

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自 至	2020年 2月18日 2021年 2月17日	自 至	2021年 2月18日 2022年 2月17日
営業収益				
有価証券売買等損益		53,764,858		12,408,759
為替差損益		37,185,283		85,503,849
営業収益合計		16,579,575		73,095,090
営業費用				
支払利息		222,385		134,633
受託者報酬		1,631,512		2,073,096
委託者報酬		17,946,392		22,803,937
その他費用		103,702		130,203
営業費用合計		19,903,991		25,141,869
営業利益又は営業損失（ ）		3,324,416		98,236,959
経常利益又は経常損失（ ）		3,324,416		98,236,959
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,324,416		98,236,959
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（ ）		8,769,091		1,399,409
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		249,546,157		309,441,732
剰余金増加額又は欠損金減少額		107,571,661		87,472,762
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		107,571,661		87,472,762
剰余金減少額又は欠損金増加額		51,549,414		40,190,756
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		51,549,414		40,190,756
分配金		1,571,347		1,826,042
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		309,441,732		258,060,146

(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。 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.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。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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、2021年 2月18日から2022年 2月17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8期 2021年 2月17日現在	第9期 2022年 2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 3,142,695,171口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 3,652,084,783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 1.0985円 (10,000口当たり純資産額) (10,985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 1.0707円 (10,000口当たり純資産額) (10,707円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 2020年 2月18日 至 2021年 2月17日	第9期 自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日																																				
1.分配金の計算過程	1.分配金の計算過程																																				
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>27,910,361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>302,186,802円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>94,224,575円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>424,321,738円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	27,910,361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	302,186,802円	分配準備積立金額	D	94,224,575円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	424,321,738円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>41,172,582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>385,573,182円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>107,004,794円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>533,750,558円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	41,172,582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	385,573,182円	分配準備積立金額	D	107,004,794円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	533,750,558円
項目																																					
費用控除後の配当等収益額	A	27,910,361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	302,186,802円																																			
分配準備積立金額	D	94,224,575円																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	424,321,738円																																			
項目																																					
費用控除後の配当等収益額	A	41,172,582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	385,573,182円																																			
分配準備積立金額	D	107,004,794円																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	533,750,558円																																			

当ファンドの期末残存口数	F	3,142,695,171口	当ファンドの期末残存口数	F	3,652,084,783口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,350円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,461円
10,000口当たり分配金額	H	5円	10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	1,571,347円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	1,826,042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8期 自 2020年 2月18日 至 2021年 2月17日	第9期 自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>当ファンドは、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が、主要投資対象である親投資信託受益証券の保有状況によっては、市場リスクの内容は変動する場合があります。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第8期 2021年 2月17日現在	第9期 2022年 2月17日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2. 時価の算定方法 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。</p> <p>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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時 価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としてお ります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第8期 自 2020年 2月18日 至 2021年 2月17日	第9期 自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17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8期 自 2020年 2月18日 至 2021年 2月17日	第9期 自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日
期首元本額 2,375,839,161円	期首元本額 3,142,695,171円
期中追加設定元本額 1,279,818,925円	期中追加設定元本額 919,816,988円
期中一部解約元本額 512,962,915円	期中一部解約元本額 410,427,376円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第8期 自 2020年 2月18日 至 2021年 2月17日	第9期 自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17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	101,976,285	17,186,464
合計	101,976,285	17,186,464

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8期(2021年 2月17日現在)				第9期(2022年 2月17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	1,512,895,668	-	1,546,288,000	33,392,332	1,178,782,617	-	1,200,511,856	21,729,239
米ドル	688,892,696	-	704,902,400	16,009,704	534,360,860	-	542,700,540	8,339,680
カナダドル	87,330,725	-	89,366,400	2,035,675	64,714,298	-	65,523,096	808,798
ユーロ	505,337,080	-	513,400,000	8,062,920	437,065,408	-	446,258,151	9,192,743
英ポンド	133,534,050	-	138,396,200	4,862,150	72,016,234	-	73,745,162	1,728,928
豪ドル	97,801,117	-	100,223,000	2,421,883	70,625,817	-	72,284,907	1,659,090
合計	1,512,895,668	-	1,546,288,000	33,392,332	1,178,782,617	-	1,200,511,856	21,729,239

（注）時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年2月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	19,667,413	40,172,657	
		国内債券マザーファンド	749,301,921	1,001,741,738	
		外国債券マザーファンド	473,972,881	1,186,354,121	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	8,579,851	37,799,391	
		野村マネー マザーファンド	7,492,405	7,641,503	
		J-REITインデックス マザーファンド	8,923,881	22,923,665	
		海外REITインデックス マザーファンド	4,874,675	15,259,682	
		新興国株式マザーファンド	10,444,339	17,226,892	
		新興国債券マザーファンド	11,130,886	22,669,162	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	10,780,051	15,451,047	
	小計	銘柄数: 10 組入時価比率: 60.5%	1,305,168,303	2,367,239,858	100.0%
合計			2,367,239,858		

(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、当該計算期間末現在、主要投資対象である親投資信託受益証券のうち、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」および「野村マネー マザーファンド」受益証券に投資しており、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)

(2022年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,312,190,625

株式	413,338,987,610
派生商品評価勘定	123,612,957
未収入金	1,812,030
未収配当金	612,415,777
未収利息	341,259
その他未収収益	24,927,169
差入委託証拠金	55,516,908
流動資産合計	425,469,804,335
資産合計	425,469,804,335
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	998,910
未払金	257,400
未払解約金	334,742,042
未払利息	7,661
有価証券貸借取引受入金	6,166,509,108
流動負債合計	6,502,515,121
負債合計	6,502,515,121
純資産の部	
元本等	
元本	205,117,643,737
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	213,849,645,477
元本等合計	418,967,289,214
純資産合計	418,967,289,214
負債純資産合計	425,469,804,335

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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年 2月17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	2,0426円
(10,000口当たり純資産額)	(20,426円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	
	5,921,533,010円

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月17日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p>

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 2月17日現在	
期首	2021年 2月18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	205,869,301,151円
同期中における追加設定元本額	38,832,292,880円
同期中における一部解約元本額	39,583,950,294円
期末元本額	205,117,643,737円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	136,695,188円
バランスセレクト50	310,343,352円
バランスセレクト70	450,413,371円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,287,648,374円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,945,636,287円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	8,067,711,223円
野村資産設計ファンド2015	37,832,007円
野村資産設計ファンド2020	37,909,337円
野村資産設計ファンド2025	68,361,850円
野村資産設計ファンド2030	100,404,662円
野村資産設計ファンド2035	85,327,811円
野村資産設計ファンド2040	161,434,105円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	13,881,539,093円
のむらップ・ファンド（保守型）	2,432,868,853円
のむらップ・ファンド（普通型）	12,285,155,615円
のむらップ・ファンド（積極型）	4,189,859,500円
野村資産設計ファンド2045	30,414,869円
野村インデックスファンド・TOPIX	2,225,002,030円
マイ・ロード	3,330,640,447円
ネクストコア	8,571,233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	1,453,299,410円
野村TOPIXインデックス（野村SMA・EW向け）	2,688,977,628円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,147,902,070円
野村資産設計ファンド2050	39,819,265円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	12,507,849円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	6,787,156円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	5,316,249円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	4,449,455円
のむらップ・ファンド（やや保守型）	404,404,664円

のむラップ・ファンド(やや積極型)	627,628,962円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,410,414円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,273,856円
インデックス・ブレンド(タイプ)	24,307,302円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,912,992円
インデックス・ブレンド(タイプ)	29,515,451円
野村6資産均等バランス	2,684,668,224円
世界6資産分散ファンド	81,576,711円
野村資産設計ファンド2060	27,965,436円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	1,609,113,627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)	292,298,084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)	142,454,928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)	444,130,331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)	346,958,616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)	3,359,796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)	7,565,484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)	1,039,990円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,322,675,361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)	5,841,489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)	55,749,742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)	62,210,792円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	13,444,599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)	92,139,026円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	190,188,786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)	4,249,277,405円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	47,073,189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)	321,362,885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)	1,798,043,380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)	120,558,882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)	64,251,150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)	2,648,879円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	5,882,772円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	28,406,785円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	33,411,150円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	117,385,793円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	8,993,820,345円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	25,248,778,287円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	29,042,152,686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)	34,925,854,629円
マイバランスDC30	3,344,975,365円
マイバランスDC50	5,709,099,040円
マイバランスDC70	6,051,434,584円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,957,389,579円
野村DC運用戦略ファンド	231,411,950円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	19,667,413円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	1,422,387,032円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,198,912,306円

マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,066,214,840円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	12,105,843円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	5,505,854円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	89,523,706円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	27,555,407円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	24,337,013円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	19,525,978円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	563,288,459円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	471,904,747円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	292,385,068円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	407,722,491円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	13,609,980円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	95,281,374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)	174,515,631円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	4,318,908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(2022年2月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	7,400	3,225.00	23,865,000	貸付有価証券 200株
		日本水産	212,700	571.00	121,451,700	
		マルハニチロ	33,300	2,647.00	88,145,100	
		雪国まいたけ	15,500	1,218.00	18,879,000	
		カネコ種苗	6,000	1,568.00	9,408,000	
		サカタのタネ	25,400	3,395.00	86,233,000	貸付有価証券 100株
		ホクト	17,800	1,965.00	34,977,000	貸付有価証券 1,100株
		ホクリヨウ	2,900	688.00	1,995,200	
		住石ホールディングス	37,200	138.00	5,133,600	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
		日鉄鉱業	4,900	6,490.00	31,801,000	
		三井松島ホールディングス	8,900	1,662.00	14,791,800	貸付有価証券 1,800株(1,500株)

INPEX	853,200	1,170.00	998,244,000	貸付有価証券 400株
石油資源開発	25,000	2,810.00	70,250,000	
K&Oエナジーグループ	9,600	1,561.00	14,985,600	
ヒノキヤグループ	4,600	2,355.00	10,833,000	
ショーボンドホールディングス	30,300	5,260.00	159,378,000	貸付有価証券 6,500株
ミライト・ホールディングス	68,500	1,956.00	133,986,000	
タマホーム	12,900	2,342.00	30,211,800	貸付有価証券 6,000株（100株）
サンヨーホームズ	2,500	752.00	1,880,000	貸付有価証券 100株
日本アクア	8,500	593.00	5,040,500	貸付有価証券 100株
ファーストコーポレーション	5,200	729.00	3,790,800	貸付有価証券 200株
ベステラ	4,200	1,294.00	5,434,800	貸付有価証券 1,900株
Robot Home	35,400	211.00	7,469,400	貸付有価証券 3,600株（3,300株）
キャンディル	3,700	491.00	1,816,700	貸付有価証券 1,500株
スペースバリューホールディングス	5,200	1,147.00	5,964,400	貸付有価証券 1,000株
ダイセキ環境ソリューション	4,100	1,122.00	4,600,200	
第一カッター興業	5,300	1,351.00	7,160,300	
安藤・間	105,600	936.00	98,841,600	貸付有価証券 49,600株
東急建設	62,300	733.00	45,665,900	
コムシスホールディングス	68,600	2,799.00	192,011,400	
ビーアールホールディングス	28,900	349.00	10,086,100	貸付有価証券 100株
高松コンストラクショングループ	13,200	2,015.00	26,598,000	
東建コーポレーション	5,900	9,230.00	54,457,000	
ソネック	2,200	1,031.00	2,268,200	貸付有価証券 900株
ヤマウラ	10,300	989.00	10,186,700	貸付有価証券

				4,400株
オリエンタル白石	71,500	245.00	17,517,500	貸付有価証券 100株
大成建設	141,900	3,840.00	544,896,000	
大林組	491,100	974.00	478,331,400	
清水建設	460,100	780.00	358,878,000	
飛島建設	13,100	1,106.00	14,488,600	
長谷工コーポレーション	146,300	1,532.00	224,131,600	
松井建設	19,300	743.00	14,339,900	
銭高組	2,100	4,100.00	8,610,000	
鹿島建設	359,900	1,587.00	571,161,300	貸付有価証券 400株
不動テトラ	10,400	1,575.00	16,380,000	
大末建設	5,200	1,343.00	6,983,600	
鉄建建設	10,700	1,938.00	20,736,600	
西松建設	29,700	3,855.00	114,493,500	貸付有価証券 900株
三井住友建設	110,700	454.00	50,257,800	
大豊建設	7,200	3,670.00	26,424,000	貸付有価証券 3,200株
佐田建設	10,600	467.00	4,950,200	
ナカノフード建設	11,700	347.00	4,059,900	
奥村組	28,900	3,265.00	94,358,500	
東鉄工業	22,800	2,562.00	58,413,600	
イチケン	3,500	1,939.00	6,786,500	
富士ピー・エス	6,300	498.00	3,137,400	貸付有価証券 2,900株
浅沼組	5,500	5,370.00	29,535,000	
戸田建設	203,900	771.00	157,206,900	貸付有価証券 100株
熊谷組	25,000	2,911.00	72,775,000	
北野建設	3,000	2,172.00	6,516,000	
植木組	4,300	1,517.00	6,523,100	貸付有価証券 1,400株
矢作建設工業	21,700	793.00	17,208,100	
ピーエス三菱	16,200	613.00	9,930,600	
日本ハウスホールディングス	33,500	455.00	15,242,500	貸付有価証券 200株
大東建託	50,300	12,900.00	648,870,000	

新日本建設	20,900	761.00	15,904,900	
N I P P O	11,600	3,985.00	46,226,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
東亜道路工業	2,500	5,020.00	12,550,000	貸付有価証券 100株
日本道路	4,700	9,810.00	46,107,000	貸付有価証券 2,200株(500株)
東亜建設工業	12,000	2,670.00	32,040,000	貸付有価証券 5,600株(5,300株)
日本国土開発	47,800	531.00	25,381,800	
若築建設	8,200	1,931.00	15,834,200	
東洋建設	55,100	589.00	32,453,900	
五洋建設	194,700	630.00	122,661,000	
世紀東急工業	23,600	816.00	19,257,600	
福田組	5,200	4,355.00	22,646,000	貸付有価証券 2,400株
住友林業	125,700	2,338.00	293,886,600	貸付有価証券 28,200株
日本基礎技術	13,500	675.00	9,112,500	
巴コーポレーション	21,800	508.00	11,074,400	
大和ハウス工業	453,500	3,336.00	1,512,876,000	貸付有価証券 1,000株
ライト工業	30,900	1,936.00	59,822,400	
積水ハウス	532,700	2,376.00	1,265,695,200	
日特建設	10,100	737.00	7,443,700	
北陸電気工事	10,200	809.00	8,251,800	
ユアテック	28,100	730.00	20,513,000	
日本リーテック	10,300	1,519.00	15,645,700	
四電工	5,300	1,594.00	8,448,200	
中電工	22,600	2,167.00	48,974,200	
関電工	79,900	879.00	70,232,100	
きんでん	109,700	1,662.00	182,321,400	
東京エネシス	16,300	945.00	15,403,500	
トーエネック	4,900	3,255.00	15,949,500	
住友電設	12,100	2,241.00	27,116,100	
日本電設工業	26,900	1,573.00	42,313,700	
エクシオグループ	73,800	2,432.00	179,481,600	
新日本空調	13,000	2,051.00	26,663,000	

九電工	37,900	3,100.00	117,490,000	
三機工業	31,900	1,483.00	47,307,700	
日揮ホールディングス	151,300	1,115.00	168,699,500	
中外炉工業	4,900	1,573.00	7,707,700	
ヤマト	14,400	702.00	10,108,800	
太平電業	10,900	2,726.00	29,713,400	
高砂熱学工業	44,400	2,016.00	89,510,400	
三晃金属工業	1,900	2,513.00	4,774,700	
朝日工業社	3,300	3,000.00	9,900,000	
明星工業	31,800	725.00	23,055,000	
大気社	23,900	3,185.00	76,121,500	
ダイダン	10,900	2,318.00	25,266,200	
日比谷総合設備	15,800	1,888.00	29,830,400	貸付有価証券 100株
フィル・カンパニー	2,800	1,191.00	3,334,800	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
テスホールディングス	10,200	1,289.00	13,147,800	
インフロニア・ホールディングス	209,400	1,061.00	222,173,400	貸付有価証券 1,500株
レイズネクスト	23,700	1,143.00	27,089,100	
ニッポン	46,000	1,702.00	78,292,000	
日清製粉グループ本社	177,600	1,687.00	299,611,200	
日東富士製粉	2,300	4,550.00	10,465,000	
昭和産業	14,900	2,683.00	39,976,700	
鳥越製粉	13,900	667.00	9,271,300	貸付有価証券 400株（400株）
中部飼料	17,700	1,060.00	18,762,000	
フィード・ワン	21,100	688.00	14,516,800	
東洋精糖	2,700	1,101.00	2,972,700	
日本甜菜製糖	8,200	1,723.00	14,128,600	
D M三井製糖ホールディングス	14,300	2,013.00	28,785,900	
塩水港精糖	18,700	215.00	4,020,500	
日新製糖	7,400	1,788.00	13,231,200	
森永製菓	36,900	3,645.00	134,500,500	
中村屋	3,800	3,390.00	12,882,000	貸付有価証券 1,700株
江崎グリコ	43,300	3,905.00	169,086,500	

名糖産業	6,900	1,677.00	11,571,300	
井村屋グループ	8,900	2,312.00	20,576,800	
不二家	8,800	2,491.00	21,920,800	貸付有価証券 3,900株
山崎製パン	117,800	1,519.00	178,938,200	
第一屋製パン	3,000	571.00	1,713,000	
モロゾフ	5,000	2,707.00	13,535,000	
亀田製菓	9,000	4,135.00	37,215,000	
寿スピリッツ	15,100	5,960.00	89,996,000	貸付有価証券 100株
カルビー	71,600	2,540.00	181,864,000	貸付有価証券 1,700株
森永乳業	29,100	5,650.00	164,415,000	
六甲バター	11,500	1,560.00	17,940,000	貸付有価証券 5,300株
ヤクルト本社	116,400	6,100.00	710,040,000	
明治ホールディングス	103,900	6,840.00	710,676,000	
雪印メグミルク	37,800	1,981.00	74,881,800	
プリマハム	19,700	2,359.00	46,472,300	
日本ハム	60,100	4,390.00	263,839,000	
林兼産業	4,800	507.00	2,433,600	
丸大食品	15,500	1,527.00	23,668,500	
S Foods	14,100	3,250.00	45,825,000	貸付有価証券 2,200株(600株)
柿安本店	5,400	2,600.00	14,040,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	101,200	686.00	69,423,200	
サッポロホールディングス	53,600	2,424.00	129,926,400	貸付有価証券 2,700株
アサヒグループホールディングス	369,800	5,219.00	1,929,986,200	貸付有価証券 11,000株
キリンホールディングス	577,700	2,003.50	1,157,421,950	
宝ホールディングス	106,800	1,169.00	124,849,200	
オエノンホールディングス	44,600	344.00	15,342,400	
養命酒製造	4,800	1,777.00	8,529,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	110,300	1,530.00	168,759,000	貸付有価証券 2,200株
サントリー食品インター	105,200	4,590.00	482,868,000	貸付有価証券

ナショナル				14,100株
ダイトーグループホールディングス	8,100	5,140.00	41,634,000	貸付有価証券 700株
伊藤園	47,700	6,730.00	321,021,000	貸付有価証券 200株
キーコーヒー	15,400	2,074.00	31,939,600	
ユニカフェ	4,700	967.00	4,544,900	貸付有価証券 2,200株(100株)
ジャパンフーズ	2,200	1,229.00	2,703,800	
日清オイリオグループ	19,700	2,990.00	58,903,000	
不二製油グループ本社	34,100	2,231.00	76,077,100	
かどや製油	1,700	3,530.00	6,001,000	
J-オイルミルズ	14,700	1,732.00	25,460,400	
キッコーマン	113,100	8,870.00	1,003,197,000	
味の素	347,100	3,303.00	1,146,471,300	
ブルドックソース	6,600	2,012.00	13,279,200	貸付有価証券 3,100株(200株)
キューピー	82,600	2,463.00	203,443,800	
ハウス食品グループ本社	58,800	3,025.00	177,870,000	
カゴメ	59,600	3,005.00	179,098,000	貸付有価証券 800株
焼津水産化学工業	7,600	912.00	6,931,200	
アリアケジャパン	14,400	5,760.00	82,944,000	
ピエトロ	2,100	1,808.00	3,796,800	貸付有価証券 900株
エバラ食品工業	3,400	2,816.00	9,574,400	
やまみ	1,400	1,892.00	2,648,800	
ニチレイ	71,700	2,610.00	187,137,000	
東洋水産	75,500	4,930.00	372,215,000	
イトアンドホールディングス	5,900	2,318.00	13,676,200	貸付有価証券 2,700株
大冷	1,800	1,896.00	3,412,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,100	526.00	4,260,600	貸付有価証券 2,200株(600株)
日清食品ホールディングス	61,700	9,080.00	560,236,000	
永谷園ホールディングス	7,000	1,984.00	13,888,000	
一正蒲鉾	6,800	794.00	5,399,200	
フジッコ	14,600	1,960.00	28,616,000	

ロック・フィールド	16,900	1,582.00	26,735,800	貸付有価証券 7,500株
日本たばこ産業	842,800	2,350.00	1,980,580,000	貸付有価証券 24,900株
ケンコーマヨネーズ	8,800	1,451.00	12,768,800	
わらべや日洋ホールディングス	10,300	1,852.00	19,075,600	貸付有価証券 3,900株（1,000株）
なとり	8,800	2,065.00	18,172,000	貸付有価証券 4,000株
イフジ産業	2,700	938.00	2,532,600	
ピクルスコーポレーション	7,500	1,547.00	11,602,500	貸付有価証券 800株（100株）
ファーマフーズ	14,800	1,648.00	24,390,400	貸付有価証券 6,700株（1,900株）
ユーグレナ	80,000	805.00	64,400,000	貸付有価証券 37,600株（32,200株）
紀文食品	9,200	1,195.00	10,994,000	
ミヨシ油脂	6,000	1,139.00	6,834,000	貸付有価証券 2,800株
理研ビタミン	16,300	1,726.00	28,133,800	
片倉工業	17,100	2,257.00	38,594,700	貸付有価証券 4,700株
グンゼ	10,300	3,870.00	39,861,000	
東洋紡	60,600	1,270.00	76,962,000	
ユニチカ	42,100	310.00	13,051,000	
富士紡ホールディングス	6,800	3,700.00	25,160,000	
倉敷紡績	13,100	1,944.00	25,466,400	
シキボウ	8,000	915.00	7,320,000	
日本毛織	46,300	890.00	41,207,000	貸付有価証券 2,100株
ダイトウボウ	24,800	89.00	2,207,200	貸付有価証券 1,300株（1,000株）
トーア紡コーポレーション	5,700	411.00	2,342,700	
ダイドーリミテッド	20,200	148.00	2,989,600	貸付有価証券 9,100株
帝国繊維	17,300	1,935.00	33,475,500	貸付有価証券 7,700株
帝人	144,400	1,416.00	204,470,400	
東レ	1,110,600	680.30	755,541,180	貸付有価証券

				2,300株
住江織物	3,000	1,960.00	5,880,000	
日本フェルト	8,700	448.00	3,897,600	貸付有価証券 100株
イチカワ	2,000	1,415.00	2,830,000	
日東製網	1,600	1,454.00	2,326,400	
アツギ	11,800	612.00	7,221,600	
ダイニック	5,800	741.00	4,297,800	
セーレン	31,400	2,188.00	68,703,200	貸付有価証券 3,000株(200株)
ソトー	5,600	840.00	4,704,000	
東海染工	1,800	1,167.00	2,100,600	
小松マテーレ	25,200	1,291.00	32,533,200	
ワコールホールディングス	38,300	2,050.00	78,515,000	
ホギメディカル	20,700	3,250.00	67,275,000	
クラウディアホールディングス	3,800	240.00	912,000	
T S Iホールディングス	51,200	330.00	16,896,000	
マツオカコーポレーション	4,900	1,172.00	5,742,800	
ワールド	20,100	1,250.00	25,125,000	
三陽商会	7,400	876.00	6,482,400	貸付有価証券 200株
ナイガイ	5,200	280.00	1,456,000	
オンワードホールディングス	92,100	294.00	27,077,400	貸付有価証券 8,400株
ルックホールディングス	4,900	1,579.00	7,737,100	
ゴールドウイン	27,700	6,150.00	170,355,000	
デサント	29,900	3,140.00	93,886,000	
キング	7,200	536.00	3,859,200	
ヤマトインターナショナル	13,500	290.00	3,915,000	貸付有価証券 2,800株
特種東海製紙	9,400	4,195.00	39,433,000	
王子ホールディングス	641,200	624.00	400,108,800	
日本製紙	73,500	1,165.00	85,627,500	貸付有価証券 2,800株
三菱製紙	21,800	324.00	7,063,200	
北越コーポレーション	100,600	741.00	74,544,600	貸付有価証券

				31,900株
中越パルプ工業	5,800	1,013.00	5,875,400	
巴川製紙所	4,500	876.00	3,942,000	
大王製紙	74,000	1,787.00	132,238,000	
阿波製紙	4,000	326.00	1,304,000	
レンゴー	145,000	871.00	126,295,000	貸付有価証券 500株
トーモク	9,400	1,750.00	16,450,000	
ザ・パック	11,600	2,736.00	31,737,600	貸付有価証券 100株
北の達人コーポレーション	54,900	220.00	12,078,000	貸付有価証券 24,600株（14,500株）
クラレ	224,300	1,105.00	247,851,500	貸付有価証券 9,700株
旭化成	1,016,600	1,119.50	1,138,083,700	貸付有価証券 1,600株
共和レザー	9,500	680.00	6,460,000	
昭和電工	133,000	2,327.00	309,491,000	貸付有価証券 9,100株
住友化学	1,126,900	563.00	634,444,700	貸付有価証券 4,300株
住友精化	6,800	3,370.00	22,916,000	
日産化学	83,400	6,560.00	547,104,000	
ラサ工業	5,400	1,627.00	8,785,800	
クレハ	12,100	9,210.00	111,441,000	
多木化学	6,000	4,920.00	29,520,000	貸付有価証券 2,000株（900株）
テイカ	11,300	1,338.00	15,119,400	
石原産業	25,500	1,104.00	28,152,000	
片倉コープアグリ	3,500	1,173.00	4,105,500	
日本曹達	19,600	3,450.00	67,620,000	
東ソー	221,300	1,875.00	414,937,500	
トクヤマ	49,100	1,921.00	94,321,100	
セントラル硝子	25,100	2,104.00	52,810,400	
東亜合成	85,200	1,108.00	94,401,600	貸付有価証券 1,000株
大阪ソーダ	14,300	3,145.00	44,973,500	
関東電化工業	33,600	1,173.00	39,412,800	
デンカ	56,000	3,605.00	201,880,000	

信越化学工業	263,400	18,245.00	4,805,733,000	貸付有価証券 500株
日本カーバイド工業	5,500	1,446.00	7,953,000	
堺化学工業	10,700	2,049.00	21,924,300	貸付有価証券 3,500株
第一稀元素化学工業	14,200	1,014.00	14,398,800	
エア・ウォーター	145,200	1,721.00	249,889,200	
日本酸素ホールディングス	147,400	2,337.00	344,473,800	貸付有価証券 100株
日本化学工業	4,800	2,558.00	12,278,400	
東邦アセチレン	2,600	1,232.00	3,203,200	貸付有価証券 200株
日本パーカライジング	77,400	1,018.00	78,793,200	貸付有価証券 100株
高压ガス工業	24,300	703.00	17,082,900	
チタン工業	1,800	1,681.00	3,025,800	
四国化成工業	20,000	1,455.00	29,100,000	
戸田工業	3,300	2,708.00	8,936,400	
ステラ ケミファ	7,700	2,446.00	18,834,200	
保土谷化学工業	4,900	4,400.00	21,560,000	
日本触媒	25,800	5,890.00	151,962,000	
大日精化工業	12,700	2,214.00	28,117,800	
カネカ	39,700	3,850.00	152,845,000	
三菱瓦斯化学	142,700	2,077.00	296,387,900	貸付有価証券 1,700株
三井化学	139,300	3,030.00	422,079,000	
J S R	142,900	3,490.00	498,721,000	
東京応化工業	24,900	7,150.00	178,035,000	
大阪有機化学工業	13,100	3,110.00	40,741,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,025,400	845.10	866,565,540	貸付有価証券 4,200株
K H ネオケム	25,300	2,852.00	72,155,600	
ダイセル	220,900	901.00	199,030,900	
住友ベークライト	24,100	5,070.00	122,187,000	
積水化学工業	321,000	1,980.00	635,580,000	貸付有価証券 400株
日本ゼオン	138,300	1,370.00	189,471,000	貸付有価証券 200株
アイカ工業	42,700	3,285.00	140,269,500	

宇部興産	72,300	2,213.00	159,999,900	
積水樹脂	23,200	1,969.00	45,680,800	
タキロンシーアイ	33,200	568.00	18,857,600	
旭有機材	8,700	2,101.00	18,278,700	
ニチバン	9,100	1,766.00	16,070,600	貸付有価証券 500株
リケンテクノス	37,400	465.00	17,391,000	
大倉工業	7,800	1,911.00	14,905,800	
積水化成成品工業	20,600	462.00	9,517,200	
群栄化学工業	3,500	3,545.00	12,407,500	
タイガースポリマー	8,100	458.00	3,709,800	
ミライアル	4,900	1,553.00	7,609,700	
ダイキアクシス	6,000	720.00	4,320,000	貸付有価証券 2,800株
ダイキョーニシカワ	32,300	591.00	19,089,300	
竹本容器	5,500	789.00	4,339,500	
森六ホールディングス	8,200	1,972.00	16,170,400	
恵和	4,200	4,595.00	19,299,000	
日本化薬	120,800	1,164.00	140,611,200	
カーリットホールディングス	15,200	705.00	10,716,000	
日本精化	12,300	1,954.00	24,034,200	
扶桑化学工業	13,800	4,695.00	64,791,000	
トリケミカル研究所	15,800	2,875.00	45,425,000	貸付有価証券 2,000株
A D E K A	70,600	2,707.00	191,114,200	
日油	52,400	5,210.00	273,004,000	
新日本理化	25,400	245.00	6,223,000	
ハリマ化成グループ	11,400	823.00	9,382,200	
花王	346,400	5,224.00	1,809,593,600	
第一工業製薬	5,700	2,770.00	15,789,000	
石原ケミカル	7,700	1,324.00	10,194,800	
日華化学	5,200	779.00	4,050,800	貸付有価証券 100株
ニイタカ	3,200	2,328.00	7,449,600	
三洋化成工業	9,200	5,130.00	47,196,000	
有機合成薬品工業	10,700	271.00	2,899,700	
大日本塗料	18,800	820.00	15,416,000	

日本ペイントホールディングス	576,300	1,022.00	588,978,600	貸付有価証券 12,300株
関西ペイント	159,100	2,457.00	390,908,700	
神東塗料	12,100	153.00	1,851,300	貸付有価証券 300株
中国塗料	36,200	902.00	32,652,400	
日本特殊塗料	11,500	871.00	10,016,500	
藤倉化成	19,100	460.00	8,786,000	
太陽ホールディングス	22,600	3,140.00	70,964,000	
D I C	64,800	2,757.00	178,653,600	貸付有価証券 3,600株
サカタインクス	30,400	961.00	29,214,400	貸付有価証券 1,400株
東洋インキ S C ホールディングス	32,400	1,934.00	62,661,600	
T & K T O K A	12,400	904.00	11,209,600	
富士フイルムホールディングス	275,200	7,633.00	2,100,601,600	
資生堂	291,700	6,731.00	1,963,432,700	
ライオン	189,100	1,470.00	277,977,000	貸付有価証券 1,500株
高砂香料工業	10,800	2,750.00	29,700,000	
マンダム	32,900	1,379.00	45,369,100	
ミルボン	19,300	6,010.00	115,993,000	
ファンケル	63,400	3,270.00	207,318,000	貸付有価証券 400株
コーセー	29,500	13,320.00	392,940,000	貸付有価証券 100株
コタ	9,900	1,578.00	15,622,200	
シーボン	2,000	1,831.00	3,662,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	66,800	1,834.00	122,511,200	貸付有価証券 2,200株
ノエビアホールディングス	13,300	5,210.00	69,293,000	
アジュバンホールディングス	3,500	1,126.00	3,941,000	
新日本製薬	4,300	1,389.00	5,972,700	
エステー	10,100	1,566.00	15,816,600	貸付有価証券 200株
アグロ カネショウ	5,200	1,258.00	6,541,600	貸付有価証券

				2,300株
コニシ	25,700	1,596.00	41,017,200	
長谷川香料	27,000	2,362.00	63,774,000	
星光P M C	8,800	613.00	5,394,400	
小林製薬	43,900	9,870.00	433,293,000	貸付有価証券 200株
荒川化学工業	13,100	1,131.00	14,816,100	
メック	11,700	3,055.00	35,743,500	
日本高純度化学	4,300	2,551.00	10,969,300	
タカラバイオ	41,000	2,368.00	97,088,000	
J C U	17,600	4,775.00	84,040,000	
新田ゼラチン	9,800	661.00	6,477,800	
O A T アグリオ	3,200	1,885.00	6,032,000	
デクセリアルズ	40,700	3,040.00	123,728,000	貸付有価証券 1,800株
アース製薬	12,900	5,590.00	72,111,000	
北興化学工業	14,600	854.00	12,468,400	
大成ラミック	4,800	2,746.00	13,180,800	
クミアイ化学工業	58,300	814.00	47,456,200	
日本農薬	27,900	539.00	15,038,100	
アキレス	10,000	1,288.00	12,880,000	
有沢製作所	22,900	1,005.00	23,014,500	
日東電工	94,700	8,610.00	815,367,000	
レック	20,400	955.00	19,482,000	
三光合成	17,900	364.00	6,515,600	貸付有価証券 400株
きもと	24,000	211.00	5,064,000	貸付有価証券 200株
藤森工業	14,100	4,135.00	58,303,500	
前澤化成工業	9,900	1,269.00	12,563,100	貸付有価証券 3,300株(100株)
未来工業	5,600	1,523.00	8,528,800	
ウェーブロックホール ディングス	5,900	710.00	4,189,000	
J S P	9,200	1,608.00	14,793,600	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	28,800	3,310.00	95,328,000	
天馬	12,300	2,596.00	31,930,800	

信越ポリマー	28,100	1,122.00	31,528,200	
東リ	39,000	225.00	8,775,000	
ニフコ	52,300	3,585.00	187,495,500	貸付有価証券 100株
バルカー	12,700	2,536.00	32,207,200	
ユニ・チャーム	301,900	4,242.00	1,280,659,800	貸付有価証券 2,500株
ショーエイコーポレーション	4,200	634.00	2,662,800	貸付有価証券 200株(200株)
協和キリン	183,800	3,050.00	560,590,000	貸付有価証券 16,700株
武田薬品工業	1,230,900	3,543.00	4,361,078,700	貸付有価証券 2,000株
アステラス製薬	1,357,900	2,018.00	2,740,242,200	貸付有価証券 900株
大日本住友製薬	96,700	1,272.00	123,002,400	
塩野義製薬	197,000	7,634.00	1,503,898,000	貸付有価証券 700株
わかもと製薬	18,600	296.00	5,505,600	貸付有価証券 900株
日本新薬	41,000	7,670.00	314,470,000	
中外製薬	489,800	3,868.00	1,894,546,400	
科研製薬	24,600	4,205.00	103,443,000	
エーザイ	187,500	5,907.00	1,107,562,500	
ロート製薬	80,400	3,680.00	295,872,000	
小野薬品工業	359,600	2,853.00	1,025,938,800	
久光製薬	41,400	3,725.00	154,215,000	
持田製薬	19,800	3,835.00	75,933,000	
参天製薬	292,000	1,293.00	377,556,000	
扶桑薬品工業	5,500	2,330.00	12,815,000	
日本ケミファ	1,900	2,192.00	4,164,800	
ツムラ	48,500	3,260.00	158,110,000	
日医工	48,600	830.00	40,338,000	貸付有価証券 300株
キッセイ薬品工業	27,700	2,443.00	67,671,100	
生化学工業	27,600	905.00	24,978,000	
栄研化学	27,500	1,743.00	47,932,500	
日水製薬	5,800	987.00	5,724,600	
鳥居薬品	8,400	2,922.00	24,544,800	

J C R ファーマ	44,100	2,161.00	95,300,100	
東和薬品	22,500	3,100.00	69,750,000	
富士製薬工業	9,600	1,018.00	9,772,800	
ゼリア新薬工業	28,400	1,982.00	56,288,800	貸付有価証券 900株
第一三共	1,230,700	2,483.50	3,056,443,450	貸付有価証券 500株
キョーリン製薬ホールディングス	31,400	1,853.00	58,184,200	
大幸薬品	23,600	659.00	15,552,400	貸付有価証券 8,900株
ダイト	10,100	2,933.00	29,623,300	
大塚ホールディングス	325,500	4,001.00	1,302,325,500	貸付有価証券 200株
大正製薬ホールディングス	37,300	5,720.00	213,356,000	
ペプチドリーム	82,200	2,063.00	169,578,600	貸付有価証券 300株
あすか製薬ホールディングス	17,800	1,070.00	19,046,000	
サワイグループホールディングス	34,300	4,450.00	152,635,000	
日本コークス工業	132,300	138.00	18,257,400	
ニチレキ	20,000	1,319.00	26,380,000	
ユシロ化学工業	8,100	1,068.00	8,650,800	
ビーピー・カストロール	5,600	1,293.00	7,240,800	
富士石油	41,800	266.00	11,118,800	
MORESCO	5,200	1,156.00	6,011,200	貸付有価証券 400株(100株)
出光興産	173,800	3,085.00	536,173,000	
ENEOSホールディングス	2,356,000	460.50	1,084,938,000	
コスモエネルギーホールディングス	45,300	2,538.00	114,971,400	
横浜ゴム	90,700	1,774.00	160,901,800	
TOYO TIRE	82,400	1,617.00	133,240,800	
ブリヂストン	451,100	5,263.00	2,374,139,300	貸付有価証券 47,500株
住友ゴム工業	140,700	1,183.00	166,448,100	貸付有価証券 20,800株

藤倉コンポジット	12,500	710.00	8,875,000	
オカモト	9,300	4,110.00	38,223,000	
フコク	6,800	950.00	6,460,000	貸付有価証券 100株
ニッタ	16,200	2,789.00	45,181,800	
住友理工	30,400	615.00	18,696,000	
三ツ星ベルト	19,000	2,123.00	40,337,000	
バンドー化学	25,300	867.00	21,935,100	貸付有価証券 300株
日東紡績	23,300	3,205.00	74,676,500	
A G C	143,800	5,610.00	806,718,000	貸付有価証券 1,500株
日本板硝子	75,200	513.00	38,577,600	貸付有価証券 7,700株
石塚硝子	2,700	2,057.00	5,553,900	
日本山村硝子	6,000	823.00	4,938,000	
日本電気硝子	62,900	2,898.00	182,284,200	貸付有価証券 1,300株
オハラ	6,200	1,145.00	7,099,000	貸付有価証券 1,000株
住友大阪セメント	29,000	3,575.00	103,675,000	
太平洋セメント	89,000	2,358.00	209,862,000	貸付有価証券 300株
日本ヒューム	15,700	696.00	10,927,200	
日本コンクリート工業	30,900	299.00	9,239,100	
三谷セキサン	7,300	6,450.00	47,085,000	貸付有価証券 3,400株
アジアパイルホールディ ングス	24,100	439.00	10,579,900	
東海カーボン	131,200	1,162.00	152,454,400	貸付有価証券 2,200株
日本カーボン	8,100	4,185.00	33,898,500	
東洋炭素	10,200	3,145.00	32,079,000	貸付有価証券 2,800株
ノリタケカンパニーリミ テド	8,700	4,530.00	39,411,000	
T O T O	111,900	4,940.00	552,786,000	貸付有価証券 600株
日本碍子	169,700	1,876.00	318,357,200	
日本特殊陶業	119,100	2,169.00	258,327,900	貸付有価証券

				100株
ダントーホールディングス	10,200	340.00	3,468,000	貸付有価証券 6,300株
MARUWA	5,400	14,560.00	78,624,000	
品川リフラクトリーズ	3,700	3,910.00	14,467,000	
黒崎播磨	2,700	4,310.00	11,637,000	
ヨータイ	10,000	1,263.00	12,630,000	
イソライト工業	6,900	1,195.00	8,245,500	貸付有価証券 1,100株(300株)
東京窯業	19,900	305.00	6,069,500	
ニッカトー	7,100	571.00	4,054,100	
フジミインコーポレーテッド	12,600	6,610.00	83,286,000	
クニミネ工業	4,900	1,001.00	4,904,900	
エーアンドエーマテリアル	2,600	912.00	2,371,200	
ニチアス	36,300	2,659.00	96,521,700	
ニチハ	21,800	2,628.00	57,290,400	
日本製鉄	693,100	2,014.00	1,395,903,400	貸付有価証券 6,000株
神戸製鋼所	289,100	613.00	177,218,300	貸付有価証券 300株
中山製鋼所	24,500	465.00	11,392,500	
合同製鐵	8,300	1,364.00	11,321,200	
ジェイ エフ イー ホールディングス	418,300	1,674.00	700,234,200	貸付有価証券 4,500株
東京製鐵	52,800	1,136.00	59,980,800	
共英製鋼	17,500	1,667.00	29,172,500	
大和工業	29,600	3,695.00	109,372,000	貸付有価証券 300株
東京鐵鋼	6,800	1,381.00	9,390,800	貸付有価証券 3,100株
大阪製鐵	8,200	1,239.00	10,159,800	貸付有価証券 200株
淀川製鋼所	20,300	2,767.00	56,170,100	貸付有価証券 100株
丸一鋼管	54,800	3,015.00	165,222,000	貸付有価証券 200株
モリ工業	4,600	2,537.00	11,670,200	
大同特殊鋼	25,400	4,300.00	109,220,000	

日本高周波鋼業	5,700	348.00	1,983,600	貸付有価証券 100株
日本冶金工業	11,300	2,952.00	33,357,600	貸付有価証券 200株
山陽特殊製鋼	15,900	2,198.00	34,948,200	
愛知製鋼	8,700	2,593.00	22,559,100	
日立金属	166,800	2,089.00	348,445,200	貸付有価証券 22,000株（9,000株）
日本金属	3,900	1,293.00	5,042,700	
大平洋金属	9,500	3,315.00	31,492,500	貸付有価証券 100株
新日本電工	100,000	356.00	35,600,000	貸付有価証券 100株
栗本鐵工所	7,000	1,547.00	10,829,000	
虹技	2,100	956.00	2,007,600	
日本鋳鉄管	1,600	1,004.00	1,606,400	
三菱製鋼	9,900	1,221.00	12,087,900	
日亜鋼業	20,100	280.00	5,628,000	貸付有価証券 200株
日本精線	2,500	4,465.00	11,162,500	貸付有価証券 100株
エンビプロ・ホールディングス	5,100	1,306.00	6,660,600	貸付有価証券 200株
シンニッタン	18,700	235.00	4,394,500	
新家工業	3,800	1,742.00	6,619,600	
大紀アルミニウム工業所	23,300	1,671.00	38,934,300	貸付有価証券 600株
日本軽金属ホールディングス	39,200	1,860.00	72,912,000	
三井金属鉱業	41,800	3,405.00	142,329,000	貸付有価証券 100株
東邦亜鉛	8,600	2,762.00	23,753,200	
三菱マテリアル	102,300	2,129.00	217,796,700	
住友金属鉱山	198,000	5,325.00	1,054,350,000	貸付有価証券 1,500株
DOWAホールディングス	42,200	4,900.00	206,780,000	
古河機械金属	25,600	1,304.00	33,382,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	17,900	876.00	15,680,400	

東邦チタニウム	27,700	928.00	25,705,600	
U A C J	23,500	2,332.00	54,802,000	
C K サンエツ	3,200	4,025.00	12,880,000	貸付有価証券 1,500株
古河電気工業	48,100	2,397.00	115,295,700	
住友電気工業	579,000	1,607.00	930,453,000	
フジクラ	172,600	663.00	114,433,800	貸付有価証券 3,000株
昭和電線ホールディングス	13,500	1,898.00	25,623,000	
東京特殊電線	2,300	2,831.00	6,511,300	
タツタ電線	27,300	460.00	12,558,000	
カナレ電気	2,300	1,503.00	3,456,900	貸付有価証券 1,000株
平河ヒューテック	8,600	1,170.00	10,062,000	貸付有価証券 3,900株
リョービ	19,000	1,126.00	21,394,000	
アーレスティ	16,500	381.00	6,286,500	
アサヒホールディングス	62,000	2,187.00	135,594,000	貸付有価証券 1,000株
稲葉製作所	8,700	1,302.00	11,327,400	
宮地エンジニアリンググループ	4,700	3,700.00	17,390,000	
トーカロ	39,900	1,345.00	53,665,500	
アルファC o	6,000	1,083.00	6,498,000	
S U M C O	238,400	2,100.00	500,640,000	貸付有価証券 54,700株
川田テクノロジーズ	3,200	3,810.00	12,192,000	
R S T e c h n o l o g i e s	5,000	5,520.00	27,600,000	
ジェイテックコーポレーション	2,000	1,523.00	3,046,000	貸付有価証券 400株(400株)
信和	9,600	823.00	7,900,800	
東洋製罐グループホールディングス	98,600	1,615.00	159,239,000	貸付有価証券 6,000株
ホッカンホールディングス	8,500	1,401.00	11,908,500	貸付有価証券 1,400株
コロナ	8,600	892.00	7,671,200	
横河ブリッジホールディングス	26,600	2,135.00	56,791,000	

駒井ハルテック	2,900	2,118.00	6,142,200	
高田機工	1,400	2,871.00	4,019,400	貸付有価証券 600株
三和ホールディングス	146,000	1,289.00	188,194,000	貸付有価証券 200株
文化シャッター	49,100	1,063.00	52,193,300	貸付有価証券 7,000株（7,000株）
三協立山	19,900	620.00	12,338,000	
アルインコ	11,300	910.00	10,283,000	
東洋シャッター	3,400	553.00	1,880,200	
L I X I L	243,700	2,576.00	627,771,200	貸付有価証券 800株
日本ファイルコン	10,800	518.00	5,594,400	
ノーリツ	29,600	1,617.00	47,863,200	貸付有価証券 1,700株
長府製作所	15,700	1,974.00	30,991,800	
リンナイ	29,200	9,870.00	288,204,000	
ダイニチ工業	7,400	694.00	5,135,600	
日東精工	19,400	518.00	10,049,200	
三洋工業	1,900	1,844.00	3,503,600	
岡部	29,600	749.00	22,170,400	貸付有価証券 100株
ジーテクト	19,200	1,459.00	28,012,800	
東プレ	28,900	1,261.00	36,442,900	
高周波熱錬	27,700	607.00	16,813,900	
東京製綱	9,500	850.00	8,075,000	
サンコール	13,200	501.00	6,613,200	
モリテック スチール	12,100	319.00	3,859,900	
パイオラックス	22,200	1,764.00	39,160,800	
エイチワン	15,200	667.00	10,138,400	
日本発條	142,400	891.00	126,878,400	
中央発條	7,500	806.00	6,045,000	
アドバネクス	2,000	1,647.00	3,294,000	
立川ブラインド工業	6,800	1,087.00	7,391,600	
三益半導体工業	12,100	2,397.00	29,003,700	
日本ドライケミカル	3,800	1,804.00	6,855,200	貸付有価証券 1,600株
日本製鋼所	47,000	3,625.00	170,375,000	

三浦工業	67,000	3,270.00	219,090,000	貸付有価証券 100株
タクマ	52,500	1,487.00	78,067,500	
ツガミ	34,000	1,298.00	44,132,000	貸付有価証券 300株
オークマ	18,100	4,880.00	88,328,000	
芝浦機械	17,500	3,065.00	53,637,500	
アマダ	244,500	1,060.00	259,170,000	
アイダエンジニアリング	40,500	1,012.00	40,986,000	
滝澤鉄工所	4,500	1,210.00	5,445,000	
F U J I	71,300	2,431.00	173,330,300	
牧野フライス製作所	16,900	3,710.00	62,699,000	
オーエスジー	71,600	1,997.00	142,985,200	
ダイジェット工業	1,700	1,024.00	1,740,800	
旭ダイヤモンド工業	40,600	594.00	24,116,400	
D M G 森精機	91,900	1,774.00	163,030,600	貸付有価証券 700株
ソディック	34,000	781.00	26,554,000	貸付有価証券 200株
ディスコ	22,800	34,650.00	790,020,000	
日東工器	8,500	1,630.00	13,855,000	
日進工具	12,200	1,412.00	17,226,400	
パンチ工業	12,900	494.00	6,372,600	
富士ダイス	7,800	620.00	4,836,000	
豊和工業	7,900	829.00	6,549,100	
O K K	5,500	751.00	4,130,500	貸付有価証券 1,100株
東洋機械金属	10,100	566.00	5,716,600	
津田駒工業	3,000	595.00	1,785,000	貸付有価証券 100株
エンシュウ	3,400	672.00	2,284,800	
島精機製作所	22,600	1,852.00	41,855,200	貸付有価証券 100株
オプトラン	19,400	1,983.00	38,470,200	貸付有価証券 1,000株
N C ホールディングス	4,400	1,838.00	8,087,200	
イワキポンプ	9,800	1,024.00	10,035,200	
フリーー	13,800	1,026.00	14,158,800	貸付有価証券 6,300株

ヤマシンフィルタ	31,200	367.00	11,450,400	貸付有価証券 100株
日阪製作所	19,100	821.00	15,681,100	
やまびこ	30,000	1,335.00	40,050,000	貸付有価証券 1,300株
野村マイクロ・サイエンス	4,100	3,660.00	15,006,000	貸付有価証券 1,700株
平田機工	7,300	5,540.00	40,442,000	
ペガサスミシン製造	15,700	518.00	8,132,600	
マルマエ	6,300	2,412.00	15,195,600	
タツモ	7,200	1,524.00	10,972,800	
ナプテスコ	88,300	3,315.00	292,714,500	貸付有価証券 2,000株
三井海洋開発	16,500	1,161.00	19,156,500	
レオン自動機	16,600	1,046.00	17,363,600	
S M C	45,900	68,710.00	3,153,789,000	貸付有価証券 200株
ホソカワミクロン	10,900	2,829.00	30,836,100	
ユニオンツール	5,800	3,530.00	20,474,000	
オイレス工業	21,700	1,594.00	34,589,800	貸付有価証券 10,100株
日精エー・エス・ビー機械	5,200	2,989.00	15,542,800	
サトーホールディングス	20,400	2,013.00	41,065,200	
技研製作所	13,700	3,735.00	51,169,500	
日本エアテック	7,100	1,024.00	7,270,400	貸付有価証券 2,800株
カワタ	4,900	1,016.00	4,978,400	
日精樹脂工業	10,800	1,019.00	11,005,200	
オカダアイヨン	4,900	1,446.00	7,085,400	貸付有価証券 400株
ワイエイシイホールディングス	6,200	1,090.00	6,758,000	貸付有価証券 400株
小松製作所	709,700	2,769.50	1,965,514,150	
住友重機械工業	89,600	2,906.00	260,377,600	
日立建機	62,800	2,975.00	186,830,000	
日工	21,400	625.00	13,375,000	
巴工業	6,100	2,298.00	14,017,800	貸付有価証券 1,500株

井関農機	14,500	1,263.00	18,313,500	貸付有価証券 500株
TOWA	13,400	2,310.00	30,954,000	貸付有価証券 2,900株(2,700株)
丸山製作所	3,200	1,528.00	4,889,600	
北川鉄工所	7,000	1,359.00	9,513,000	
ローツェ	7,700	10,760.00	82,852,000	
タカキタ	5,400	612.00	3,304,800	貸付有価証券 2,300株
クボタ	758,700	2,118.00	1,606,926,600	貸付有価証券 21,200株
荏原実業	7,200	2,154.00	15,508,800	
三菱化工機	5,000	2,001.00	10,005,000	
月島機械	28,800	1,045.00	30,096,000	
帝国電機製作所	10,900	1,427.00	15,554,300	貸付有価証券 2,200株
東京機械製作所	6,400	767.00	4,908,800	
新東工業	34,500	704.00	24,288,000	貸付有価証券 100株
澁谷工業	13,700	2,537.00	34,756,900	
アイチ コーポレーション	22,300	885.00	19,735,500	
小森コーポレーション	39,700	740.00	29,378,000	
鶴見製作所	12,000	1,810.00	21,720,000	
住友精密工業	2,300	1,920.00	4,416,000	
日本ギア工業	5,600	274.00	1,534,400	
酒井重工業	2,800	2,975.00	8,330,000	
荏原製作所	65,000	5,840.00	379,600,000	貸付有価証券 100株
石井鐵工所	2,200	3,005.00	6,611,000	
西島製作所	14,200	966.00	13,717,200	
北越工業	14,700	904.00	13,288,800	
ダイキン工業	199,500	21,765.00	4,342,117,500	貸付有価証券 600株
オルガノ	4,500	7,860.00	35,370,000	
トーヨーカネツ	5,900	2,409.00	14,213,100	
栗田工業	84,700	4,735.00	401,054,500	貸付有価証券 1,300株
椿本チエイン	20,500	3,375.00	69,187,500	

大同工業	6,900	925.00	6,382,500	貸付有価証券 100株
木村化工機	13,000	789.00	10,257,000	貸付有価証券 100株
アネスト岩田	24,400	814.00	19,861,600	
ダイフク	86,200	8,710.00	750,802,000	貸付有価証券 100株
サムコ	3,900	2,333.00	9,098,700	貸付有価証券 700株(400株)
加藤製作所	7,400	825.00	6,105,000	
油研工業	2,600	1,760.00	4,576,000	
タダノ	81,900	1,005.00	82,309,500	
フジテック	58,100	2,692.00	156,405,200	貸付有価証券 100株
C K D	46,200	2,047.00	94,571,400	貸付有価証券 100株
キトー	13,300	1,680.00	22,344,000	
平和	43,700	1,934.00	84,515,800	
理想科学工業	13,100	2,249.00	29,461,900	
S A N K Y O	33,800	3,195.00	107,991,000	
日本金銭機械	15,900	664.00	10,557,600	
マースグループホールディングス	9,900	1,615.00	15,988,500	貸付有価証券 100株
フクシマガリレイ	10,700	3,900.00	41,730,000	
オーイズミ	5,500	397.00	2,183,500	
ダイコク電機	7,200	1,248.00	8,985,600	貸付有価証券 2,600株
竹内製作所	23,800	2,645.00	62,951,000	貸付有価証券 800株
アマノ	41,000	2,281.00	93,521,000	
J U K I	21,800	702.00	15,303,600	
ジャノメ	13,300	726.00	9,655,800	貸付有価証券 900株
マックス	20,800	1,706.00	35,484,800	
グローリー	40,200	2,142.00	86,108,400	
新晃工業	14,600	1,737.00	25,360,200	
大和冷機工業	22,600	1,137.00	25,696,200	
セガサミーホールディングス	155,300	2,129.00	330,633,700	

日本ピストンリング	5,700	1,381.00	7,871,700	
リケン	6,700	2,621.00	17,560,700	
T P R	21,100	1,441.00	30,405,100	
ツバキ・ナカシマ	34,400	1,131.00	38,906,400	貸付有価証券 5,300株
ホシザキ	45,800	8,110.00	371,438,000	貸付有価証券 300株
大豊工業	12,800	725.00	9,280,000	
日本精工	294,800	756.00	222,868,800	
N T N	336,600	235.00	79,101,000	貸付有価証券 2,700株
ジェイテクト	150,200	1,048.00	157,409,600	
不二越	13,300	4,235.00	56,325,500	貸付有価証券 200株
日本トムソン	42,900	561.00	24,066,900	
T H K	88,400	2,900.00	256,360,000	貸付有価証券 1,600株
ユーシン精機	12,100	697.00	8,433,700	
前澤給装工業	11,700	980.00	11,466,000	
イーグル工業	19,400	1,062.00	20,602,800	
前澤工業	10,400	647.00	6,728,800	
日本プラー工業	15,800	2,915.00	46,057,000	貸付有価証券 400株
キッツ	52,700	682.00	35,941,400	貸付有価証券 700株
マキタ	190,600	4,106.00	782,603,600	貸付有価証券 400株
三井E & Sホールディングス	56,600	365.00	20,659,000	貸付有価証券 19,100株
日立造船	132,400	785.00	103,934,000	
三菱重工業	246,100	3,334.00	820,497,400	
I H I	97,800	2,678.00	261,908,400	
サノヤスホールディングス	19,300	129.00	2,489,700	貸付有価証券 500株(500株)
スター精密	23,600	1,482.00	34,975,200	貸付有価証券 100株
日清紡ホールディングス	95,800	1,038.00	99,440,400	貸付有価証券 11,800株
イビデン	82,200	5,730.00	471,006,000	
コニカミノルタ	342,200	510.00	174,522,000	

ブラザー工業	191,200	2,107.00	402,858,400	
ミネベアミツミ	270,000	2,560.00	691,200,000	貸付有価証券 600株
日立製作所	753,200	6,150.00	4,632,180,000	貸付有価証券 3,200株
東芝	273,700	4,590.00	1,256,283,000	貸付有価証券 1,300株
三菱電機	1,566,000	1,445.50	2,263,653,000	貸付有価証券 16,600株
富士電機	94,400	6,170.00	582,448,000	貸付有価証券 300株
東洋電機製造	5,700	970.00	5,529,000	貸付有価証券 100株
安川電機	168,600	4,855.00	818,553,000	貸付有価証券 7,400株
シンフォニアテクノロジー	18,800	1,319.00	24,797,200	
明電舎	26,600	2,425.00	64,505,000	貸付有価証券 100株
オリジン	3,900	1,246.00	4,859,400	
山洋電気	6,900	5,010.00	34,569,000	
デンヨー	13,300	1,715.00	22,809,500	
PHCホールディングス	18,000	1,589.00	28,602,000	
東芝テック	16,800	5,000.00	84,000,000	貸付有価証券 300株
芝浦メカトロニクス	2,800	8,040.00	22,512,000	
マブチモーター	36,300	4,055.00	147,196,500	貸付有価証券 6,200株
日本電産	405,900	10,060.00	4,083,354,000	貸付有価証券 6,400株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,900	402.00	2,773,800	貸付有価証券 600株(600株)
トレックス・セミコンダクター	7,900	2,589.00	20,453,100	貸付有価証券 400株(400株)
東光高岳	8,700	1,462.00	12,719,400	
ダブル・スコープ	45,000	1,039.00	46,755,000	貸付有価証券 8,600株(4,800株)
ダイヘン	17,100	4,140.00	70,794,000	
ヤーマン	25,500	922.00	23,511,000	貸付有価証券 10,100株(2,700株)
JVCケンウッド	127,600	188.00	23,988,800	

ミマキエンジニアリング	14,000	739.00	10,346,000	
I - P E X	7,300	1,519.00	11,088,700	貸付有価証券 500株
日新電機	36,700	1,499.00	55,013,300	
大崎電気工業	28,700	489.00	14,034,300	
オムロン	130,400	8,036.00	1,047,894,400	
日東工業	20,900	1,597.00	33,377,300	
I D E C	19,400	2,400.00	46,560,000	
正興電機製作所	4,900	1,080.00	5,292,000	貸付有価証券 2,200株(2,100株)
不二電機工業	2,900	1,088.00	3,155,200	
ジーエス・ユアサコーポレーション	50,900	2,402.00	122,261,800	
サクサホールディングス	3,600	1,387.00	4,993,200	
メルコホールディングス	3,500	3,850.00	13,475,000	
テクノメディカ	3,500	1,537.00	5,379,500	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	4,400	1,004.00	4,417,600	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
日本電気	199,000	5,140.00	1,022,860,000	
富士通	140,900	16,425.00	2,314,282,500	
沖電気工業	63,600	917.00	58,321,200	
岩崎通信機	6,400	820.00	5,248,000	
電気興業	8,200	2,355.00	19,311,000	
サンケン電気	14,600	5,150.00	75,190,000	
ナカヨ	2,800	1,125.00	3,150,000	
アイホン	8,900	2,168.00	19,295,200	貸付有価証券 100株
ルネサスエレクトロニクス	849,900	1,440.00	1,223,856,000	貸付有価証券 200株
セイコーエプソン	194,300	1,821.00	353,820,300	貸付有価証券 1,100株
ワコム	121,500	847.00	102,910,500	貸付有価証券 56,900株
アルバック	31,200	6,090.00	190,008,000	
アクセル	6,500	1,143.00	7,429,500	貸付有価証券 600株(600株)
E I Z O	12,200	3,725.00	45,445,000	
日本信号	39,900	886.00	35,351,400	

京三製作所	33,600	431.00	14,481,600	
能美防災	20,700	2,020.00	41,814,000	貸付有価証券 200株
ホーチキ	11,300	1,213.00	13,706,900	
星和電機	7,100	493.00	3,500,300	貸付有価証券 100株
エレコム	35,900	1,543.00	55,393,700	貸付有価証券 100株
パナソニック	1,670,400	1,227.50	2,050,416,000	
シャープ	178,500	1,310.00	233,835,000	貸付有価証券 4,200株
アンリツ	100,900	1,618.00	163,256,200	貸付有価証券 47,400株
富士通ゼネラル	42,500	2,599.00	110,457,500	
ソニーグループ	981,100	12,160.00	11,930,176,000	
T D K	226,800	4,730.00	1,072,764,000	
帝国通信工業	6,900	1,422.00	9,811,800	
タムラ製作所	60,400	616.00	37,206,400	貸付有価証券 19,100株(4,500株)
アルプスアルパイン	138,600	1,226.00	169,923,600	
池上通信機	4,600	664.00	3,054,400	
日本電波工業	14,100	1,189.00	16,764,900	
鈴木	7,700	823.00	6,337,100	
メイコー	12,700	3,900.00	49,530,000	
日本トリム	2,900	2,700.00	7,830,000	
ローランド ディー . ジー .	9,200	2,911.00	26,781,200	
フォスター電機	15,800	799.00	12,624,200	
S M K	3,600	2,169.00	7,808,400	
ヨコオ	11,600	2,799.00	32,468,400	
ティアック	25,300	126.00	3,187,800	貸付有価証券 1,800株(1,500株)
ホシデン	37,800	1,196.00	45,208,800	
ヒロセ電機	24,100	17,280.00	416,448,000	
日本航空電子工業	35,900	1,851.00	66,450,900	貸付有価証券 600株
T O A	16,800	781.00	13,120,800	貸付有価証券 100株
マクセル	31,100	1,227.00	38,159,700	

古野電気	18,600	1,048.00	19,492,800	
ユニデンホールディングス	3,400	3,490.00	11,866,000	
スミダコーポレーション	14,700	881.00	12,950,700	
アイコム	5,800	2,368.00	13,734,400	貸付有価証券 2,700株
リオン	6,000	2,097.00	12,582,000	
本多通信工業	12,200	481.00	5,868,200	貸付有価証券 5,300株
横河電機	156,700	1,858.00	291,148,600	貸付有価証券 200株
新電元工業	6,000	3,005.00	18,030,000	
アズビル	91,800	4,150.00	380,970,000	貸付有価証券 900株
東亜ディーケーケー	7,700	916.00	7,053,200	貸付有価証券 3,300株
日本光電工業	64,700	3,180.00	205,746,000	
チノー	5,000	1,525.00	7,625,000	貸付有価証券 800株（400株）
共和電業	15,000	383.00	5,745,000	
日本電子材料	8,000	2,081.00	16,648,000	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
堀場製作所	29,000	6,820.00	197,780,000	貸付有価証券 100株
アドバンテスト	116,400	9,760.00	1,136,064,000	貸付有価証券 500株
小野測器	6,500	500.00	3,250,000	
エスペック	12,700	2,045.00	25,971,500	
キーエンス	141,900	54,880.00	7,787,472,000	
日置電機	7,500	6,520.00	48,900,000	
シスメックス	132,500	8,771.00	1,162,157,500	貸付有価証券 600株
日本マイクロニクス	27,200	1,742.00	47,382,400	
メガチップス	14,600	3,940.00	57,524,000	
OBARA GROUP	7,100	3,095.00	21,974,500	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
澤藤電機	1,900	1,542.00	2,929,800	
原田工業	7,400	990.00	7,326,000	貸付有価証券 3,400株
コーセル	17,400	825.00	14,355,000	

イリソ電子工業	13,100	4,450.00	58,295,000	貸付有価証券 1,600株
オブテックスグループ	25,700	1,600.00	41,120,000	
千代田インテグレ	6,600	1,914.00	12,632,400	
アイ・オー・データ機器	5,100	1,297.00	6,614,700	
レーザーテック	68,800	22,000.00	1,513,600,000	貸付有価証券 2,600株
スタンレー電気	109,400	2,876.00	314,634,400	貸付有価証券 1,300株
岩崎電気	5,700	2,295.00	13,081,500	
ウシオ電機	80,300	1,882.00	151,124,600	
岡谷電機産業	11,100	308.00	3,418,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	13,300	297.00	3,950,100	
エノモト	4,300	1,516.00	6,518,800	
日本セラミック	14,600	2,478.00	36,178,800	貸付有価証券 900株
遠藤照明	7,200	1,009.00	7,264,800	
古河電池	11,200	1,248.00	13,977,600	貸付有価証券 4,000株(2,200株)
双信電機	7,500	569.00	4,267,500	貸付有価証券 1,200株
山一電機	11,300	2,034.00	22,984,200	
図研	10,200	2,958.00	30,171,600	
日本電子	32,600	6,690.00	218,094,000	貸付有価証券 100株
カシオ計算機	113,300	1,366.00	154,767,800	貸付有価証券 200株
ファナック	137,400	22,780.00	3,129,972,000	
日本シイエムケイ	30,700	625.00	19,187,500	貸付有価証券 100株
エンプラス	3,900	2,682.00	10,459,800	
大真空	21,100	1,145.00	24,159,500	貸付有価証券 300株
ローム	70,100	9,530.00	668,053,000	
浜松ホトニクス	112,400	5,680.00	638,432,000	
三井ハイテック	15,400	8,130.00	125,202,000	貸付有価証券 6,900株
新光電気工業	46,000	4,990.00	229,540,000	
京セラ	220,300	6,862.00	1,511,698,600	

太陽誘電	76,000	5,150.00	391,400,000	
村田製作所	460,000	8,116.00	3,733,360,000	貸付有価証券 2,700株
双葉電子工業	26,800	683.00	18,304,400	
北陸電気工業	5,800	1,306.00	7,574,800	
ニチコン	49,300	1,281.00	63,153,300	貸付有価証券 900株
日本ケミコン	14,800	1,939.00	28,697,200	
K O A	23,600	1,467.00	34,621,200	
市光工業	18,700	524.00	9,798,800	貸付有価証券 200株
小糸製作所	86,000	6,200.00	533,200,000	
ミツバ	28,800	403.00	11,606,400	
S C R E E Nホールディングス	27,200	12,010.00	326,672,000	
キャノン電子	14,400	1,597.00	22,996,800	貸付有価証券 500株
キャノン	778,200	2,827.50	2,200,360,500	
リコー	434,600	1,063.00	461,979,800	貸付有価証券 2,000株
象印マホービン	42,400	1,435.00	60,844,000	
M U T O Hホールディングス	2,000	2,117.00	4,234,000	貸付有価証券 200株
東京エレクトロン	99,400	58,220.00	5,787,068,000	貸付有価証券 400株
トヨタ紡織	63,900	2,165.00	138,343,500	
芦森工業	2,900	908.00	2,633,200	
ユニプレス	23,300	812.00	18,919,600	
豊田自動織機	126,700	9,170.00	1,161,839,000	
モリタホールディングス	25,100	1,258.00	31,575,800	
三櫻工業	21,700	723.00	15,689,100	貸付有価証券 300株
デンソー	344,800	8,523.00	2,938,730,400	貸付有価証券 700株
東海理化電機製作所	41,200	1,579.00	65,054,800	
川崎重工業	114,300	2,110.00	241,173,000	
名村造船所	47,000	249.00	11,703,000	貸付有価証券 10,600株(3,200株)
日本車輛製造	5,700	2,057.00	11,724,900	

三菱ロジスネクスト	20,700	995.00	20,596,500	貸付有価証券 6,300株
近畿車輛	2,400	1,075.00	2,580,000	
日産自動車	1,847,000	608.50	1,123,899,500	
いすゞ自動車	491,400	1,591.00	781,817,400	
トヨタ自動車	7,932,700	2,160.50	17,138,598,350	貸付有価証券 16,400株
日野自動車	195,600	1,095.00	214,182,000	
三菱自動車工業	579,700	335.00	194,199,500	
エフテック	10,900	546.00	5,951,400	
レシップホールディングス	6,200	549.00	3,403,800	
G M B	2,800	787.00	2,203,600	
ファルテック	2,700	703.00	1,898,100	
武蔵精密工業	34,900	1,927.00	67,252,300	貸付有価証券 6,300株
日産車体	22,900	679.00	15,549,100	貸付有価証券 200株
新明和工業	44,200	936.00	41,371,200	
極東開発工業	29,100	1,494.00	43,475,400	
トピー工業	12,900	1,123.00	14,486,700	
ティラド	4,500	2,537.00	11,416,500	
タチエス	27,400	1,151.00	31,537,400	
N O K	75,800	1,242.00	94,143,600	
フタバ産業	39,200	408.00	15,993,600	
K Y B	16,300	3,100.00	50,530,000	
大同メタル工業	30,000	635.00	19,050,000	
プレス工業	77,600	389.00	30,186,400	
ミクニ	19,900	418.00	8,318,200	
太平洋工業	32,800	1,046.00	34,308,800	
河西工業	19,200	292.00	5,606,400	貸付有価証券 300株
アイシン	114,600	4,435.00	508,251,000	
マツダ	491,500	926.00	455,129,000	貸付有価証券 2,600株
今仙電機製作所	10,300	589.00	6,066,700	貸付有価証券 200株
本田技研工業	1,233,100	3,681.00	4,539,041,100	

スズキ	358,200	4,776.00	1,710,763,200	貸付有価証券 19,000株
S U B A R U	448,800	1,959.50	879,423,600	
安永	7,500	854.00	6,405,000	
ヤマハ発動機	204,300	2,713.00	554,265,900	貸付有価証券 1,600株
T B K	17,200	407.00	7,000,400	
エクセディ	23,600	1,722.00	40,639,200	貸付有価証券 600株
豊田合成	50,600	2,275.00	115,115,000	
愛三工業	24,500	744.00	18,228,000	
盟和産業	2,200	1,003.00	2,206,600	
日本プラスト	12,300	558.00	6,863,400	
ヨロズ	14,600	970.00	14,162,000	貸付有価証券 6,800株
エフ・シー・シー	25,600	1,458.00	37,324,800	貸付有価証券 800株
シマノ	62,900	26,600.00	1,673,140,000	貸付有価証券 100株
テイ・エス テック	66,100	1,589.00	105,032,900	
ジャムコ	9,100	822.00	7,480,200	
テルモ	443,200	3,771.00	1,671,307,200	
クリエートメディック	4,700	975.00	4,582,500	
日機装	47,000	796.00	37,412,000	
日本エム・ディ・エム	9,000	1,568.00	14,112,000	
島津製作所	201,500	4,105.00	827,157,500	貸付有価証券 800株
J M S	13,200	621.00	8,197,200	
クボテック	3,400	268.00	911,200	貸付有価証券 300株(100株)
長野計器	11,300	1,306.00	14,757,800	貸付有価証券 100株
ブイ・テクノロジー	6,800	3,520.00	23,936,000	
東京計器	10,000	1,043.00	10,430,000	貸付有価証券 4,600株
愛知時計電機	6,700	1,883.00	12,616,100	
インターアクション	7,800	2,037.00	15,888,600	貸付有価証券 2,400株(900株)
オーバル	14,000	272.00	3,808,000	

東京精密	26,500	4,845.00	128,392,500	貸付有価証券 1,300株
マニー	62,400	1,635.00	102,024,000	
ニコン	239,100	1,365.00	326,371,500	
トプコン	73,600	1,529.00	112,534,400	
オリンパス	821,300	2,268.50	1,863,119,050	貸付有価証券 2,800株
理研計器	12,700	4,835.00	61,404,500	貸付有価証券 400株(100株)
タムロン	12,200	2,359.00	28,779,800	貸付有価証券 900株
H O Y A	305,600	15,485.00	4,732,216,000	
シード	7,300	507.00	3,701,100	
ノーリツ鋼機	14,100	1,879.00	26,493,900	
エー・アンド・デイ	14,300	925.00	13,227,500	貸付有価証券 200株
朝日インテック	171,700	2,197.00	377,224,900	貸付有価証券 2,000株
シチズン時計	183,400	511.00	93,717,400	
リズム	4,900	1,420.00	6,958,000	
大研医器	12,400	531.00	6,584,400	
メニコン	51,900	2,925.00	151,807,500	貸付有価証券 1,700株
シンシア	1,700	497.00	844,900	貸付有価証券 700株
松風	6,500	1,838.00	11,947,000	貸付有価証券 3,000株
セイコーホールディングス	22,100	2,347.00	51,868,700	貸付有価証券 300株
ニプロ	116,700	1,081.00	126,152,700	
中本パックス	4,400	1,702.00	7,488,800	貸付有価証券 2,000株
スノーピーク	20,400	2,760.00	56,304,000	貸付有価証券 9,500株(200株)
パラマウントベッドホールディングス	30,000	1,974.00	59,220,000	
トランザクション	8,600	1,034.00	8,892,400	貸付有価証券 2,300株(200株)
粧美堂	4,600	416.00	1,913,600	貸付有価証券 2,000株
ニホンフラッシュ	13,400	1,073.00	14,378,200	

前田工織	17,300	3,170.00	54,841,000	貸付有価証券 600株
永大産業	20,500	305.00	6,252,500	
アートネイチャー	13,400	743.00	9,956,200	
バンダイナムコホールディングス	140,300	7,838.00	1,099,671,400	
アイフィスジャパン	4,000	686.00	2,744,000	貸付有価証券 1,700株
共立印刷	26,200	152.00	3,982,400	
S H O E I	14,700	4,540.00	66,738,000	
フランスベッドホールディングス	20,100	912.00	18,331,200	
パイロットコーポレーション	26,400	4,655.00	122,892,000	貸付有価証券 11,600株
萩原工業	10,100	1,233.00	12,453,300	貸付有価証券 2,200株
フジシールインターナショナル	38,000	1,756.00	66,728,000	
タカラトミー	65,500	1,284.00	84,102,000	
広済堂ホールディングス	9,700	854.00	8,283,800	貸付有価証券 200株
エステールホールディングス	3,800	654.00	2,485,200	貸付有価証券 1,800株
タカノ	5,400	709.00	3,828,600	貸付有価証券 2,300株
プロネクサス	12,100	1,076.00	13,019,600	
ホクシン	11,000	152.00	1,672,000	貸付有価証券 4,900株
ウッドワン	4,800	1,029.00	4,939,200	
大建工業	9,200	2,316.00	21,307,200	
凸版印刷	238,000	2,319.00	551,922,000	
大日本印刷	185,100	2,990.00	553,449,000	
共同印刷	4,500	2,781.00	12,514,500	
N I S S H A	32,100	1,395.00	44,779,500	貸付有価証券 100株
光村印刷	1,400	1,519.00	2,126,600	
TAKARA & COMPANY	9,600	1,847.00	17,731,200	貸付有価証券 1,400株
アシックス	138,500	2,248.00	311,348,000	貸付有価証券 1,900株

ツツミ	3,900	1,815.00	7,078,500	貸付有価証券 700株
ローランド	10,900	4,135.00	45,071,500	
小松ウオール工業	4,800	1,869.00	8,971,200	
ヤマハ	91,100	5,430.00	494,673,000	
河合楽器製作所	4,400	3,005.00	13,222,000	
クリナップ	14,600	550.00	8,030,000	
ピジョン	94,600	2,281.00	215,782,600	貸付有価証券 42,700株(8,200株)
兼松サステック	1,000	1,710.00	1,710,000	
キングジム	13,800	878.00	12,116,400	貸付有価証券 200株
リンテック	33,500	2,700.00	90,450,000	
イトーキ	28,900	361.00	10,432,900	
任天堂	88,400	58,760.00	5,194,384,000	
三菱鉛筆	25,800	1,277.00	32,946,600	
タカラスタンダード	32,400	1,369.00	44,355,600	貸付有価証券 300株
コクヨ	75,100	1,601.00	120,235,100	
ナカバヤシ	14,000	508.00	7,112,000	
グローブライド	14,000	2,758.00	38,612,000	
オカムラ	53,800	1,172.00	63,053,600	
美津濃	15,500	2,296.00	35,588,000	
東京電力ホールディングス	1,172,100	364.00	426,644,400	貸付有価証券 4,500株
中部電力	479,100	1,136.00	544,257,600	
関西電力	593,400	1,163.00	690,124,200	
中国電力	244,700	902.00	220,719,400	
北陸電力	143,200	557.00	79,762,400	
東北電力	366,800	739.00	271,065,200	
四国電力	141,000	810.00	114,210,000	
九州電力	322,800	846.00	273,088,800	貸付有価証券 2,800株
北海道電力	136,100	503.00	68,458,300	貸付有価証券 1,500株
沖縄電力	33,200	1,416.00	47,011,200	貸付有価証券 2,400株
電源開発	133,500	1,896.00	253,116,000	

エフオン	9,500	534.00	5,073,000	貸付有価証券 3,900株
イーレックス	23,000	1,699.00	39,077,000	貸付有価証券 200株
レノバ	30,600	1,386.00	42,411,600	貸付有価証券 7,700株
東京瓦斯	300,200	2,341.00	702,768,200	貸付有価証券 200株
大阪瓦斯	283,600	2,116.00	600,097,600	
東邦瓦斯	71,900	3,080.00	221,452,000	
北海道瓦斯	7,800	1,513.00	11,801,400	
広島ガス	29,900	354.00	10,584,600	
西部ガスホールディングス	17,600	2,228.00	39,212,800	
静岡ガス	40,800	870.00	35,496,000	貸付有価証券 1,400株
メタウォーター	16,300	2,052.00	33,447,600	
SBSホールディングス	11,600	3,020.00	35,032,000	貸付有価証券 2,500株
東武鉄道	153,000	3,015.00	461,295,000	
相鉄ホールディングス	50,100	2,346.00	117,534,600	貸付有価証券 1,300株
東急	395,000	1,630.00	643,850,000	貸付有価証券 1,100株
京浜急行電鉄	201,100	1,299.00	261,228,900	貸付有価証券 600株
小田急電鉄	232,900	2,234.00	520,298,600	
京王電鉄	81,300	5,470.00	444,711,000	貸付有価証券 100株
京成電鉄	109,000	3,520.00	383,680,000	
富士急行	18,700	4,275.00	79,942,500	貸付有価証券 1,600株
新京成電鉄	3,600	2,022.00	7,279,200	
東日本旅客鉄道	275,600	7,278.00	2,005,816,800	
西日本旅客鉄道	189,800	5,207.00	988,288,600	
東海旅客鉄道	130,200	16,350.00	2,128,770,000	
西武ホールディングス	204,500	1,296.00	265,032,000	
鴻池運輸	24,900	1,182.00	29,431,800	
西日本鉄道	43,400	2,790.00	121,086,000	貸付有価証券 200株

ハマキョウレックス	11,100	2,894.00	32,123,400	
サカイ引越センター	7,200	4,535.00	32,652,000	
近鉄グループホールディングス	148,300	3,720.00	551,676,000	貸付有価証券 1,300株
阪急阪神ホールディングス	185,500	3,600.00	667,800,000	貸付有価証券 500株
南海電気鉄道	66,200	2,444.00	161,792,800	
京阪ホールディングス	66,000	3,140.00	207,240,000	
神戸電鉄	3,500	3,390.00	11,865,000	貸付有価証券 1,600株
名古屋鉄道	121,900	2,182.00	265,985,800	
山陽電気鉄道	11,400	1,992.00	22,708,800	貸付有価証券 5,300株
アルプス物流	10,300	1,075.00	11,072,500	
ヤマトホールディングス	207,800	2,188.00	454,666,400	貸付有価証券 600株
山九	39,000	4,005.00	156,195,000	
丸運	8,500	243.00	2,065,500	
丸全昭和運輸	12,000	3,175.00	38,100,000	
センコーグループホールディングス	74,400	933.00	69,415,200	貸付有価証券 4,900株（3,700株）
トナミホールディングス	3,600	3,815.00	13,734,000	
ニッコンホールディングス	49,800	2,165.00	107,817,000	
日本石油輸送	1,600	2,654.00	4,246,400	
福山通運	24,400	4,005.00	97,722,000	
セイノーホールディングス	101,000	1,216.00	122,816,000	貸付有価証券 300株
エスライン	4,500	911.00	4,099,500	
神奈川中央交通	3,700	3,520.00	13,024,000	貸付有価証券 1,700株
日立物流	28,600	5,810.00	166,166,000	
丸和運輸機関	31,300	1,087.00	34,023,100	貸付有価証券 6,400株
C & F ロジホールディングス	15,000	1,247.00	18,705,000	
九州旅客鉄道	114,700	2,650.00	303,955,000	貸付有価証券 1,000株
S Gホールディングス	280,200	2,503.00	701,340,600	
N I P P O N E X P R	51,300	7,470.00	383,211,000	

E S S ホールディング				
日本郵船	124,000	10,000.00	1,240,000,000	貸付有価証券 800株
商船三井	82,100	9,040.00	742,184,000	
川崎汽船	45,700	7,540.00	344,578,000	
N S ユナイテッド海運	8,200	4,115.00	33,743,000	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
明治海運	17,500	934.00	16,345,000	貸付有価証券 5,800株（1,900株）
飯野海運	68,800	831.00	57,172,800	貸付有価証券 300株
共栄タンカー	2,600	1,026.00	2,667,600	貸付有価証券 300株（300株）
乾汽船	10,100	2,939.00	29,683,900	貸付有価証券 1,000株
日本航空	340,100	2,411.00	819,981,100	
A N A ホールディングス	376,800	2,664.50	1,003,983,600	貸付有価証券 51,800株（11,900株）
パスコ	2,800	1,334.00	3,735,200	
トランコム	4,100	7,280.00	29,848,000	
日新	11,800	1,718.00	20,272,400	
三菱倉庫	47,000	2,805.00	131,835,000	
三井倉庫ホールディングス	15,700	2,326.00	36,518,200	
住友倉庫	52,400	2,143.00	112,293,200	
澁澤倉庫	8,900	2,213.00	19,695,700	
東陽倉庫	24,900	318.00	7,918,200	貸付有価証券 100株
日本トランスシティ	32,600	618.00	20,146,800	
ケイヒン	2,500	1,406.00	3,515,000	
中央倉庫	9,000	982.00	8,838,000	貸付有価証券 4,200株
川西倉庫	2,700	1,114.00	3,007,800	貸付有価証券 1,200株
安田倉庫	12,200	981.00	11,968,200	
ファイズホールディングス	3,200	602.00	1,926,400	貸付有価証券 200株（200株）
東洋埠頭	4,500	1,467.00	6,601,500	
上組	81,600	2,198.00	179,356,800	
サンリツ	4,100	839.00	3,439,900	

キムラユニティー	3,900	1,363.00	5,315,700	貸付有価証券 1,800株
キューソー流通システム	7,400	965.00	7,141,000	貸付有価証券 3,400株
近鉄エクスプレス	28,000	2,950.00	82,600,000	
東海運	8,400	307.00	2,578,800	
エーアイティー	9,300	1,403.00	13,047,900	
内外トランスライン	5,700	1,900.00	10,830,000	貸付有価証券 2,500株
日本コンセプト	4,700	1,400.00	6,580,000	貸付有価証券 100株（100株）
NEC ネットエスアイ	50,800	1,737.00	88,239,600	
クロスキャット	4,000	1,793.00	7,172,000	貸付有価証券 200株
システナ	219,200	381.00	83,515,200	
デジタルアーツ	8,200	6,150.00	50,430,000	
日鉄ソリューションズ	22,200	3,575.00	79,365,000	
キューブシステム	7,800	922.00	7,191,600	貸付有価証券 3,400株
WOW WORLD	2,200	1,124.00	2,472,800	貸付有価証券 1,000株
コア	6,500	1,538.00	9,997,000	
ラクーンホールディングス	13,000	1,167.00	15,171,000	貸付有価証券 3,500株（800株）
ソリトンシステムズ	7,700	1,520.00	11,704,000	貸付有価証券 200株（200株）
ソフトクリエイトホールディングス	6,700	4,120.00	27,604,000	
T I S	146,500	2,635.00	386,027,500	
J N S ホールディングス	7,100	416.00	2,953,600	貸付有価証券 300株
グリー	69,900	841.00	58,785,900	貸付有価証券 43,700株（5,400株）
GMOペパボ	1,600	2,336.00	3,737,600	
コーエーテクモホールディングス	49,000	4,000.00	196,000,000	貸付有価証券 3,600株（3,300株）
三菱総合研究所	6,600	3,640.00	24,024,000	貸付有価証券 100株
ボルテージ	4,100	349.00	1,430,900	貸付有価証券 400株（100株）
電算	1,700	2,289.00	3,891,300	

A G S	7,800	797.00	6,216,600	
ファインデックス	12,900	694.00	8,952,600	貸付有価証券 400株
ブレインパッド	13,000	1,099.00	14,287,000	貸付有価証券 600株(600株)
K L a b	28,200	412.00	11,618,400	貸付有価証券 700株
ポルトウウィン・ピット クルーホールディ	22,300	1,014.00	22,612,200	
ネクソン	346,700	2,394.00	829,999,800	貸付有価証券 500株
アイスタイル	39,700	192.00	7,622,400	貸付有価証券 7,300株(7,200株)
エムアップホールディング ス	17,700	868.00	15,363,600	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
エイチーム	10,600	732.00	7,759,200	貸付有価証券 100株(100株)
エニグモ	16,600	675.00	11,205,000	貸付有価証券 3,200株
テクノスジャパン	11,900	443.00	5,271,700	
e n i s h	9,400	341.00	3,205,400	貸付有価証券 900株
コロプラ	50,500	643.00	32,471,500	貸付有価証券 1,000株
オルトプラス	11,800	310.00	3,658,000	貸付有価証券 600株
ブロードリーフ	76,200	326.00	24,841,200	貸付有価証券 43,600株
クロス・マーケティング グループ	5,800	992.00	5,753,600	貸付有価証券 700株(600株)
デジタルハーツホール ディングス	7,000	1,508.00	10,556,000	
システム情報	11,500	1,002.00	11,523,000	
メディアドゥ	5,400	2,480.00	13,392,000	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
じげん	43,400	299.00	12,976,600	
ブイキューブ	15,600	743.00	11,590,800	貸付有価証券 5,400株(5,400株)
エンカレッジ・テクノロ ジ	3,400	525.00	1,785,000	
サイバーリンクス	5,100	896.00	4,569,600	貸付有価証券

				300株(300株)
ディー・エル・イー	10,300	224.00	2,307,200	貸付有価証券 4,800株(2,800株)
フィックスターズ	16,400	707.00	11,594,800	貸付有価証券 700株
CARTA HOLDINGS	6,200	2,419.00	14,997,800	貸付有価証券 200株(200株)
オブティム	10,700	868.00	9,287,600	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
セレス	5,700	1,409.00	8,031,300	貸付有価証券 2,600株(2,500株)
SHIFT	7,800	19,770.00	154,206,000	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
ティーガイア	13,600	1,720.00	23,392,000	
セック	2,200	2,109.00	4,639,800	
テクマトリックス	26,000	1,593.00	41,418,000	
プロシップ	5,100	1,395.00	7,114,500	貸付有価証券 1,500株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	39,900	2,778.00	110,842,200	貸付有価証券 3,200株
GMOペイメントゲートウェイ	29,800	10,230.00	304,854,000	貸付有価証券 100株
ザッパラス	6,000	484.00	2,904,000	
システムリサーチ	4,500	1,780.00	8,010,000	
インターネットイニシアティブ	40,900	3,410.00	139,469,000	
さくらインターネット	16,500	522.00	8,613,000	貸付有価証券 6,700株
ヴィンクス	4,300	955.00	4,106,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,400	3,865.00	13,141,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
SRAホールディングス	7,400	2,899.00	21,452,600	
システムインテグレータ	4,800	538.00	2,582,400	貸付有価証券 100株
朝日ネット	14,000	592.00	8,288,000	貸付有価証券 100株
eBASE	18,300	591.00	10,815,300	貸付有価証券 200株
アバント	16,500	1,034.00	17,061,000	
アドソル日進	5,500	1,605.00	8,827,500	貸付有価証券 100株(100株)

ODKソリューションズ	3,200	649.00	2,076,800	
フリービット	8,000	906.00	7,248,000	貸付有価証券 300株
コムチュア	17,200	2,755.00	47,386,000	
サイバーコム	2,300	980.00	2,254,000	
アステリア	11,100	724.00	8,036,400	貸付有価証券 1,200株(1,000株)
アイル	8,500	1,310.00	11,135,000	
マークラインズ	7,700	2,570.00	19,789,000	
メディカル・データ・ビ ジョン	19,500	1,017.00	19,831,500	貸付有価証券 5,600株(4,700株)
g u m i	21,300	566.00	12,055,800	貸付有価証券 100株
ショーケース	3,300	440.00	1,452,000	
モバイルファクトリー	3,500	923.00	3,230,500	貸付有価証券 1,600株(900株)
テラスカイ	5,600	1,429.00	8,002,400	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	6,800	1,304.00	8,867,200	
P C Iホールディングス	6,900	947.00	6,534,300	
パイプドHD	2,800	2,573.00	7,204,400	貸付有価証券 900株(900株)
アイビーシー	2,500	565.00	1,412,500	
ネオジャパン	4,300	1,058.00	4,549,400	貸付有価証券 900株(700株)
P R T I M E S	3,300	2,925.00	9,652,500	貸付有価証券 1,500株(1,200株)
ラクス	52,900	1,753.00	92,733,700	
ランドコンピュータ	3,500	855.00	2,992,500	
ダブルスタンダード	4,600	1,871.00	8,606,600	
オープンドア	9,100	2,080.00	18,928,000	貸付有価証券 3,000株(1,800株)
マイネット	5,500	485.00	2,667,500	
アカツキ	6,900	2,878.00	19,858,200	
ベネフィットジャパン	1,200	1,913.00	2,295,600	
U b i c o mホールディ ングス	4,000	1,927.00	7,708,000	貸付有価証券 1,500株(200株)
カナミックネットワーク	16,400	432.00	7,084,800	
ノムラシステムコーポ	7,900	220.00	1,738,000	貸付有価証券

レーション				600株(600株)
チェンジ	28,400	1,591.00	45,184,400	貸付有価証券 5,700株(200株)
シンクロ・フード	7,800	250.00	1,950,000	貸付有価証券 700株(700株)
オークネット	8,200	1,493.00	12,242,600	貸付有価証券 3,500株
キャピタル・アセット・ プランニング	3,100	774.00	2,399,400	
セグエグループ	4,000	536.00	2,144,000	
エイトレッド	2,200	1,957.00	4,305,400	貸付有価証券 1,300株
マクロミル	33,400	1,200.00	40,080,000	
ピーグリー	3,600	1,208.00	4,348,800	貸付有価証券 700株
オロ	4,800	2,377.00	11,409,600	貸付有価証券 200株(200株)
ユーザーローカル	4,700	1,519.00	7,139,300	
テモナ	3,300	401.00	1,323,300	貸付有価証券 700株(700株)
ニーズウェル	3,500	606.00	2,121,000	
マネーフォワード	23,400	4,555.00	106,587,000	貸付有価証券 1,700株
サインポスト	5,000	866.00	4,330,000	貸付有価証券 2,300株(100株)
電算システムホールディ ングス	6,300	2,724.00	17,161,200	
ソルクシーズ	13,000	412.00	5,356,000	
フェイス	4,000	699.00	2,796,000	貸付有価証券 1,800株
プロトコーポレーション	16,300	1,266.00	20,635,800	
ハイマックス	4,100	1,196.00	4,903,600	
野村総合研究所	296,900	3,790.00	1,125,251,000	
サイバネットシステム	10,900	636.00	6,932,400	貸付有価証券 500株
C Eホールディングス	8,100	463.00	3,750,300	貸付有価証券 3,700株
日本システム技術	3,000	2,080.00	6,240,000	
インテージホールディ ングス	17,700	1,791.00	31,700,700	貸付有価証券 600株(500株)
東邦システムサイエンス	4,000	920.00	3,680,000	貸付有価証券

				1,700株
ソースネクスト	66,300	150.00	9,945,000	貸付有価証券 23,400株(10,800株)
インフォコム	16,800	2,058.00	34,574,400	貸付有価証券 400株(100株)
シンプレクス・ホールディングス	17,900	1,642.00	29,391,800	
HEROZ	4,400	864.00	3,801,600	貸付有価証券 1,000株(900株)
ラクスル	16,800	3,185.00	53,508,000	貸付有価証券 3,700株(2,400株)
I P S	4,200	1,976.00	8,299,200	貸付有価証券 1,900株(500株)
F I G	16,700	283.00	4,726,100	貸付有価証券 7,400株
システムサポート	5,500	1,021.00	5,615,500	
イーソル	9,400	490.00	4,606,000	貸付有価証券 4,400株(500株)
アルテリア・ネットワークス	19,400	1,315.00	25,511,000	
東海ソフト	2,400	904.00	2,169,600	
ウイングアーク1st	8,800	1,282.00	11,281,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	3,500	1,728.00	6,048,000	貸付有価証券 800株(200株)
サーバーワークス	2,600	2,323.00	6,039,800	貸付有価証券 200株(200株)
東名	1,400	954.00	1,335,600	
ヴィッツ	1,400	1,217.00	1,703,800	貸付有価証券 100株
トピラシステムズ	3,100	815.00	2,526,500	貸付有価証券 600株(600株)
S a n s a n	54,600	1,027.00	56,074,200	
L i n k - U	2,700	752.00	2,030,400	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
ギフトィ	14,000	892.00	12,488,000	
ベース	2,600	4,810.00	12,506,000	
J M D C	14,400	5,660.00	81,504,000	貸付有価証券 3,400株(2,000株)
フォーカスシステムズ	10,300	912.00	9,393,600	貸付有価証券 4,800株
クレスコ	11,200	1,719.00	19,252,800	

フジ・メディア・ホールディングス	148,000	1,284.00	190,032,000	貸付有価証券 300株
オービック	48,400	18,400.00	890,560,000	貸付有価証券 100株
ジャストシステム	21,900	5,340.00	116,946,000	貸付有価証券 100株
TDCソフト	13,400	1,104.00	14,793,600	
Zホールディングス	2,233,600	546.30	1,220,215,680	貸付有価証券 400株
トレンドマイクロ	82,100	6,000.00	492,600,000	貸付有価証券 7,700株
IDホールディングス	9,700	850.00	8,245,000	
日本オラクル	24,900	8,100.00	201,690,000	
アルファシステムズ	4,100	3,675.00	15,067,500	
フューチャー	32,400	1,338.00	43,351,200	
CAC Holdings	9,000	1,304.00	11,736,000	
SBテクノロジー	6,600	2,487.00	16,414,200	
トーセ	4,200	726.00	3,049,200	貸付有価証券 100株
オービックビジネスコンサルティング	14,700	4,170.00	61,299,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	70,000	2,924.00	204,680,000	
アイティフォー	18,600	780.00	14,508,000	
東計電算	1,800	4,915.00	8,847,000	
エクスネット	2,400	983.00	2,359,200	
大塚商会	83,100	4,270.00	354,837,000	貸付有価証券 9,600株
サイボウズ	20,500	1,320.00	27,060,000	
電通国際情報サービス	22,200	3,650.00	81,030,000	
ACCESS	17,300	579.00	10,016,700	
デジタルガレージ	25,400	3,960.00	100,584,000	
EMシステムズ	25,400	710.00	18,034,000	
ウェザーニューズ	5,200	7,550.00	39,260,000	貸付有価証券 100株
CIJ	9,900	801.00	7,929,900	
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,560.00	6,408,000	貸付有価証券 100株
日本エンタープライズ	15,600	169.00	2,636,400	

WOWOW	7,400	1,750.00	12,950,000	貸付有価証券 3,200株
スカラ	12,900	675.00	8,707,500	貸付有価証券 100株
インテリジェント ウェ イブ	7,700	566.00	4,358,200	
I M A G I C A G R O U P	13,100	625.00	8,187,500	貸付有価証券 300株
ネットワンシステムズ	58,500	2,800.00	163,800,000	
システムソフト	33,000	93.00	3,069,000	貸付有価証券 8,100株
アルゴグラフィックス	12,000	3,115.00	37,380,000	
マーベラス	24,200	726.00	17,569,200	
エイベックス	26,500	1,337.00	35,430,500	
日本ユニシス	48,000	3,060.00	146,880,000	
兼松エレクトロニクス	8,400	3,880.00	32,592,000	
都築電気	7,800	1,377.00	10,740,600	貸付有価証券 3,600株
T B S ホールディングス	93,400	1,941.00	181,289,400	貸付有価証券 200株
日本テレビホールディン グス	128,300	1,359.00	174,359,700	貸付有価証券 200株
朝日放送グループホール ディングス	15,300	761.00	11,643,300	貸付有価証券 1,200株
テレビ朝日ホールディン グス	36,900	1,659.00	61,217,100	
スカパー J S A T ホール ディングス	130,100	449.00	58,414,900	
テレビ東京ホールディン グス	11,000	2,148.00	23,628,000	
日本 B S 放送	5,200	1,070.00	5,564,000	貸付有価証券 2,300株
ビジョン	26,300	1,166.00	30,665,800	
スマートバリュー	3,500	448.00	1,568,000	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	14,600	2,376.00	34,689,600	貸付有価証券 6,800株
ワイヤレスゲート	6,300	298.00	1,877,400	
コネクシオ	10,900	1,410.00	15,369,000	
日本通信	127,800	179.00	22,876,200	貸付有価証券 60,000株(51,000株)
クロップス	2,800	889.00	2,489,200	

日本電信電話	1,607,700	3,288.00	5,286,117,600	貸付有価証券 5,700株
K D D I	1,120,300	3,780.00	4,234,734,000	貸付有価証券 500株
ソフトバンク	2,327,600	1,443.00	3,358,726,800	
光通信	17,700	14,490.00	256,473,000	
エムティーアイ	14,900	489.00	7,286,100	
G M Oインターネット	54,400	2,493.00	135,619,200	
ファイバーゲート	7,000	1,228.00	8,596,000	貸付有価証券 1,600株(500株)
アйдママーケティング コミュニケーション	3,300	291.00	960,300	
K A D O K A W A	83,900	2,462.00	206,561,800	貸付有価証券 500株
学研ホールディングス	21,700	1,006.00	21,830,200	
ゼンリン	25,100	1,058.00	26,555,800	
昭文社ホールディングス	6,200	443.00	2,746,600	
インプレスホールディン グス	12,700	205.00	2,603,500	貸付有価証券 200株
アイネット	7,900	1,272.00	10,048,800	
松竹	10,200	12,290.00	125,358,000	貸付有価証券 1,500株
東宝	90,700	4,775.00	433,092,500	
東映	5,000	17,370.00	86,850,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	409,200	2,101.00	859,729,200	
ピー・シー・エー	9,000	1,508.00	13,572,000	貸付有価証券 1,700株(700株)
ビジネスブレイン太田昭 和	5,300	1,486.00	7,875,800	
D T S	29,400	2,716.00	79,850,400	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	71,500	5,530.00	395,395,000	貸付有価証券 100株
シーイーシー	16,500	1,078.00	17,787,000	貸付有価証券 300株
カブコン	144,900	2,790.00	404,271,000	
アイ・エス・ビー	7,200	969.00	6,976,800	貸付有価証券 700株
ジャステック	8,900	1,061.00	9,442,900	貸付有価証券 1,300株

S C S K	106,400	1,926.00	204,926,400	
日本システムウエア	5,800	2,109.00	12,232,200	
アイネス	13,900	1,531.00	21,280,900	
T K C	26,000	3,060.00	79,560,000	
富士ソフト	16,400	5,220.00	85,608,000	貸付有価証券 300株(300株)
N S D	49,400	2,148.00	106,111,200	
コナミホールディングス	55,800	6,660.00	371,628,000	
福井コンピュータホールディングス	7,000	3,010.00	21,070,000	
J B C Cホールディングス	10,400	1,456.00	15,142,400	
ミロク情報サービス	13,500	1,401.00	18,913,500	
ソフトバンクグループ	921,500	5,117.00	4,715,315,500	貸付有価証券 1,500株
ハウスイ	1,200	821.00	985,200	
高千穂交易	5,900	1,552.00	9,156,800	貸付有価証券 2,700株
オルパヘルスケアホールディングス	2,500	1,505.00	3,762,500	
伊藤忠食品	3,700	5,060.00	18,722,000	
エレマテック	12,300	1,088.00	13,382,400	
J A L U X	4,300	2,556.00	10,990,800	
あらた	12,300	3,905.00	48,031,500	
トーメンデバイス	2,300	6,280.00	14,444,000	貸付有価証券 400株
東京エレクトロン デバイス	4,600	5,380.00	24,748,000	
フィールズ	13,500	657.00	8,869,500	
双日	170,400	1,958.00	333,643,200	
アルフレッサ ホールディングス	171,400	1,746.00	299,264,400	
横浜冷凍	43,200	877.00	37,886,400	
神栄	2,100	853.00	1,791,300	
ラサ商事	8,200	1,011.00	8,290,200	
アルコニックス	19,200	1,357.00	26,054,400	貸付有価証券 100株
神戸物産	119,700	3,805.00	455,458,500	貸付有価証券 14,400株

ハイパー	3,800	479.00	1,820,200	貸付有価証券 100株
あい ホールディングス	22,000	1,765.00	38,830,000	
ディーブイエックス	5,200	1,064.00	5,532,800	貸付有価証券 1,000株
ダイワボウホールディングス	75,000	1,773.00	132,975,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	36,800	2,633.00	96,894,400	
ラクト・ジャパン	5,300	2,015.00	10,679,500	貸付有価証券 100株(100株)
グリムス	6,900	2,072.00	14,296,800	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,800	806.00	21,600,800	
八洲電機	11,100	963.00	10,689,300	貸付有価証券 5,200株
メディアスホールディングス	8,800	896.00	7,884,800	
レスターホールディングス	14,600	1,977.00	28,864,200	
ジューテックホールディングス	3,500	1,219.00	4,266,500	
大光	6,500	700.00	4,550,000	貸付有価証券 2,700株
OCHIホールディングス	4,500	1,338.00	6,021,000	貸付有価証券 100株
TOKAIホールディングス	74,700	909.00	67,902,300	
黒谷	4,200	656.00	2,755,200	貸付有価証券 1,600株(400株)
Cominix	2,700	741.00	2,000,700	
三洋貿易	15,500	1,025.00	15,887,500	
ビューティガレージ	2,500	3,250.00	8,125,000	
ウイン・パートナーズ	11,100	1,050.00	11,655,000	貸付有価証券 5,200株
ミタチ産業	3,900	870.00	3,393,000	
シップヘルスケアホールディングス	49,400	2,367.00	116,929,800	貸付有価証券 6,700株
明治電機工業	4,800	1,265.00	6,072,000	
デリカフーズホールディ	6,000	550.00	3,300,000	貸付有価証券

ングス				2,600株
スターティアホールディングス	3,500	640.00	2,240,000	貸付有価証券 400株
コメダホールディングス	33,700	2,146.00	72,320,200	貸付有価証券 100株
ピーバンドットコム	2,100	592.00	1,243,200	
アセンテック	5,300	690.00	3,657,000	貸付有価証券 200株
富士興産	3,800	944.00	3,587,200	
協栄産業	1,600	1,500.00	2,400,000	
フルサト・マルカホールディングス	14,800	2,270.00	33,596,000	
ヤマエグループホールディングス	10,400	1,066.00	11,086,400	
小野建	14,900	1,625.00	24,212,500	
南陽	3,100	1,940.00	6,014,000	
佐鳥電機	9,600	912.00	8,755,200	
エコトレーディング	3,200	599.00	1,916,800	貸付有価証券 1,500株
伯東	9,400	2,355.00	22,137,000	
コンドーテック	11,900	1,021.00	12,149,900	
中山福	8,100	407.00	3,296,700	
ナガイレーベン	20,500	2,116.00	43,378,000	
三菱食品	14,800	3,165.00	46,842,000	
松田産業	11,200	2,207.00	24,718,400	貸付有価証券 200株
第一興商	29,300	3,715.00	108,849,500	
メディバルホールディングス	166,500	2,087.00	347,485,500	貸付有価証券 300株
S P K	6,100	1,311.00	7,997,100	
萩原電気ホールディングス	5,700	2,025.00	11,542,500	
アズワン	22,100	6,430.00	142,103,000	貸付有価証券 600株
スズデン	5,300	2,054.00	10,886,200	
尾家産業	4,100	1,007.00	4,128,700	
シモジマ	9,400	1,013.00	9,522,200	貸付有価証券 4,400株
ドウシシャ	14,500	1,551.00	22,489,500	
小津産業	3,400	2,015.00	6,851,000	

高速	9,200	1,525.00	14,030,000	
たけびし	5,800	1,451.00	8,415,800	貸付有価証券 2,700株
リックス	3,500	1,586.00	5,551,000	
丸文	13,600	723.00	9,832,800	
ハビネット	12,900	1,589.00	20,498,100	貸付有価証券 100株
橋本総業ホールディングス	3,100	2,021.00	6,265,100	
日本ライフライン	45,700	1,026.00	46,888,200	
タカショー	11,700	671.00	7,850,700	貸付有価証券 5,200株(500株)
I D O M	46,800	656.00	30,700,800	
進和	9,100	2,029.00	18,463,900	
エスケイジャパン	3,700	423.00	1,565,100	貸付有価証券 700株(500株)
ダイトロン	6,500	1,833.00	11,914,500	
シークス	22,100	1,234.00	27,271,400	
田中商事	4,700	650.00	3,055,000	
オーハシテクニカ	8,300	1,365.00	11,329,500	
白銅	5,000	2,642.00	13,210,000	
ダイコー通産	1,800	1,172.00	2,109,600	
伊藤忠商事	1,078,900	3,849.00	4,152,686,100	
丸紅	1,521,500	1,228.50	1,869,162,750	
高島	2,200	2,379.00	5,233,800	
長瀬産業	84,700	1,889.00	159,998,300	貸付有価証券 100株
蝶理	8,600	1,808.00	15,548,800	
豊田通商	154,900	5,120.00	793,088,000	
三共生興	20,400	570.00	11,628,000	
兼松	57,500	1,380.00	79,350,000	
ツカモトコーポレーション	2,600	1,342.00	3,489,200	
三井物産	1,197,800	3,098.00	3,710,784,400	
日本紙パルプ商事	8,000	4,100.00	32,800,000	
カメイ	18,300	1,053.00	19,269,900	
東都水産	800	3,910.00	3,128,000	貸付有価証券 400株

OUGホールディングス	2,200	2,743.00	6,034,600	貸付有価証券 1,000株
スターゼン	11,400	2,132.00	24,304,800	
山善	64,900	1,028.00	66,717,200	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
椿本興業	3,200	4,165.00	13,328,000	
住友商事	973,500	1,912.00	1,861,332,000	貸付有価証券 100株
内田洋行	6,600	4,645.00	30,657,000	
三菱商事	1,155,800	4,120.00	4,761,896,000	
第一実業	7,000	4,310.00	30,170,000	
キャノンマーケティング ジャパン	38,200	2,498.00	95,423,600	
西華産業	8,100	1,609.00	13,032,900	
佐藤商事	12,700	1,213.00	15,405,100	
菱洋エレクトロ	9,100	2,149.00	19,555,900	貸付有価証券 4,000株（1,400株）
東京産業	13,900	704.00	9,785,600	
ユアサ商事	14,600	2,978.00	43,478,800	
神鋼商事	3,400	3,830.00	13,022,000	
トルク	8,200	222.00	1,820,400	
阪和興業	30,900	3,345.00	103,360,500	貸付有価証券 100株
正栄食品工業	10,000	4,175.00	41,750,000	貸付有価証券 4,700株
カナデン	12,500	1,006.00	12,575,000	
菱電商事	12,200	1,776.00	21,667,200	貸付有価証券 5,700株
岩谷産業	37,000	5,370.00	198,690,000	
ナイス	5,300	1,888.00	10,006,400	
ニチモウ	2,200	2,843.00	6,254,600	
極東貿易	4,400	2,353.00	10,353,200	貸付有価証券 800株
アステナホールディング ス	21,700	420.00	9,114,000	
三愛石油	38,000	945.00	35,910,000	貸付有価証券 1,700株
稲畑産業	34,000	2,450.00	83,300,000	
G S Iクレオス	7,400	1,141.00	8,443,400	貸付有価証券

				3,300株
明和産業	14,200	1,118.00	15,875,600	貸付有価証券 6,700株(100株)
クワザワホールディングス	6,100	606.00	3,696,600	貸付有価証券 2,800株
ワキタ	32,900	1,023.00	33,656,700	
東邦ホールディングス	49,500	1,881.00	93,109,500	
サンゲツ	40,800	1,586.00	64,708,800	
ミツウロコグループホールディングス	22,700	1,085.00	24,629,500	
シナネンホールディングス	5,700	3,295.00	18,781,500	
伊藤忠エネクス	34,100	1,040.00	35,464,000	
サンリオ	47,600	2,488.00	118,428,800	
サンワテクノス	9,400	1,390.00	13,066,000	
リョーサン	17,000	2,349.00	39,933,000	
新光商事	23,100	908.00	20,974,800	貸付有価証券 400株
トーヨー	7,000	1,073.00	7,511,000	貸付有価証券 500株(500株)
三信電気	7,100	1,682.00	11,942,200	
東陽テクニカ	15,200	1,089.00	16,552,800	
モスフードサービス	20,200	3,020.00	61,004,000	
加賀電子	14,000	3,275.00	45,850,000	
ソーダニッカ	15,100	853.00	12,880,300	貸付有価証券 100株
立花エレテック	12,300	1,600.00	19,680,000	貸付有価証券 5,700株
フォーバル	6,700	854.00	5,721,800	
PALTA C	21,600	4,525.00	97,740,000	
三谷産業	18,000	315.00	5,670,000	
太平洋興発	5,700	654.00	3,727,800	
西本Wismettac ホールディングス	3,500	2,889.00	10,111,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,400	2,000.00	2,800,000	貸付有価証券 200株
コア商事ホールディングス	9,600	699.00	6,710,400	貸付有価証券 1,100株(600株)
国際紙パルプ商事	32,100	360.00	11,556,000	
ヤマタネ	7,200	1,629.00	11,728,800	

丸紅建材リース	1,300	1,784.00	2,319,200	
日鉄物産	11,000	5,350.00	58,850,000	
泉州電業	4,200	6,310.00	26,502,000	貸付有価証券 1,200株
トラスコ中山	32,100	2,541.00	81,566,100	
オートバックスセブン	51,900	1,426.00	74,009,400	貸付有価証券 200株
モリト	11,200	742.00	8,310,400	貸付有価証券 100株
加藤産業	22,300	3,235.00	72,140,500	
北恵	3,900	906.00	3,533,400	貸付有価証券 1,800株
イノテック	9,300	1,436.00	13,354,800	
イエローハット	26,700	1,626.00	43,414,200	
J Kホールディングス	12,400	1,088.00	13,491,200	貸付有価証券 7,700株
日伝	12,800	2,317.00	29,657,600	
北沢産業	10,400	229.00	2,381,600	貸付有価証券 100株
杉本商事	7,200	2,129.00	15,328,800	
因幡電機産業	41,100	2,623.00	107,805,300	
東テク	5,100	2,515.00	12,826,500	
ミスミグループ本社	193,600	3,600.00	696,960,000	貸付有価証券 300株
アルテック	10,400	298.00	3,099,200	
タキヒヨー	4,600	1,346.00	6,191,600	貸付有価証券 2,100株
蔵王産業	3,000	1,889.00	5,667,000	
スズケン	60,300	3,595.00	216,778,500	
ジェコス	10,600	830.00	8,798,000	
グローセル	18,000	441.00	7,938,000	
ローソン	34,100	4,845.00	165,214,500	貸付有価証券 1,300株
サンエー	11,700	4,065.00	47,560,500	貸付有価証券 2,700株
カワチ薬品	12,000	2,377.00	28,524,000	
エービーシー・マート	24,100	5,250.00	126,525,000	
ハードオフコーポレーション	6,800	806.00	5,480,800	

アスクル	34,900	1,663.00	58,038,700	
ゲオホールディングス	20,600	1,512.00	31,147,200	
アダストリア	16,600	1,733.00	28,767,800	貸付有価証券 7,800株
ジーフット	9,300	338.00	3,143,400	貸付有価証券 4,300株(100株)
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,200	385.00	847,000	
くら寿司	16,100	3,770.00	60,697,000	貸付有価証券 5,800株(1,400株)
キャンドウ	5,700	2,060.00	11,742,000	貸付有価証券 3,300株(1,000株)
アイケイ	4,800	418.00	2,006,400	
パルグループホールディ ングス	13,500	1,603.00	21,640,500	
エディオン	70,800	1,182.00	83,685,600	貸付有価証券 18,900株(300株)
サーラコーポレーション	31,300	648.00	20,282,400	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
ワッツ	7,500	711.00	5,332,500	貸付有価証券 3,300株(100株)
ハローズ	7,000	2,804.00	19,628,000	貸付有価証券 1,900株(100株)
フジオフードグループ本 社	13,000	1,334.00	17,342,000	貸付有価証券 6,100株
あみやき亭	3,700	3,005.00	11,118,500	貸付有価証券 1,700株
ひらまつ	32,700	207.00	6,768,900	
大黒天物産	4,900	4,810.00	23,569,000	貸付有価証券 1,100株(900株)
ハニーズホールディング ス	13,600	1,025.00	13,940,000	
ファーマライズホール ディングス	3,800	718.00	2,728,400	貸付有価証券 1,600株
アルペン	11,500	2,140.00	24,610,000	貸付有価証券 5,200株
ハブ	5,000	610.00	3,050,000	貸付有価証券 2,300株(1,100株)
クオールホールディング ス	18,900	1,332.00	25,174,800	
ジinzホールディングス	10,500	6,630.00	69,615,000	貸付有価証券 3,300株(3,000株)

ビックカメラ	91,500	1,010.00	92,415,000	貸付有価証券 43,000株（5,100株）
DCMホールディングス	95,200	1,100.00	104,720,000	
MonotaRO	195,000	2,138.00	416,910,000	貸付有価証券 11,200株（3,300株）
東京一番フーズ	3,900	596.00	2,324,400	
DDホールディングス	8,100	555.00	4,495,500	貸付有価証券 3,800株（100株）
きちりホールディングス	4,100	430.00	1,763,000	貸付有価証券 1,900株
アークランドサービス ホールディングス	11,300	2,239.00	25,300,700	貸付有価証券 4,900株
J・フロント リテイリ ング	184,200	1,059.00	195,067,800	
ドトール・日レスホール ディングス	26,600	1,641.00	43,650,600	貸付有価証券 12,300株
マツキヨココカラ&カン パニー	94,900	4,270.00	405,223,000	
ブロンコピリー	8,800	2,270.00	19,976,000	貸付有価証券 4,000株
ZOZO	106,100	3,085.00	327,318,500	
トレジャー・ファクト リー	4,500	976.00	4,392,000	貸付有価証券 2,100株
物語コーポレーション	7,600	6,730.00	51,148,000	貸付有価証券 3,600株
三越伊勢丹ホールディ ングス	270,000	977.00	263,790,000	貸付有価証券 700株
Hamee	5,500	1,088.00	5,984,000	貸付有価証券 1,800株
マーケットエンタープラ イズ	1,200	646.00	775,200	貸付有価証券 400株（300株）
ウエルシアホールディ ングス	81,500	3,060.00	249,390,000	貸付有価証券 1,300株
クリエイティブSDホー ルディングス	22,700	3,140.00	71,278,000	
丸善CHIホールディ ングス	18,000	369.00	6,642,000	貸付有価証券 8,100株
ミサワ	3,100	643.00	1,993,300	貸付有価証券 1,400株
ティーライフ	2,100	1,342.00	2,818,200	
エー・ピーホールディ ングス	3,000	455.00	1,365,000	

チムニー	4,700	1,160.00	5,452,000	貸付有価証券 2,200株
シュッピン	12,800	1,180.00	15,104,000	貸付有価証券 1,700株(800株)
オイシックス・ラ・大地	22,200	2,611.00	57,964,200	貸付有価証券 400株
ネクステージ	31,200	2,561.00	79,903,200	貸付有価証券 3,500株(2,100株)
ジョイフル本田	46,400	1,543.00	71,595,200	貸付有価証券 19,800株
鳥貴族ホールディングス	5,700	1,876.00	10,693,200	貸付有価証券 1,000株
ホットランド	11,500	1,312.00	15,088,000	貸付有価証券 5,300株(900株)
すかいらくホールディングス	199,100	1,497.00	298,052,700	貸付有価証券 92,300株(2,600株)
SFPホールディングス	7,500	1,438.00	10,785,000	貸付有価証券 3,500株(100株)
綿半ホールディングス	11,600	1,310.00	15,196,000	
ヨシックスホールディングス	3,000	2,247.00	6,741,000	貸付有価証券 1,400株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	44,800	1,065.00	47,712,000	貸付有価証券 21,000株
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,000	1,102.00	8,816,000	貸付有価証券 3,700株(100株)
B E E N O S	7,800	1,500.00	11,700,000	貸付有価証券 400株
あさひ	12,800	1,328.00	16,998,400	貸付有価証券 5,800株
日本調剤	9,300	1,396.00	12,982,800	
コスモス薬品	15,600	14,890.00	232,284,000	貸付有価証券 6,900株
トーエル	7,500	885.00	6,637,500	貸付有価証券 3,200株
セブン & アイ・ホールディングス	603,400	5,709.00	3,444,810,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	82,100	763.00	62,642,300	貸付有価証券 38,500株(2,200株)
ツルハホールディングス	33,700	9,120.00	307,344,000	
サンマルクホールディングス	12,200	1,645.00	20,069,000	
フェリシモ	3,400	1,200.00	4,080,000	

トリドールホールディングス	38,300	2,676.00	102,490,800	貸付有価証券 2,600株
T O K Y O B A S E	14,100	445.00	6,274,500	貸付有価証券 900株（900株）
ウイルプラスホールディングス	2,900	902.00	2,615,800	
J Mホールディングス	10,400	1,753.00	18,231,200	
サツドラホールディングス	6,900	634.00	4,374,600	
アレンザホールディングス	11,700	1,090.00	12,753,000	貸付有価証券 5,500株
串カツ田中ホールディングス	4,100	2,120.00	8,692,000	貸付有価証券 100株
バロックジャパンリミテッド	10,700	869.00	9,298,300	貸付有価証券 5,000株
クスリのアオキホールディングス	15,300	6,900.00	105,570,000	貸付有価証券 100株
力の源ホールディングス	7,900	568.00	4,487,200	貸付有価証券 3,700株
F O O D & L I F E C O M P A N I E	90,300	3,765.00	339,979,500	
メディカルシステムネットワーク	14,900	519.00	7,733,100	
一家ホールディングス	3,200	526.00	1,683,200	
藤久ホールディングス	4,800	633.00	3,038,400	
はるやまホールディングス	7,200	532.00	3,830,400	貸付有価証券 3,300株
ノジマ	24,900	2,580.00	64,242,000	
カップ・クリエイト	21,600	1,389.00	30,002,400	貸付有価証券 10,100株（200株）
ライトオン	11,500	702.00	8,073,000	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
良品計画	177,500	1,729.00	306,897,500	
三城ホールディングス	19,100	247.00	4,717,700	
アドヴァングループ	15,700	946.00	14,852,200	
アルビス	5,000	2,202.00	11,010,000	貸付有価証券 2,300株
コナカ	18,200	358.00	6,515,600	貸付有価証券 200株
ハウス オブ ローゼ	1,900	1,713.00	3,254,700	
G - 7ホールディングス	17,100	1,650.00	28,215,000	

イオン北海道	27,100	1,211.00	32,818,100	貸付有価証券 12,700株
コジマ	26,500	543.00	14,389,500	貸付有価証券 12,200株
ヒマラヤ	5,400	1,009.00	5,448,600	貸付有価証券 2,500株
コーナン商事	21,900	3,590.00	78,621,000	貸付有価証券 10,200株
エコス	5,700	2,020.00	11,514,000	貸付有価証券 1,500株
ワタミ	18,700	970.00	18,139,000	貸付有価証券 8,500株
マルシェ	3,700	453.00	1,676,100	貸付有価証券 1,700株
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	308,400	1,908.00	588,427,200	
西松屋チェーン	33,800	1,376.00	46,508,800	貸付有価証券 15,900株（600株）
ゼンショーホールディン グス	75,300	2,734.00	205,870,200	貸付有価証券 35,400株
幸楽苑ホールディングス	9,800	1,408.00	13,798,400	貸付有価証券 4,600株（700株）
ハークスレイ	6,400	473.00	3,027,200	
サイゼリヤ	22,900	2,954.00	67,646,600	
V Tホールディングス	58,000	489.00	28,362,000	貸付有価証券 900株
魚力	4,300	2,088.00	8,978,400	貸付有価証券 2,100株
ポプラ	4,000	142.00	568,000	貸付有価証券 1,800株
フジ・コーポレーション	8,200	1,166.00	9,561,200	
ユナイテッドアローズ	16,200	1,779.00	28,819,800	
ハイデイ日高	22,300	1,775.00	39,582,500	貸付有価証券 11,100株
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i	9,000	200.00	1,800,000	
コロワイド	63,400	1,750.00	110,950,000	貸付有価証券 23,000株（1,700株）
ピーシーデポコーポレー ション	17,900	280.00	5,012,000	貸付有価証券 6,000株
壱番屋	10,900	4,720.00	51,448,000	貸付有価証券 1,500株

トップカルチャー	5,600	290.00	1,624,000	
P L A N T	3,900	652.00	2,542,800	
スギホールディングス	30,800	6,330.00	194,964,000	貸付有価証券 800株
薬王堂ホールディングス	7,700	2,401.00	18,487,700	貸付有価証券 2,100株（600株）
スクロール	23,700	916.00	21,709,200	貸付有価証券 300株
ヨンドシーホールディングス	14,200	1,713.00	24,324,600	貸付有価証券 4,100株（600株）
木曽路	20,700	2,244.00	46,450,800	貸付有価証券 8,900株
S R S ホールディングス	21,300	825.00	17,572,500	貸付有価証券 4,100株（900株）
千趣会	27,800	372.00	10,341,600	貸付有価証券 12,600株
タカキュー	11,900	114.00	1,356,600	貸付有価証券 5,500株（100株）
リテールパートナーズ	18,700	1,210.00	22,627,000	貸付有価証券 8,300株
ケーヨー	28,500	873.00	24,880,500	貸付有価証券 100株
上新電機	17,700	2,082.00	36,851,400	
日本瓦斯	75,000	1,755.00	131,625,000	貸付有価証券 300株
ロイヤルホールディングス	26,500	2,025.00	53,662,500	貸付有価証券 11,800株
東天紅	1,100	955.00	1,050,500	
いなげや	19,100	1,401.00	26,759,100	
チヨダ	15,000	745.00	11,175,000	貸付有価証券 6,700株（100株）
ライフコーポレーション	14,400	3,020.00	43,488,000	
リンガーハット	19,000	2,254.00	42,826,000	貸付有価証券 8,900株
MrMaxHD	19,300	613.00	11,830,900	
テンアライド	15,000	317.00	4,755,000	貸付有価証券 6,200株
A O K I ホールディングス	29,800	618.00	18,416,400	
オークワ	24,200	915.00	22,143,000	貸付有価証券 11,300株

コメリ	23,800	2,755.00	65,569,000	
青山商事	31,900	767.00	24,467,300	貸付有価証券 3,500株
しまむら	17,900	9,950.00	178,105,000	
はせがわ	8,200	300.00	2,460,000	
高島屋	112,400	1,180.00	132,632,000	
松屋	31,100	742.00	23,076,200	
エイチ・ツー・オー リテイリング	73,100	886.00	64,766,600	貸付有価証券 200株
近鉄百貨店	5,900	2,698.00	15,918,200	貸付有価証券 2,700株
丸井グループ	121,700	2,322.00	282,587,400	
アクシアル リテイリング	11,900	3,235.00	38,496,500	
井筒屋	7,300	389.00	2,839,700	貸付有価証券 3,400株(1,400株)
イオン	593,500	2,642.00	1,568,027,000	
イズミ	27,900	3,235.00	90,256,500	貸付有価証券 200株
平和堂	28,500	1,939.00	55,261,500	貸付有価証券 13,200株
フジ	18,600	1,981.00	36,846,600	貸付有価証券 8,700株
ヤオコー	17,500	6,540.00	114,450,000	貸付有価証券 800株
ゼビオホールディングス	21,000	967.00	20,307,000	
ケーズホールディングス	142,200	1,266.00	180,025,200	貸付有価証券 1,800株
Olympicグループ	7,900	714.00	5,640,600	
日産東京販売ホールディングス	22,700	232.00	5,266,400	
シルバーライフ	3,100	1,128.00	3,496,800	貸付有価証券 1,400株(1,100株)
Genky Drugs tores	6,800	3,630.00	24,684,000	貸付有価証券 400株
ナルミヤ・インターナ ショナル	3,400	1,016.00	3,454,400	貸付有価証券 1,500株(400株)
ブックオフグループホー ルディングス	9,000	1,043.00	9,387,000	貸付有価証券 800株
ギフト	2,400	2,358.00	5,659,200	
アインホールディングス	20,700	6,440.00	133,308,000	貸付有価証券

				400株(100株)
元気寿司	4,300	2,575.00	11,072,500	貸付有価証券 1,900株
ヤマダホールディングス	564,000	400.00	225,600,000	
アークランドサカモト	24,100	1,535.00	36,993,500	
ニトリホールディングス	61,200	16,470.00	1,007,964,000	
グルメ杵屋	12,300	1,035.00	12,730,500	貸付有価証券 5,700株
愛眼	11,300	184.00	2,079,200	
ケーユーホールディングス	8,000	1,082.00	8,656,000	
吉野家ホールディングス	53,800	2,442.00	131,379,600	貸付有価証券 25,200株
松屋フーズホールディングス	7,400	3,660.00	27,084,000	貸付有価証券 3,300株
サガミホールディングス	23,600	1,203.00	28,390,800	貸付有価証券 11,000株
関西フードマーケット	11,600	1,121.00	13,003,600	貸付有価証券 5,400株(3,700株)
王将フードサービス	10,200	6,060.00	61,812,000	
ブレナス	17,300	2,033.00	35,170,900	
ミニストップ	11,400	1,485.00	16,929,000	貸付有価証券 3,200株(200株)
アークス	29,400	2,173.00	63,886,200	貸付有価証券 13,800株
パローホールディングス	34,100	2,222.00	75,770,200	
ベルク	6,800	5,250.00	35,700,000	
大庄	8,200	1,035.00	8,487,000	貸付有価証券 3,800株
ファーストリテイリング	20,600	63,700.00	1,312,220,000	貸付有価証券 400株
サンドラッグ	58,000	3,090.00	179,220,000	貸付有価証券 200株
サックスパーホールディングス	14,500	521.00	7,554,500	貸付有価証券 400株
ヤマザワ	3,600	1,644.00	5,918,400	
やまや	3,200	2,541.00	8,131,200	貸付有価証券 700株
ベルーナ	33,100	725.00	23,997,500	貸付有価証券 600株
島根銀行	4,900	572.00	2,802,800	

じもとホールディングス	11,000	711.00	7,821,000	
めぶきフィナンシャルグループ	802,600	286.00	229,543,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,400	2,049.00	39,750,600	
九州フィナンシャルグループ	315,400	430.00	135,622,000	貸付有価証券 5,800株
ゆうちょ銀行	364,600	1,026.00	374,079,600	貸付有価証券 51,700株
富山第一銀行	36,800	321.00	11,812,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	882,200	498.00	439,335,600	貸付有価証券 1,200株
西日本フィナンシャルホールディングス	100,900	869.00	87,682,100	
三十三フィナンシャルグループ	14,300	1,554.00	22,222,200	
第四北越フィナンシャルグループ	25,100	2,803.00	70,355,300	
ひろぎんホールディングス	227,800	705.00	160,599,000	貸付有価証券 500株
おきなわフィナンシャルグループ	13,900	2,440.00	33,916,000	
十六フィナンシャルグループ	20,700	2,479.00	51,315,300	
北國フィナンシャルホールディングス	14,400	3,440.00	49,536,000	貸付有価証券 200株
新生銀行	100,800	2,240.00	225,792,000	貸付有価証券 11,000株
あおぞら銀行	86,300	2,708.00	233,700,400	貸付有価証券 400株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,687,000	738.80	7,156,755,600	
りそなホールディングス	1,767,900	549.60	971,637,840	貸付有価証券 1,000株
三井住友トラスト・ホールディングス	292,000	4,235.00	1,236,620,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,069,200	4,321.00	4,620,013,200	
千葉銀行	515,500	787.00	405,698,500	貸付有価証券 1,300株
群馬銀行	296,700	407.00	120,756,900	貸付有価証券 1,100株

武蔵野銀行	23,000	1,968.00	45,264,000	貸付有価証券 500株
千葉興業銀行	36,300	286.00	10,381,800	貸付有価証券 100株
筑波銀行	60,200	224.00	13,484,800	貸付有価証券 200株
七十七銀行	48,500	1,585.00	76,872,500	
青森銀行	12,000	1,969.00	23,628,000	貸付有価証券 200株
秋田銀行	9,900	1,789.00	17,711,100	
山形銀行	17,400	1,033.00	17,974,200	
岩手銀行	10,100	1,963.00	19,826,300	
東邦銀行	128,900	227.00	29,260,300	
東北銀行	7,400	1,030.00	7,622,000	
みちのく銀行	9,900	900.00	8,910,000	
ふくおかフィナンシャル グループ	130,100	2,442.00	317,704,200	貸付有価証券 2,700株
静岡銀行	376,200	917.00	344,975,400	貸付有価証券 600株
スルガ銀行	135,400	455.00	61,607,000	貸付有価証券 300株
八十二銀行	347,900	449.00	156,207,100	貸付有価証券 800株
山梨中央銀行	16,700	981.00	16,382,700	
大垣共立銀行	30,500	2,107.00	64,263,500	
福井銀行	13,200	1,498.00	19,773,600	
清水銀行	6,400	1,651.00	10,566,400	
富山銀行	2,800	2,261.00	6,330,800	
滋賀銀行	29,000	2,310.00	66,990,000	
南都銀行	24,100	2,189.00	52,754,900	貸付有価証券 100株
百五銀行	148,300	369.00	54,722,700	貸付有価証券 500株
京都銀行	55,300	5,720.00	316,316,000	
紀陽銀行	52,400	1,611.00	84,416,400	
ほくほくフィナンシャル グループ	96,400	987.00	95,146,800	貸付有価証券 600株
山陰合同銀行	91,600	706.00	64,669,600	
中国銀行	123,400	945.00	116,613,000	貸付有価証券

				1,100株
鳥取銀行	4,900	1,322.00	6,477,800	
伊予銀行	204,700	648.00	132,645,600	貸付有価証券 100株
百十四銀行	16,400	1,809.00	29,667,600	
四国銀行	23,500	820.00	19,270,000	貸付有価証券 100株
阿波銀行	23,700	2,390.00	56,643,000	
大分銀行	8,900	2,077.00	18,485,300	
宮崎銀行	9,600	2,304.00	22,118,400	
佐賀銀行	8,700	1,572.00	13,676,400	
琉球銀行	33,500	869.00	29,111,500	
セブン銀行	458,700	249.00	114,216,300	貸付有価証券 68,800株
みずほフィナンシャルグループ	1,975,400	1,610.50	3,181,381,700	
高知銀行	5,600	775.00	4,340,000	
山口フィナンシャルグループ	179,900	747.00	134,385,300	貸付有価証券 100株
長野銀行	5,100	1,278.00	6,517,800	
名古屋銀行	11,500	3,290.00	37,835,000	貸付有価証券 1,800株
北洋銀行	232,800	275.00	64,020,000	
愛知銀行	5,600	4,870.00	27,272,000	
中京銀行	5,600	1,697.00	9,503,200	
大光銀行	5,300	1,510.00	8,003,000	
愛媛銀行	21,600	1,003.00	21,664,800	
トマト銀行	5,500	1,069.00	5,879,500	
京葉銀行	65,900	545.00	35,915,500	
栃木銀行	74,600	240.00	17,904,000	
北日本銀行	4,800	1,750.00	8,400,000	
東和銀行	27,100	583.00	15,799,300	
福島銀行	17,700	252.00	4,460,400	貸付有価証券 200株
大東銀行	7,400	764.00	5,653,600	
トモニホールディングス	119,400	373.00	44,536,200	貸付有価証券 100株
フィデアホールディングス	14,100	1,434.00	20,219,400	貸付有価証券 100株

池田泉州ホールディングス	177,600	194.00	34,454,400	貸付有価証券 1,300株
F P G	52,000	873.00	45,396,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	12,000	1,174.00	14,088,000	貸付有価証券 4,900株
マーキュリアホールディングス	6,100	534.00	3,257,400	
S B I ホールディングス	190,600	3,105.00	591,813,000	貸付有価証券 8,100株
日本アジア投資	12,200	176.00	2,147,200	
ジャフコ グループ	59,000	1,699.00	100,241,000	貸付有価証券 23,700株(23,700株)
大和証券グループ本社	1,156,800	692.90	801,546,720	貸付有価証券 2,200株
野村ホールディングス	2,358,400	545.30	1,286,035,520	貸付有価証券 1,000株
岡三証券グループ	121,500	390.00	47,385,000	
丸三証券	45,900	542.00	24,877,800	貸付有価証券 7,600株
東洋証券	51,000	156.00	7,956,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	177,400	412.00	73,088,800	貸付有価証券 200株
光世証券	3,200	473.00	1,513,600	
水戸証券	41,200	281.00	11,577,200	
いちよし証券	28,900	665.00	19,218,500	
松井証券	75,600	821.00	62,067,600	
マネックスグループ	125,900	536.00	67,482,400	貸付有価証券 500株
極東証券	20,700	775.00	16,042,500	
岩井コスモホールディングス	14,600	1,409.00	20,571,400	貸付有価証券 200株
アイザワ証券グループ	25,400	946.00	24,028,400	
マネーパートナーズグループ	16,400	236.00	3,870,400	
スパークス・グループ	71,300	259.00	18,466,700	貸付有価証券 400株
小林洋行	5,500	222.00	1,221,000	
かんぽ生命保険	155,500	2,089.00	324,839,500	
S O M P O ホールディングス	253,600	5,414.00	1,372,990,400	

アニコム ホールディングス	47,400	791.00	37,493,400	
MS & A Dインシュアランスグループホール	346,400	3,999.00	1,385,253,600	貸付有価証券 1,300株
第一生命ホールディングス	760,300	2,658.00	2,020,877,400	貸付有価証券 4,400株
東京海上ホールディングス	508,700	7,061.00	3,591,930,700	貸付有価証券 400株
T & Dホールディングス	400,900	1,807.00	724,426,300	
アドバンスクリエイト	7,400	1,014.00	7,503,600	貸付有価証券 3,200株
全国保証	36,800	4,850.00	178,480,000	貸付有価証券 600株
あんしん保証	4,600	288.00	1,324,800	
ジェイリース	5,200	1,961.00	10,197,200	貸付有価証券 2,400株(200株)
イントラスト	6,500	585.00	3,802,500	
日本モーゲージサービス	8,600	1,021.00	8,780,600	
C a s a	5,400	841.00	4,541,400	貸付有価証券 2,000株
アルヒ	22,800	1,034.00	23,575,200	貸付有価証券 5,500株(5,300株)
プレミアグループ	7,800	4,335.00	33,813,000	
ネットプロテクションズ ホールディングス	35,200	598.00	21,049,600	貸付有価証券 15,300株(2,300株)
クレディセゾン	99,200	1,381.00	136,995,200	貸付有価証券 2,800株
芙蓉総合リース	16,200	7,920.00	128,304,000	
みずほリース	23,800	3,285.00	78,183,000	貸付有価証券 10,800株
東京センチュリー	29,900	5,770.00	172,523,000	
日本証券金融	60,700	900.00	54,630,000	
アイフル	259,200	366.00	94,867,200	貸付有価証券 1,600株
リコーリース	13,700	3,850.00	52,745,000	
イオンフィナンシャル サービス	84,000	1,273.00	106,932,000	
アコム	304,700	331.00	100,855,700	
ジャックス	17,100	3,270.00	55,917,000	
オリエン트コーポレー	417,800	127.00	53,060,600	貸付有価証券

ション				5,200株
オリックス	937,700	2,376.00	2,227,975,200	
三菱H C キャピタル	570,600	605.00	345,213,000	
九州リースサービス	7,600	601.00	4,567,600	貸付有価証券 2,800株
日本取引所グループ	391,200	2,254.00	881,764,800	
イー・ギャランティ	22,700	2,047.00	46,466,900	
アサックス	8,000	684.00	5,472,000	貸付有価証券 4,500株
NEC キャピタルソ リューション	6,300	2,153.00	13,563,900	
いちご	172,000	283.00	48,676,000	
日本駐車場開発	169,400	136.00	23,038,400	
スター・マイカ・ホール ディングス	8,300	1,203.00	9,984,900	
S R E ホールディングス	3,800	3,680.00	13,984,000	
A D ワークスグループ	32,100	142.00	4,558,200	貸付有価証券 13,900株
ヒューリック	368,900	1,060.00	391,034,000	貸付有価証券 60,100株
三栄建築設計	6,200	1,640.00	10,168,000	
野村不動産ホールディン グス	79,900	2,806.00	224,199,400	
三重交通グループホール ディングス	31,300	475.00	14,867,500	貸付有価証券 14,700株
サムティ	24,800	2,129.00	52,799,200	貸付有価証券 9,600株
ディア・ライフ	19,900	513.00	10,208,700	貸付有価証券 600株
コーセーアールイー	4,500	593.00	2,668,500	貸付有価証券 1,500株(300株)
地主	9,800	1,796.00	17,600,800	貸付有価証券 4,400株
プレサンスコーポレー ション	20,100	1,824.00	36,662,400	貸付有価証券 900株
ハウスコム	2,700	1,254.00	3,385,800	
日本管理センター	7,400	1,032.00	7,636,800	
サンセイランディック	4,500	817.00	3,676,500	貸付有価証券 700株(700株)
エストラスト	1,800	582.00	1,047,600	貸付有価証券 800株

フージャースホールディングス	19,700	693.00	13,652,100	
オープンハウスグループ	49,100	5,120.00	251,392,000	貸付有価証券 100株
東急不動産ホールディングス	455,000	665.00	302,575,000	
飯田グループホールディングス	128,800	2,181.00	280,912,800	
イーランド	2,500	1,396.00	3,490,000	
ムゲンエステート	9,500	484.00	4,598,000	貸付有価証券 600株(600株)
ビーロット	10,500	499.00	5,239,500	
ファーストブラザーズ	3,500	825.00	2,887,500	貸付有価証券 1,600株
And Doホールディングス	7,600	881.00	6,695,600	貸付有価証券 600株(600株)
シーアールイー	4,300	1,696.00	7,292,800	貸付有価証券 1,400株
プロパティエージェント	1,800	1,537.00	2,766,600	貸付有価証券 1,100株
ケイアイスター不動産	6,900	5,350.00	36,915,000	
アグレ都市デザイン	2,500	1,262.00	3,155,000	
グッドコムアセット	6,700	1,177.00	7,885,900	
ジェイ・エス・ビー	3,100	3,120.00	9,672,000	
テンポイノベーション	4,300	836.00	3,594,800	
グローバル・リンク・マネジメント	2,700	848.00	2,289,600	貸付有価証券 100株
フェイスネットワーク	1,500	1,329.00	1,993,500	
パーク24	82,900	1,808.00	149,883,200	貸付有価証券 200株
パラカ	4,000	1,663.00	6,652,000	貸付有価証券 1,700株
三井不動産	704,200	2,585.00	1,820,357,000	貸付有価証券 2,100株
三菱地所	1,014,900	1,789.50	1,816,163,550	貸付有価証券 1,100株
平和不動産	26,500	4,090.00	108,385,000	
東京建物	152,600	1,813.00	276,663,800	貸付有価証券 400株
ダイビル	39,200	2,195.00	86,044,000	貸付有価証券 200株

京阪神ビルディング	23,900	1,466.00	35,037,400	
住友不動産	324,100	3,608.00	1,169,352,800	貸付有価証券 900株
テーオーシー	27,800	727.00	20,210,600	貸付有価証券 400株
東京楽天地	2,500	3,925.00	9,812,500	
レオパレス21	160,200	232.00	37,166,400	
スターツコーポレーション	21,000	2,543.00	53,403,000	
フジ住宅	17,900	663.00	11,867,700	
空港施設	15,500	565.00	8,757,500	
明和地所	7,300	603.00	4,401,900	
ゴールドクレスト	12,200	1,864.00	22,740,800	貸付有価証券 400株
エスリード	6,000	1,765.00	10,590,000	貸付有価証券 2,800株
日神グループホールディングス	25,100	496.00	12,449,600	貸付有価証券 10,400株
日本エスコン	28,800	757.00	21,801,600	貸付有価証券 1,800株
タカラレーベン	64,700	321.00	20,768,700	
AVANTIA	8,000	849.00	6,792,000	貸付有価証券 300株
イオンモール	77,400	1,655.00	128,097,000	貸付有価証券 36,300株
毎日コムネット	5,300	698.00	3,699,400	
ファースト住建	5,800	1,180.00	6,844,000	
カチタス	38,200	3,350.00	127,970,000	
トーセイ	21,300	1,084.00	23,089,200	
穴吹興産	3,400	2,006.00	6,820,400	
サンフロンティア不動産	21,300	1,095.00	23,323,500	
FJネクストホールディングス	15,200	993.00	15,093,600	
インテリックス	3,500	631.00	2,208,500	
ランドビジネス	6,500	243.00	1,579,500	
サンネクスタグループ	4,900	1,017.00	4,983,300	
グランディハウス	10,500	581.00	6,100,500	
日本空港ビルデング	58,900	5,700.00	335,730,000	
明豊ファシリティワーク	6,800	708.00	4,814,400	

ス				
日本工営	9,500	3,000.00	28,500,000	
L I F U L L	45,700	232.00	10,602,400	貸付有価証券 1,700株
ミクシィ	34,200	2,291.00	78,352,200	
ジェイエシーリクルー トメント	12,100	1,752.00	21,199,200	
日本M&Aセンターホー ルディングス	245,500	1,769.00	434,289,500	
メンバーズ	4,500	2,960.00	13,320,000	貸付有価証券 600株
中広	2,400	391.00	938,400	
UTグループ	21,600	3,405.00	73,548,000	貸付有価証券 1,200株（800株）
アイティメディア	7,100	1,613.00	11,452,300	
E・Jホールディングス	8,600	1,134.00	9,752,400	貸付有価証券 3,400株
夢真ピーネックスグルー プ	48,700	1,560.00	75,972,000	貸付有価証券 200株
コシダカホールディング ス	40,000	659.00	26,360,000	貸付有価証券 9,400株
アルトナー	3,600	867.00	3,121,200	
パソナグループ	16,200	2,385.00	38,637,000	
C D S	3,700	1,615.00	5,975,500	
リンクアンドモチベー ション	33,000	428.00	14,124,000	貸付有価証券 15,500株（5,500株）
エス・エム・エス	50,800	3,075.00	156,210,000	
サニーサイドアップグ ループ	5,200	743.00	3,863,600	貸付有価証券 300株（300株）
パーソルホールディング ス	149,600	2,479.00	370,858,400	
リニカル	8,400	679.00	5,703,600	
クックパッド	47,000	256.00	12,032,000	貸付有価証券 1,200株
エスクリ	6,700	425.00	2,847,500	貸付有価証券 2,600株
アイ・ケイ・ケイホール ディングス	7,300	580.00	4,234,000	
学情	6,100	1,000.00	6,100,000	貸付有価証券 2,600株
スタジオアリス	6,700	2,197.00	14,719,900	貸付有価証券

				4,100株
シミックホールディングス	8,300	1,549.00	12,856,700	貸付有価証券 3,900株
エプコ	3,200	693.00	2,217,600	貸付有価証券 200株
N J S	3,300	2,000.00	6,600,000	
総合警備保障	59,500	4,210.00	250,495,000	貸付有価証券 200株
カカクコム	109,800	2,587.00	284,052,600	貸付有価証券 700株
セントケア・ホールディング	9,700	815.00	7,905,500	
サイネックス	2,500	607.00	1,517,500	
ルネサンス	10,400	1,105.00	11,492,000	貸付有価証券 2,200株
ディップ	26,300	3,485.00	91,655,500	貸付有価証券 2,300株
デジタルホールディングス	10,400	1,554.00	16,161,600	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
新日本科学	18,200	1,595.00	29,029,000	
キャリアデザインセンター	3,800	1,216.00	4,620,800	
ベネフィット・ワン	54,400	2,465.00	134,096,000	貸付有価証券 4,200株
エムスリー	264,000	4,042.00	1,067,088,000	
ツカダ・グローバルホールディング	9,500	330.00	3,135,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
プラス	1,900	695.00	1,320,500	
アウトソーシング	85,700	1,343.00	115,095,100	貸付有価証券 25,200株(25,200株)
ウェルネット	15,100	441.00	6,659,100	貸付有価証券 800株
ワールドホールディングス	6,000	2,046.00	12,276,000	貸付有価証券 100株
ディー・エヌ・エー	57,000	1,747.00	99,579,000	
博報堂D Yホールディングス	208,400	1,547.00	322,394,800	
ぐるなび	24,600	431.00	10,602,600	貸付有価証券 5,200株
タカミヤ	18,100	384.00	6,950,400	
ジャパンベストレス	10,100	972.00	9,817,200	

キューシステム				
ファンコミュニケーションズ	37,400	387.00	14,473,800	貸付有価証券 3,700株
ライク	5,000	1,834.00	9,170,000	貸付有価証券 800株（800株）
ビジネス・ブレイクスルー	5,500	441.00	2,425,500	貸付有価証券 1,500株
エスプール	42,300	984.00	41,623,200	
W D Bホールディングス	6,800	2,692.00	18,305,600	
手間いらず	2,200	5,140.00	11,308,000	貸付有価証券 400株（400株）
ティア	8,700	440.00	3,828,000	
C D G	1,600	1,340.00	2,144,000	
アドウェイズ	22,300	670.00	14,941,000	貸付有価証券 100株
バリューコマース	11,700	3,435.00	40,189,500	
インフォマート	164,000	613.00	100,532,000	貸付有価証券 400株
J Pホールディングス	38,400	230.00	8,832,000	貸付有価証券 300株
C Lホールディングス	3,200	1,107.00	3,542,400	貸付有価証券 300株（300株）
プレステージ・インターナショナル	56,100	713.00	39,999,300	
アミューズ	8,100	2,117.00	17,147,700	
ドリームインキュベータ	4,100	2,530.00	10,373,000	貸付有価証券 1,800株（100株）
クイック	10,200	1,580.00	16,116,000	
T A C	8,100	223.00	1,806,300	
電通グループ	154,300	4,885.00	753,755,500	貸付有価証券 5,500株
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,000	1,319.00	9,233,000	
ぴあ	5,200	3,465.00	18,018,000	
イオンファンタジー	5,800	2,148.00	12,458,400	貸付有価証券 2,700株（200株）
シーティーエス	16,900	818.00	13,824,200	
ネクシィーズグループ	5,200	651.00	3,385,200	貸付有価証券 200株（200株）
H . U . グループホールディングス	39,100	3,035.00	118,668,500	

アルプス技研	13,200	1,937.00	25,568,400	
ダイオーズ	2,900	1,000.00	2,900,000	貸付有価証券 1,300株
日本空調サービス	15,700	789.00	12,387,300	
オリエンタルランド	176,800	22,425.00	3,964,740,000	貸付有価証券 2,800株
ダスキン	34,700	2,757.00	95,667,900	
明光ネットワークジャパン	17,600	573.00	10,084,800	
ファルコホールディングス	7,100	1,999.00	14,192,900	
秀英予備校	3,300	422.00	1,392,600	貸付有価証券 1,400株
ラウンドワン	41,800	1,418.00	59,272,400	貸付有価証券 500株
リゾートトラスト	68,600	2,042.00	140,081,200	貸付有価証券 200株
ビー・エム・エル	19,300	3,425.00	66,102,500	
りらいあコミュニケーションズ	22,100	1,060.00	23,426,000	
リソー教育	68,400	389.00	26,607,600	
早稲田アカデミー	8,300	1,001.00	8,308,300	貸付有価証券 2,900株
ユー・エス・エス	167,500	1,958.00	327,965,000	貸付有価証券 1,200株
東京個別指導学院	13,200	622.00	8,210,400	貸付有価証券 6,200株（700株）
サイバーエージェント	368,800	1,497.00	552,093,600	
楽天グループ	769,100	965.00	742,181,500	貸付有価証券 2,700株
クリーク・アンド・リバー社	7,800	1,680.00	13,104,000	
モーニングスター	26,200	564.00	14,776,800	
テー・オー・ダブリュー	28,600	297.00	8,494,200	
山田コンサルティンググループ	7,700	1,140.00	8,778,000	
セントラルスポーツ	5,600	2,443.00	13,680,800	貸付有価証券 2,500株
フルキャストホールディングス	12,800	2,183.00	27,942,400	貸付有価証券 300株
エン・ジャパン	24,200	2,886.00	69,841,200	

リソルホールディングス	1,600	4,345.00	6,952,000	貸付有価証券 700株
テクノプロ・ホールディングス	89,600	3,290.00	294,784,000	貸付有価証券 500株
アトラグループ	3,300	264.00	871,200	
インターワークス	4,300	372.00	1,599,600	
アイ・アールジャパン ホールディングス	6,900	3,855.00	26,599,500	
KeePer 技研	9,600	2,090.00	20,064,000	
ファーストロジック	2,900	803.00	2,328,700	
三機サービス	2,600	1,011.00	2,628,600	
Gunosy	8,200	793.00	6,502,600	貸付有価証券 500株
デザインワン・ジャパン	3,700	188.00	695,600	
イー・ガーディアン	6,100	2,608.00	15,908,800	
リブセンス	8,200	170.00	1,394,000	貸付有価証券 400株
ジャパンマテリアル	46,000	1,741.00	80,086,000	
ベクトル	21,000	1,057.00	22,197,000	貸付有価証券 9,800株（800株）
ウチヤマホールディングス	7,400	329.00	2,434,600	貸付有価証券 100株
チャーム・ケア・コーポ レーション	11,100	1,054.00	11,699,400	
キャリアリンク	5,500	1,445.00	7,947,500	貸付有価証券 1,000株
I B J	12,300	819.00	10,073,700	貸付有価証券 900株
アサンテ	6,600	1,603.00	10,579,800	貸付有価証券 2,300株
バリューHR	6,000	2,497.00	14,982,000	貸付有価証券 2,600株
M&Aキャピタルパート ナーズ	12,300	5,090.00	62,607,000	
ライドオンエクスプレス ホールディングス	5,800	1,348.00	7,818,400	貸付有価証券 700株（600株）
E R Iホールディングス	4,200	1,126.00	4,729,200	貸付有価証券 400株（400株）
アビスト	2,300	2,916.00	6,706,800	
シグマクス・ホール ディングス	9,000	2,008.00	18,072,000	

ウィルグループ	11,000	1,215.00	13,365,000	
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	20,000	192.00	3,840,000	
メドピア	11,500	2,616.00	30,084,000	貸付有価証券 3,000株
レアジョブ	2,800	794.00	2,223,200	貸付有価証券 200株(200株)
リクルートホールディン グス	1,154,500	4,828.00	5,573,926,000	
エラン	20,600	968.00	19,940,800	
土木管理総合試験所	6,900	322.00	2,221,800	
ネットマーケティング	7,300	405.00	2,956,500	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
日本郵政	1,954,200	982.40	1,919,806,080	
ベルシステム24ホール ディングス	21,500	1,392.00	29,928,000	貸付有価証券 200株
鎌倉新書	17,000	510.00	8,670,000	貸付有価証券 6,700株(2,600株)
S MN	3,300	593.00	1,956,900	
一蔵	1,900	371.00	704,900	
グローバルキッズCOM P A N Y	2,700	791.00	2,135,700	
エアトリ	9,700	3,470.00	33,659,000	貸付有価証券 3,500株(300株)
アトラエ	10,400	2,003.00	20,831,200	
ストライク	5,600	4,420.00	24,752,000	
ソラスト	36,800	1,001.00	36,836,800	
セラク	4,700	1,162.00	5,461,400	
インソース	14,500	1,923.00	27,883,500	貸付有価証券 6,800株
ベイカレント・コンサル ティング	10,600	39,950.00	423,470,000	
Orchestra H oldings	2,900	2,778.00	8,056,200	貸付有価証券 200株(200株)
アイモバイル	4,200	1,225.00	5,145,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
キャリアインデックス	5,100	705.00	3,595,500	
MS - J a p a n	6,100	836.00	5,099,600	
船場	3,000	743.00	2,229,000	
ジャパンエレベーター	47,500	1,539.00	73,102,500	

サービスホールディング				
フルテック	2,100	1,328.00	2,788,800	
グリーンズ	5,600	530.00	2,968,000	
ツナググループ・ホールディングス	3,300	273.00	900,900	
GameWith	4,500	435.00	1,957,500	
ソウルドアウト	3,600	1,804.00	6,494,400	貸付有価証券 500株(500株)
MS&Consulting	2,200	699.00	1,537,800	
ウェルビー	9,800	1,151.00	11,279,800	
エル・ティー・エス	1,900	1,982.00	3,765,800	貸付有価証券 800株(800株)
ミダックホールディングス	6,800	2,306.00	15,680,800	貸付有価証券 3,000株(200株)
日総工産	11,700	822.00	9,617,400	貸付有価証券 800株
キュービーネットホールディングス	6,900	1,756.00	12,116,400	
RPAホールディングス	21,100	348.00	7,342,800	貸付有価証券 7,900株(7,900株)
スプリックス	4,300	1,517.00	6,523,100	
マネジメントソリューションズ	7,300	3,115.00	22,739,500	
プロレド・パートナーズ	3,300	801.00	2,643,300	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
and factory	3,400	387.00	1,315,800	貸付有価証券 500株(100株)
テノ・ホールディングス	1,800	565.00	1,017,000	
フロンティア・マネジメント	3,900	811.00	3,162,900	
ピアラ	2,400	540.00	1,296,000	貸付有価証券 200株(200株)
コプロ・ホールディングス	2,900	1,054.00	3,056,600	
ギークス	2,600	1,120.00	2,912,000	貸付有価証券 100株(100株)
カーブスホールディングス	41,100	712.00	29,263,200	
フォーラムエンジニアリング	10,400	857.00	8,912,800	貸付有価証券 100株

Fast Fitness Japan	2,000	1,812.00	3,624,000	
ダイレクトマーケティングミックス	17,300	1,448.00	25,050,400	貸付有価証券 400株（400株）
ポピンズホールディングス	3,500	2,345.00	8,207,500	
LITALICO	12,100	3,100.00	37,510,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	7,600	663.00	5,038,800	
リログループ	81,800	1,742.00	142,495,600	貸付有価証券 600株
東祥	11,200	1,765.00	19,768,000	貸付有価証券 4,200株
TREホールディングス	20,500	1,503.00	30,811,500	
人・夢・技術グループ	6,000	1,882.00	11,292,000	
エイチ・アイ・エス	33,200	2,117.00	70,284,400	貸付有価証券 10,900株
ラックランド	4,300	2,794.00	12,014,200	貸付有価証券 1,000株
共立メンテナンス	26,700	4,550.00	121,485,000	貸付有価証券 2,400株（800株）
イチネンホールディングス	15,300	1,311.00	20,058,300	
建設技術研究所	8,900	2,312.00	20,576,800	
スペース	10,700	933.00	9,983,100	
燦ホールディングス	6,500	1,484.00	9,646,000	
スバル興業	900	8,040.00	7,236,000	貸付有価証券 400株
東京テアトル	5,800	1,251.00	7,255,800	貸付有価証券 2,600株
タナベ経営	5,700	642.00	3,659,400	
ナガワ	4,800	9,660.00	46,368,000	貸付有価証券 2,200株
東京都競馬	11,200	4,130.00	46,256,000	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
常磐興産	6,000	1,366.00	8,196,000	貸付有価証券 2,600株
カナモト	26,400	2,327.00	61,432,800	貸付有価証券 11,700株
西尾レントオール	13,800	2,872.00	39,633,600	
トランス・コスモス	19,000	3,180.00	60,420,000	貸付有価証券

				3,600株(2,100株)
乃村工藝社	64,100	939.00	60,189,900	
藤田観光	6,500	2,385.00	15,502,500	貸付有価証券 3,000株
KNT-CTホールディングス	9,300	1,562.00	14,526,600	貸付有価証券 4,500株
日本管財	16,000	2,771.00	44,336,000	
トーカイ	13,100	1,843.00	24,143,300	
白洋舎	1,700	1,184.00	2,012,800	貸付有価証券 700株
セコム	147,500	8,614.00	1,270,565,000	
セントラル警備保障	7,200	2,410.00	17,352,000	貸付有価証券 300株(300株)
丹青社	30,600	737.00	22,552,200	
メイテック	18,100	6,970.00	126,157,000	
応用地質	16,900	2,076.00	35,084,400	
船井総研ホールディングス	30,600	2,230.00	68,238,000	
進学会ホールディングス	4,900	363.00	1,778,700	貸付有価証券 1,400株(200株)
オオバ	10,500	715.00	7,507,500	貸付有価証券 4,600株
いであ	4,000	1,763.00	7,052,000	貸付有価証券 200株(100株)
学究社	4,800	1,628.00	7,814,400	
ベネッセホールディングス	49,900	2,382.00	118,861,800	
イオンディライト	18,400	2,994.00	55,089,600	貸付有価証券 2,800株
ナック	7,100	982.00	6,972,200	貸付有価証券 100株
ダイセキ	27,300	4,395.00	119,983,500	
ステップ	5,500	1,856.00	10,208,000	
小計	銘柄数：2,161		413,338,987,610	
	組入時価比率：98.7%		100.0%	
合計			413,338,987,610	

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

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

(2) 株式以外の有価証券(2022年2月17日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年 2月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	5,484,811,908	-	5,607,570,000	122,614,047
合計	5,484,811,908	-	5,607,570,000	122,614,047

(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。

国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	187,231,791
国債証券	21,655,238,320
未収利息	51,911,570
前払費用	7,974,185
流動資産合計	21,902,355,866
資産合計	21,902,355,866
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,068,562
未払利息	126
流動負債合計	5,068,688
負債合計	5,068,688
純資産の部	
元本等	
元本	16,378,722,981
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	5,518,564,197
元本等合計	21,897,287,178

(2022年 2月17日現在)

純資産合計	21,897,287,178
負債純資産合計	21,902,355,866

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
2. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 2月17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	1.3369円
(10,000口当たり純資産額)	(13,369円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 2月17日現在	
期首	2021年 2月18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	22,378,002,418円
同期中における追加設定元本額	6,727,944,352円
同期中における一部解約元本額	12,727,223,789円
期末元本額	16,378,722,981円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	564,172,231円
バランスセレクト50	622,792,935円
バランスセレクト70	301,423,408円
ネクストコア	203,821,348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)	1,985,105,405円
野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)	1,037,728,552円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	24,480,927円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	56,255,327円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	22,432,425円
野村日本国債インデックスファンド(確定拠出年金向け)	5,071,245,000円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	176,041,267円
野村DC運用戦略ファンド	5,563,922,235円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	749,301,921円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年2月17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424回	160,000,000	160,123,200	
		国庫債券 利付(5年)第135回	100,000,000	100,173,000	
		国庫債券 利付(5年)第136回	200,000,000	200,412,000	
		国庫債券 利付(5年)第137回	300,000,000	300,690,000	
		国庫債券 利付(5年)第139回	420,000,000	421,003,800	
		国庫債券 利付(5年)第140回	370,000,000	370,906,500	
		国庫債券 利付(5年)第141回	340,000,000	340,833,000	
		国庫債券 利付(5年)第142回	150,000,000	150,382,500	
		国庫債券 利付(5年)第145回	270,000,000	270,772,200	
		国庫債券 利付(5年)第146回	250,000,000	250,717,500	
		国庫債券 利付(5年)第147回	250,000,000	249,745,000	
		国庫債券 利付(5年)第148回	220,000,000	219,714,000	
		国庫債券 利付(5年)第149回	250,000,000	249,540,000	
		国庫債券 利付(40年)第1回	100,000,000	134,818,000	
		国庫債券 利付(40年)第2回	110,000,000	143,163,900	
		国庫債券 利付(40年)第3回	100,000,000	130,605,000	
		国庫債券 利付(40年)第4回	120,000,000	157,774,800	
		国庫債券 利付(40年)第5回	120,000,000	152,511,600	
		国庫債券 利付(40年)第6回	80,000,000	100,037,600	
		国庫債券 利付(40年)第7回	40,000,000	48,085,600	
		国庫債券 利付(40年)第8回	60,000,000	67,389,600	
		国庫債券 利付(40年)第9回	20,000,000	16,737,000	
		国庫債券 利付(40年)第10回	40,000,000	39,215,600	
		国庫債券 利付(40年)第11回	30,000,000	28,484,400	
		国庫債券 利付(40年)第12回	20,000,000	17,086,800	
		国庫債券 利付(40年)第13回	90,000,000	76,533,300	
		国庫債券 利付(40年)第14回	120,000,000	109,117,200	
国庫債券 利付(10年)第328回	280,000,000	281,999,200			
国庫債券 利付(10年)第329回	150,000,000	151,711,500			

国庫債券 利付(10年)第330回	220,000,000	222,932,600	
国庫債券 利付(10年)第331回	90,000,000	90,913,500	
国庫債券 利付(10年)第332回	350,000,000	354,014,500	
国庫債券 利付(10年)第333回	250,000,000	253,175,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	220,000,000	223,106,400	
国庫債券 利付(10年)第335回	200,000,000	202,560,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	120,000,000	121,666,800	
国庫債券 利付(10年)第337回	100,000,000	100,822,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	80,000,000	80,948,800	
国庫債券 利付(10年)第339回	100,000,000	101,266,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	200,000,000	202,106,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	230,000,000	230,655,500	
国庫債券 利付(10年)第343回	200,000,000	200,562,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	300,000,000	300,753,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	360,000,000	360,867,600	
国庫債券 利付(10年)第346回	270,000,000	270,545,400	
国庫債券 利付(10年)第347回	200,000,000	200,372,000	
国庫債券 利付(10年)第348回	150,000,000	150,249,000	
国庫債券 利付(10年)第349回	100,000,000	100,145,000	
国庫債券 利付(10年)第350回	320,000,000	320,387,200	
国庫債券 利付(10年)第351回	180,000,000	180,169,200	
国庫債券 利付(10年)第352回	310,000,000	310,201,500	
国庫債券 利付(10年)第355回	80,000,000	79,941,600	
国庫債券 利付(10年)第356回	60,000,000	59,909,400	
国庫債券 利付(10年)第357回	130,000,000	129,697,100	
国庫債券 利付(10年)第358回	70,000,000	69,776,000	
	420,000,000	418,269,600	

国庫債券 利付(10年)第359回			
国庫債券 利付(10年)第360回	130,000,000	129,338,300	
国庫債券 利付(10年)第361回	100,000,000	99,347,000	
国庫債券 利付(10年)第362回	40,000,000	39,678,400	
国庫債券 利付(10年)第363回	70,000,000	69,358,100	
国庫債券 利付(10年)第364回	40,000,000	39,586,400	
国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	120,147,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	40,000,000	47,065,200	
国庫債券 利付(30年)第6回	40,000,000	48,441,600	
国庫債券 利付(30年)第7回	15,000,000	18,118,050	
国庫債券 利付(30年)第8回	20,000,000	23,223,400	
国庫債券 利付(30年)第9回	20,000,000	22,379,200	
国庫債券 利付(30年)第10回	30,000,000	32,626,500	
国庫債券 利付(30年)第11回	10,000,000	11,540,900	
国庫債券 利付(30年)第12回	10,000,000	12,008,700	
国庫債券 利付(30年)第13回	10,000,000	11,915,800	
国庫債券 利付(30年)第14回	30,000,000	37,236,900	
国庫債券 利付(30年)第15回	70,000,000	87,950,800	
国庫債券 利付(30年)第16回	10,000,000	12,599,400	
国庫債券 利付(30年)第17回	20,000,000	25,005,600	
国庫債券 利付(30年)第18回	30,000,000	37,201,500	
国庫債券 利付(30年)第19回	10,000,000	12,428,800	
国庫債券 利付(30年)第21回	50,000,000	62,372,500	
国庫債券 利付(30年)第22回	40,000,000	51,062,000	
国庫債券 利付(30年)第23回	40,000,000	51,179,600	
国庫債券 利付(30年)第24回	80,000,000	102,517,600	
国庫債券 利付(30年)第26回	80,000,000	101,744,800	
国庫債券 利付(30年)第27回	100,000,000	129,105,000	
国庫債券 利付(30年)第28回	40,000,000	51,792,400	
国庫債券 利付(30年)第29回	60,000,000	77,047,200	
国庫債券 利付(30年)第30回	100,000,000	127,127,000	
国庫債券 利付(30年)第31回	70,000,000	88,096,400	
国庫債券 利付(30年)第32回	110,000,000	140,618,500	
国庫債券 利付(30年)第33回	100,000,000	122,896,000	
国庫債券 利付(30年)第34回	180,000,000	227,944,800	
国庫債券 利付(30年)第35回	120,000,000	148,017,600	
国庫債券 利付(30年)第36回	80,000,000	98,832,800	
国庫債券 利付(30年)第37回	90,000,000	109,728,900	
国庫債券 利付(30年)第38回	80,000,000	96,077,600	

国庫債券	利付(30年)第39回	80,000,000	97,728,800
国庫債券	利付(30年)第41回	100,000,000	118,380,000
国庫債券	利付(30年)第42回	70,000,000	82,912,200
国庫債券	利付(30年)第43回	80,000,000	94,810,400
国庫債券	利付(30年)第44回	40,000,000	47,430,800
国庫債券	利付(30年)第45回	90,000,000	102,959,100
国庫債券	利付(30年)第46回	90,000,000	102,977,100
国庫債券	利付(30年)第47回	110,000,000	128,185,200
国庫債券	利付(30年)第48回	110,000,000	123,462,900
国庫債券	利付(30年)第49回	80,000,000	89,698,400
国庫債券	利付(30年)第56回	40,000,000	39,249,600
国庫債券	利付(30年)第57回	60,000,000	58,741,800
国庫債券	利付(30年)第58回	90,000,000	87,912,900
国庫債券	利付(30年)第59回	70,000,000	66,664,500
国庫債券	利付(30年)第60回	50,000,000	49,786,000
国庫債券	利付(30年)第61回	80,000,000	75,722,400
国庫債券	利付(30年)第62回	60,000,000	53,778,600
国庫債券	利付(30年)第63回	60,000,000	52,159,800
国庫債券	利付(30年)第64回	60,000,000	51,991,200
国庫債券	利付(30年)第65回	50,000,000	43,232,000
国庫債券	利付(30年)第67回	70,000,000	63,817,600
国庫債券	利付(30年)第68回	60,000,000	54,664,200
国庫債券	利付(30年)第69回	60,000,000	56,096,400
国庫債券	利付(30年)第70回	70,000,000	65,415,700
国庫債券	利付(30年)第71回	30,000,000	28,022,100
国庫債券	利付(30年)第72回	100,000,000	93,363,000
国庫債券	利付(20年)第61回	10,000,000	10,114,700
国庫債券	利付(20年)第62回	80,000,000	80,907,200
国庫債券	利付(20年)第63回	10,000,000	10,247,000
国庫債券	利付(20年)第64回	10,000,000	10,307,900
国庫債券	利付(20年)第65回	10,000,000	10,353,500
国庫債券	利付(20年)第66回	20,000,000	20,670,200
国庫債券	利付(20年)第67回	10,000,000	10,397,700
国庫債券	利付(20年)第68回	80,000,000	83,681,600
国庫債券	利付(20年)第69回	30,000,000	31,318,200
国庫債券	利付(20年)第71回	10,000,000	10,513,500
国庫債券	利付(20年)第72回	20,000,000	21,083,400
国庫債券	利付(20年)第73回	10,000,000	10,562,600
国庫債券	利付(20年)第74回	10,000,000	10,590,900
国庫債券	利付(20年)第75回	40,000,000	42,562,800
国庫債券	利付(20年)第76回	17,000,000	17,984,300
国庫債券	利付(20年)第77回	15,000,000	15,914,700
国庫債券	利付(20年)第78回	10,000,000	10,622,800

国庫債券	利付(20年)第79回	10,000,000	10,656,100	
国庫債券	利付(20年)第80回	10,000,000	10,689,400	
国庫債券	利付(20年)第81回	10,000,000	10,707,600	
国庫債券	利付(20年)第82回	15,000,000	16,115,100	
国庫債券	利付(20年)第83回	15,000,000	16,189,500	
国庫債券	利付(20年)第84回	50,000,000	53,773,500	
国庫債券	利付(20年)第85回	13,000,000	14,097,070	
国庫債券	利付(20年)第86回	10,000,000	10,925,500	
国庫債券	利付(20年)第88回	20,000,000	21,960,400	
国庫債券	利付(20年)第90回	20,000,000	21,972,600	
国庫債券	利付(20年)第91回	10,000,000	11,032,000	
国庫債券	利付(20年)第92回	30,000,000	32,958,600	
国庫債券	利付(20年)第93回	70,000,000	76,880,300	
国庫債券	利付(20年)第94回	20,000,000	22,067,200	
国庫債券	利付(20年)第95回	10,000,000	11,188,000	
国庫債券	利付(20年)第96回	15,000,000	16,622,550	
国庫債券	利付(20年)第97回	50,000,000	55,926,000	
国庫債券	利付(20年)第99回	30,000,000	33,529,500	
国庫債券	利付(20年)第100回	20,000,000	22,573,000	
国庫債券	利付(20年)第101回	20,000,000	22,815,200	
国庫債券	利付(20年)第102回	20,000,000	22,924,200	
国庫債券	利付(20年)第103回	25,000,000	28,497,750	
国庫債券	利付(20年)第104回	10,000,000	11,273,000	
国庫債券	利付(20年)第105回	70,000,000	79,237,900	
国庫債券	利付(20年)第106回	80,000,000	91,081,600	
国庫債券	利付(20年)第107回	100,000,000	113,655,000	
国庫債券	利付(20年)第108回	80,000,000	89,836,800	
国庫債券	利付(20年)第109回	60,000,000	67,618,200	
国庫債券	利付(20年)第110回	90,000,000	102,693,600	
国庫債券	利付(20年)第111回	10,000,000	11,524,700	
国庫債券	利付(20年)第112回	85,000,000	97,342,000	
国庫債券	利付(20年)第113回	160,000,000	183,884,800	
国庫債券	利付(20年)第115回	50,000,000	58,073,000	

国庫債券 回	利付(20年)第116	40,000,000	46,622,400
国庫債券 回	利付(20年)第117	60,000,000	69,453,600
国庫債券 回	利付(20年)第118	40,000,000	46,128,800
国庫債券 回	利付(20年)第119	50,000,000	56,837,500
国庫債券 回	利付(20年)第120	110,000,000	123,229,700
国庫債券 回	利付(20年)第121	70,000,000	80,383,800
国庫債券 回	利付(20年)第122	40,000,000	45,594,800
国庫債券 回	利付(20年)第123	100,000,000	116,902,000
国庫債券 回	利付(20年)第124	50,000,000	58,015,000
国庫債券 回	利付(20年)第125	40,000,000	47,241,200
国庫債券 回	利付(20年)第128	70,000,000	81,015,200
国庫債券 回	利付(20年)第129	50,000,000	57,409,000
国庫債券 回	利付(20年)第130	50,000,000	57,551,500
国庫債券 回	利付(20年)第132	60,000,000	68,647,800
国庫債券 回	利付(20年)第133	110,000,000	126,914,700
国庫債券 回	利付(20年)第134	70,000,000	80,908,800
国庫債券 回	利付(20年)第135	30,000,000	34,379,100
国庫債券 回	利付(20年)第136	30,000,000	34,083,300
国庫債券 回	利付(20年)第137	40,000,000	45,912,000
国庫債券 回	利付(20年)第138	50,000,000	56,381,000
国庫債券 回	利付(20年)第139	60,000,000	68,262,600
国庫債券 回	利付(20年)第140	70,000,000	80,467,800
国庫債券 回	利付(20年)第141	100,000,000	115,115,000
国庫債券 回	利付(20年)第142	100,000,000	116,168,000
国庫債券 回	利付(20年)第143	120,000,000	137,025,600
国庫債券 回	利付(20年)第144	80,000,000	90,490,400
		190,000,000	219,277,100

国庫債券 利付(20年)第145回			
国庫債券 利付(20年)第146回	140,000,000	161,764,400	
国庫債券 利付(20年)第147回	150,000,000	171,796,500	
国庫債券 利付(20年)第148回	170,000,000	192,885,400	
国庫債券 利付(20年)第149回	100,000,000	113,597,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	130,000,000	146,190,200	
国庫債券 利付(20年)第151回	100,000,000	110,035,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	150,000,000	165,019,500	
国庫債券 利付(20年)第153回	120,000,000	133,586,400	
国庫債券 利付(20年)第154回	110,000,000	121,027,500	
国庫債券 利付(20年)第155回	110,000,000	118,033,300	
国庫債券 利付(20年)第156回	10,000,000	9,907,500	
国庫債券 利付(20年)第158回	70,000,000	70,047,600	
国庫債券 利付(20年)第159回	100,000,000	101,311,000	
国庫債券 利付(20年)第160回	10,000,000	10,258,900	
国庫債券 利付(20年)第161回	110,000,000	111,091,200	
国庫債券 利付(20年)第162回	40,000,000	40,316,000	
国庫債券 利付(20年)第163回	100,000,000	100,581,000	
国庫債券 利付(20年)第164回	110,000,000	108,705,300	
国庫債券 利付(20年)第165回	50,000,000	49,329,500	
国庫債券 利付(20年)第166回	60,000,000	60,951,000	
国庫債券 利付(20年)第168回	70,000,000	67,464,600	
国庫債券 利付(20年)第170回	50,000,000	47,126,500	
国庫債券 利付(20年)第171回	70,000,000	65,821,000	
国庫債券 利付(20年)第172回	70,000,000	66,843,700	
国庫債券 利付(20年)第173回	50,000,000	47,601,000	
	30,000,000	28,496,100	

	国庫債券 利付（20年）第174回			
	国庫債券 利付（20年）第175回	80,000,000	77,208,800	
	国庫債券 利付（20年）第176回	60,000,000	57,785,400	
	国庫債券 利付（20年）第177回	30,000,000	28,298,400	
	国庫債券 利付（20年）第178回	130,000,000	124,768,800	
小計	銘柄数：227 組入時価比率：98.9%	20,335,000,000	21,655,238,320 100.0%	
合計			21,655,238,320	

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

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。

外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	9,778,363,619
コール・ローン	1,520,322,316
株式	1,154,554,348,617
投資証券	26,605,529,532
派生商品評価勘定	114,270,524
未収入金	1,112,822
未収配当金	819,824,896
差入委託証拠金	6,479,620,691
流動資産合計	1,199,873,393,017
資産合計	1,199,873,393,017
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	109,980,307
未払解約金	741,678,380
未払利息	1,029
その他未払費用	1,812,600
流動負債合計	853,472,316
負債合計	853,472,316
純資産の部	
元本等	
元本	272,160,916,525
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	926,859,004,176
元本等合計	1,199,019,920,701
純資産合計	1,199,019,920,701
負債純資産合計	1,199,873,393,017

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 2月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	4,4056円
(10,000口当たり純資産額)	(44,056円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 2月18日

至 2022年 2月17日

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月17日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 2月17日現在

期首

2021年 2月18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

245,346,396,148円

同期中における追加設定元本額	54,312,041,658円
同期中における一部解約元本額	27,497,521,281円
期末元本額	272,160,916,525円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	31,918,892円
バランスセレクト50	96,338,818円
バランスセレクト70	116,091,537円
野村外国株式インデックスファンド	490,500,544円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,183,722,866円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	4,099,446,595円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	3,742,614,506円
野村資産設計ファンド2015	10,003,976円
野村資産設計ファンド2020	10,023,288円
野村資産設計ファンド2025	18,122,169円
野村資産設計ファンド2030	26,721,644円
野村資産設計ファンド2035	22,670,011円
野村資産設計ファンド2040	43,095,942円
野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	45,961,944,944円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	780,909,569円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	9,152,603,263円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	8,634,375,295円
野村資産設計ファンド2045	8,125,109円
野村インデックスファンド・外国株式	7,003,698,060円
マイ・ロード	938,034,417円
ネクストコア	4,177,087円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	142,304,701円
野村外国株インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	2,221,944,675円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	490,535,511円
野村資産設計ファンド2050	10,621,757円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	3,330,366円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	1,810,731円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,416,925円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,194,281円
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）	209,338,054円
のむらっぴ・ファンド（やや積極型）	727,796,992円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,177,472円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,856,697円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	32,005,927円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	8,772,623円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	39,140,891円
野村6資産均等バランス	1,245,418,685円
野村つみたて外国株投信	10,039,079,236円
野村外国株（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	4,743,793,604円
世界6資産分散ファンド	37,843,776円
野村資産設計ファンド2060	7,450,313円
野村スリーゼロ先進国株式投信	599,828,034円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI - KOKUSAI指数（為替ヘッジなし）連動型上場投信	6,018,692,558円

ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	4,758,762,786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)	135,601,525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)	66,081,318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)	618,695,397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)	805,550,260円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	1,558,619円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	4,289,549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)	1,061,427円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	1,083,982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)	17,239,129円
野村外国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	391,942,506円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	4,676,971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)	28,495,061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)	88,217,264円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	2,252,847,241円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	21,833,773円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用)	196,294,119円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAインデックスファンド(適格機関投資家専用)	11,691,012,305円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	1,228,552円
先進8カ国国債入替型プラス外国株式戦略20オープン(部分為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	9,280,913円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	1,365,300円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	8,782,653円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	8,682,592円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA(確定拠出年金向け)	84,422,382,062円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,062,289,129円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	7,695,485,744円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	7,411,024,847円
マイバランスDC30	768,297,596円
マイバランスDC50	1,750,775,436円
マイバランスDC70	1,553,860,249円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA	32,573,100,746円
野村DC運用戦略ファンド	112,552,417円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	8,579,851円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	383,032,543円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	325,566,470円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	315,282,557円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	16,847,728円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	7,662,511円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	41,532,707円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	7,333,390円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	6,497,486円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	5,208,417円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	171,054,772円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	132,747,457円

マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	75,932,550円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	105,079,248円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	3,625,855円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	24,556,151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)	101,197,326円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	1,335,697円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年2月17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	151,000	29.71	4,486,210.00	
		HALLIBURTON CO	167,000	33.57	5,606,190.00	
		SCHLUMBERGER LTD	258,000	41.69	10,756,020.00	
		CHENIERE ENERGY INC	44,200	114.89	5,078,138.00	
		CHEVRON CORP	357,400	134.30	47,998,820.00	
		CONOCOPHILLIPS	247,500	90.21	22,326,975.00	
		COTERRA ENERGY INC	145,000	22.87	3,316,150.00	
		DEVON ENERGY CORP	120,400	53.85	6,483,540.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	32,100	129.82	4,167,222.00	
		EOG RESOURCES INC	107,700	111.77	12,037,629.00	
		EXXON MOBIL CORP	782,500	78.35	61,308,875.00	
		HESS CORP	52,400	94.26	4,939,224.00	
		KINDER MORGAN INC	372,000	17.13	6,372,360.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	117,000	78.06	9,133,020.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	172,000	39.65	6,819,800.00	
		ONEOK INC	82,200	62.65	5,149,830.00	
		PHILLIPS 66	80,000	88.30	7,064,000.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	42,400	222.48	9,433,152.00	
		VALERO ENERGY CORP	75,900	88.04	6,682,236.00	
		WILLIAMS COS	225,000	30.01	6,752,250.00	
AIR PRODUCTS	40,900	245.34	10,034,406.00			
ALBEMARLE CORP	21,800	246.00	5,362,800.00			

CELANESE CORP-SERIES A	20,900	156.09	3,262,281.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	39,300	74.42	2,924,706.00
CORTEVA INC	134,000	51.46	6,895,640.00
DOW INC	136,700	62.08	8,486,336.00
DUPONT DE NEMOURS INC	96,900	82.12	7,957,428.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	25,000	124.27	3,106,750.00
ECOLAB INC	47,100	182.81	8,610,351.00
FMC CORP	23,200	119.59	2,774,488.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	45,400	137.48	6,241,592.00
LINDE PLC	95,400	303.83	28,985,382.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	49,400	103.15	5,095,610.00
MOSAIC CO/THE	69,000	46.29	3,194,010.00
PPG INDUSTRIES	44,000	151.87	6,682,280.00
RPM INTERNATIONAL INC	23,500	86.69	2,037,215.00
SHERWIN-WILLIAMS	46,500	272.63	12,677,295.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	11,600	391.06	4,536,296.00
VULCAN MATERIALS CO	24,700	191.72	4,735,484.00
AMCOR PLC	286,000	11.77	3,366,220.00
AVERY DENNISON CORP	15,600	184.67	2,880,852.00
BALL CORP	59,700	92.04	5,494,788.00
CROWN HOLDINGS INC	24,700	124.04	3,063,788.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	67,500	46.57	3,143,475.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	17,700	148.49	2,628,273.00
SEALED AIR CORP	26,500	64.14	1,699,710.00
WESTROCK CO	47,300	47.16	2,230,668.00
FREEMONT-MCMORAN INC	271,000	44.25	11,991,750.00
NEWMONT CORP	147,700	64.28	9,494,156.00
NUCOR CORP	55,000	122.66	6,746,300.00
STEEL DYNAMICS	37,100	64.29	2,385,159.00
BOEING CO	102,900	218.93	22,527,897.00
GENERAL DYNAMICS	43,500	214.41	9,326,835.00
HEICO CORP	7,900	143.97	1,137,363.00
HEICO CORP-CLASS A	13,900	118.60	1,648,540.00
HOWMET AEROSPACE INC	72,000	35.73	2,572,560.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	7,500	182.58	1,369,350.00

L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	37,500	221.62	8,310,750.00
LOCKHEED MARTIN	45,900	386.90	17,758,710.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	28,300	393.66	11,140,578.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	278,700	94.75	26,406,825.00
TEXTRON INC	40,700	72.20	2,938,540.00
TRANSDIGM GROUP INC	9,720	667.97	6,492,668.40
ALLEGION PLC	16,300	115.24	1,878,412.00
CARRIER GLOBAL CORP	153,000	45.65	6,984,450.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	25,600	91.11	2,332,416.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	131,600	67.49	8,881,684.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	6,400	261.93	1,676,352.00
MASCO CORP	45,800	58.68	2,687,544.00
OWENS CORNING INC	18,900	100.80	1,905,120.00
SMITH (A.O.) CORP	24,700	72.32	1,786,304.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	44,000	152.63	6,715,720.00
AMETEK INC	42,200	131.80	5,561,960.00
EATON CORP PLC	73,500	157.03	11,541,705.00
EMERSON ELEC	111,300	95.87	10,670,331.00
GENERAC HOLDINGS INC	11,600	316.44	3,670,704.00
PLUG POWER INC	94,000	23.90	2,246,600.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	21,100	273.01	5,760,511.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	28,300	59.18	1,674,794.00
SUNRUN INC	29,200	24.62	718,904.00
3M CORP	106,500	155.63	16,574,595.00
GENERAL ELECTRIC CO	202,000	101.41	20,484,820.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	127,600	189.06	24,124,056.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	41,400	60.28	2,495,592.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	19,500	445.00	8,677,500.00
CATERPILLAR INC DEL	101,600	203.64	20,689,824.00
CUMMINS INC	26,700	223.31	5,962,377.00
DEERE & COMPANY	54,200	390.56	21,168,352.00
DOVER CORP	26,800	162.95	4,367,060.00
FORTIVE CORP	61,700	65.36	4,032,712.00
IDEX CORP	14,200	189.98	2,697,716.00

ILLINOIS TOOL WORKS INC	58,600	220.08	12,896,688.00
INGERSOLL-RAND INC	76,400	54.92	4,195,888.00
KORNIT DIGITAL LTD	8,200	95.92	786,544.00
NORDSON CORP	9,600	235.14	2,257,344.00
OTIS WORLDWIDE CORP	75,300	78.87	5,938,911.00
PACCAR	63,400	94.98	6,021,732.00
PARKER HANNIFIN CORP	23,900	310.23	7,414,497.00
PENTAIR PLC	30,000	59.27	1,778,100.00
SNAP-ON INC	9,700	218.36	2,118,092.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	29,500	167.17	4,931,515.00
WABTEC CORP	34,100	95.51	3,256,891.00
XYLEM INC	33,800	90.67	3,064,646.00
FASTENAL CO	104,700	52.34	5,479,998.00
GRAINGER(W.W.) INC	8,300	474.80	3,940,840.00
UNITED RENTALS INC	13,500	325.12	4,389,120.00
CINTAS CORP	17,200	378.57	6,511,404.00
COPART INC	38,900	126.87	4,935,243.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	41,800	117.55	4,913,590.00
ROLLINS INC	41,000	31.37	1,286,170.00
WASTE CONNECTIONS INC	47,900	119.52	5,725,008.00
WASTE MANAGEMENT INC	77,700	142.57	11,077,689.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	24,300	90.41	2,196,963.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	30,600	107.38	3,285,828.00
FEDEX CORPORATION	46,700	229.01	10,694,767.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	134,600	215.31	28,980,726.00
DELTA AIR LINES INC	30,000	44.41	1,332,300.00
SOUTHWEST AIRLINES	29,000	47.42	1,375,180.00
AMERCO	1,720	599.54	1,031,208.80
CSX CORP	419,000	35.17	14,736,230.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	15,700	191.00	2,998,700.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	30,100	54.07	1,627,507.00
LYFT INC-A	46,900	43.82	2,055,158.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	45,900	276.76	12,703,284.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	18,100	297.27	5,380,587.00

UBER TECHNOLOGIES INC	229,000	36.58	8,376,820.00
UNION PAC CORP	120,500	253.81	30,584,105.00
APTIV PLC	50,200	146.26	7,342,252.00
BORGWARNER INC	45,000	45.22	2,034,900.00
LEAR CORP	10,900	175.56	1,913,604.00
FORD MOTOR COMPANY	730,000	18.01	13,147,300.00
GENERAL MOTORS CO	240,900	50.43	12,148,587.00
LUCID GROUP INC	72,100	29.00	2,090,900.00
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	30,800	66.25	2,040,500.00
TESLA INC	155,530	923.39	143,614,846.70
DR HORTON INC	63,300	85.30	5,399,490.00
GARMIN LTD	28,800	119.59	3,444,192.00
LENNAR CORP-A	50,600	92.02	4,656,212.00
MOHAWK INDUSTRIES	10,200	150.17	1,531,734.00
NEWELL BRANDS INC	66,000	26.01	1,716,660.00
NVR INC	607	5,113.01	3,103,597.07
PULTEGROUP INC	47,000	49.28	2,316,160.00
WHIRLPOOL CORP	11,300	206.37	2,331,981.00
HASBRO INC	23,400	97.04	2,270,736.00
PELOTON INTERACTIVE INC-A	52,000	32.05	1,666,600.00
LULULEMON ATHLETICA INC	22,000	320.04	7,040,880.00
NIKE INC-B	236,200	146.49	34,600,938.00
V F CORP	61,700	60.95	3,760,615.00
AIRBNB INC-CLASS A	43,700	186.64	8,156,168.00
ARAMARK	44,000	38.27	1,683,880.00
BOOKING HOLDINGS INC	7,560	2,703.26	20,436,645.60
CAESARS ENTERTAINMENT INC	39,700	85.42	3,391,174.00
CARNIVAL CORP	149,000	23.31	3,473,190.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	5,210	1,575.43	8,207,990.30
DARDEN RESTAURANTS INC	23,400	148.86	3,483,324.00
DOMINOS PIZZA INC	6,900	433.34	2,990,046.00
DRAFTKINGS INC - CL A	58,400	22.99	1,342,616.00
EXPEDIA GROUP INC	26,700	213.80	5,708,460.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	51,600	156.34	8,067,144.00
LAS VEGAS SANDS CORP	64,000	47.61	3,047,040.00

MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	51,200	183.26	9,382,912.00
MCDONALD'S CORP	138,000	253.09	34,926,420.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	11.50	391,000.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	71,000	45.17	3,207,070.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	41,100	87.06	3,578,166.00
STARBUCKS CORP	217,900	95.18	20,739,722.00
VAIL RESORTS INC	7,400	275.46	2,038,404.00
WYNN RESORTS LTD	19,300	94.23	1,818,639.00
YUM BRANDS INC	54,300	123.35	6,697,905.00
GENUINE PARTS CO	26,600	129.96	3,456,936.00
LKQ CORP	52,600	55.60	2,924,560.00
POOL CORP	7,360	460.18	3,386,924.80
AMAZON.COM INC	84,240	3,162.01	266,367,722.40
CHEWY INC - CLASS A	15,100	49.56	748,356.00
DOORDASH INC-A	19,600	94.89	1,859,844.00
EBAY INC	120,500	57.65	6,946,825.00
ETSY INC	23,200	140.41	3,257,512.00
FIVERR INTERNATIONAL LTD	5,200	75.84	394,368.00
MERCADOLIBRE INC	8,190	1,133.84	9,286,149.60
WAYFAIR INC - CLASS A	13,100	136.54	1,788,674.00
DOLLAR GENERAL CORP	43,100	197.35	8,505,785.00
DOLLAR TREE INC	42,200	136.76	5,771,272.00
TARGET CORP	89,800	207.81	18,661,338.00
ADVANCE AUTO PARTS	12,000	222.39	2,668,680.00
AUTOZONE	3,950	1,927.47	7,613,506.50
BATH & BODY WORKS INC	50,400	55.45	2,794,680.00
BEST BUY COMPANY INC	40,700	99.63	4,054,941.00
BURLINGTON STORES INC	12,100	229.15	2,772,715.00
CARMAX INC	29,500	109.58	3,232,610.00
CARVANA CO	13,800	138.62	1,912,956.00
HOME DEPOT	195,100	350.09	68,302,559.00
LOWES COS INC	128,000	227.01	29,057,280.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	12,760	678.44	8,656,894.40
ROSS STORES INC	66,300	95.70	6,344,910.00
TJX COS INC	223,400	67.10	14,990,140.00

TRACTOR SUPPLY COMPANY	21,500	215.05	4,623,575.00	
ULTA BEAUTY INC	9,400	381.60	3,587,040.00	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	81,710	512.40	41,868,204.00	
KROGER CO	133,000	44.57	5,927,810.00	
SYSCO CORP	95,600	85.57	8,180,492.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	134,000	47.88	6,415,920.00	
WALMART INC	284,900	133.53	38,042,697.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	58,500	66.60	3,896,100.00	
COCA COLA CO	758,500	60.90	46,192,650.00	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	39,300	56.44	2,218,092.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	31,200	220.91	6,892,392.00	
KEURIG DR PEPPER INC	131,000	37.92	4,967,520.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	35,000	49.44	1,730,400.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	72,300	83.22	6,016,806.00	
PEPSICO INC	255,500	166.30	42,489,650.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	104,500	76.90	8,036,050.00	
BUNGE LIMITED	26,800	102.76	2,753,968.00	
CAMPBELL SOUP CO	36,000	43.67	1,572,120.00	
CONAGRA BRANDS INC	87,000	35.43	3,082,410.00	
GENERAL MILLS	113,300	66.76	7,563,908.00	
HERSHEY CO/THE	26,400	202.65	5,349,960.00	
HORMEL FOODS CORP	55,000	47.11	2,591,050.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	20,100	135.72	2,727,972.00	
KELLOGG CO	46,300	64.32	2,978,016.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	125,000	36.62	4,577,500.00	
MCCORMICK & CO INC.	45,700	98.39	4,496,423.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	259,600	65.71	17,058,316.00	
TYSON FOODS INC-CL A	54,900	94.45	5,185,305.00	
ALTRIA GROUP INC	339,500	50.61	17,182,095.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	288,100	111.57	32,143,317.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	45,000	96.03	4,321,350.00	
CLOROX CO	22,500	141.28	3,178,800.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	147,800	78.34	11,578,652.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	62,300	131.02	8,162,546.00	
PROCTER & GAMBLE CO	448,800	158.01	70,914,888.00	

ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	43,300	308.65	13,364,545.00
ABBOTT LABORATORIES	327,700	123.68	40,529,936.00
ABIOMED INC	8,700	325.42	2,831,154.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	13,780	526.38	7,253,516.40
BAXTER INTERNATIONAL INC.	93,300	85.13	7,942,629.00
BECTON,DICKINSON	53,400	271.13	14,478,342.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	263,000	44.19	11,621,970.00
DENTSPLY SIRONA INC	38,400	56.63	2,174,592.00
DEXCOM INC	18,100	413.63	7,486,703.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	115,000	110.66	12,725,900.00
HOLOGIC INC	46,100	71.04	3,274,944.00
IDEXX LABORATORIES INC	15,880	508.01	8,067,198.80
INMODE LTD	8,800	46.47	408,936.00
INSULET CORP	12,500	252.33	3,154,125.00
INTUITIVE SURGICAL INC	66,300	291.14	19,302,582.00
MASIMO CORP	9,300	144.20	1,341,060.00
MEDTRONIC PLC	248,700	103.15	25,653,405.00
NOVOCURE LTD	16,400	82.91	1,359,724.00
RESMED INC	26,500	237.57	6,295,605.00
STERIS PLC	18,300	232.99	4,263,717.00
STRYKER CORP	62,500	259.59	16,224,375.00
TELEFLEX INC	8,700	327.00	2,844,900.00
THE COOPER COMPANIES, INC.	9,300	401.29	3,731,997.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	38,200	122.50	4,679,500.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	28,900	142.73	4,124,897.00
ANTHEM INC	44,900	458.58	20,590,242.00
CARDINAL HEALTH INC	55,300	54.54	3,016,062.00
CENTENE CORP	107,900	84.22	9,087,338.00
CIGNA CORP	63,200	229.00	14,472,800.00
CVS HEALTH CORP	243,900	103.94	25,350,966.00
DAVITA INC	12,500	120.00	1,500,000.00
HCA HEALTHCARE INC	47,700	251.99	12,019,923.00
HENRY SCHEIN INC	25,700	84.23	2,164,711.00
HUMANA INC	23,900	428.77	10,247,603.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	17,600	269.62	4,745,312.00

MCKESSON CORP	28,700	275.82	7,916,034.00
MOLINA HEALTHCARE INC	11,100	322.43	3,578,973.00
OAK STREET HEALTH INC	16,300	17.44	284,272.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	22,300	131.72	2,937,356.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	174,300	480.05	83,672,715.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	14,400	137.81	1,984,464.00
ABBVIE INC	326,600	145.87	47,641,142.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	21,600	153.28	3,310,848.00
AMGEN INC	105,000	222.66	23,379,300.00
BIOGEN INC	27,700	214.55	5,943,035.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	33,400	92.69	3,095,846.00
EXACT SCIENCES CORP	32,300	78.38	2,531,674.00
GILEAD SCIENCES INC	230,900	61.90	14,292,710.00
HORIZON THERAPEUTICS PLC	38,600	97.70	3,771,220.00
INCYTE CORP	33,700	67.83	2,285,871.00
MODERNA INC	63,400	151.81	9,624,754.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	17,000	85.87	1,459,790.00
NOVAVAX INC	13,000	86.55	1,125,150.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	19,560	630.90	12,340,404.00
SEAGEN INC	25,800	128.67	3,319,686.00
VERTEX PHARMACEUTICALS	48,300	235.77	11,387,691.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	410,700	67.60	27,763,320.00
CATALENT INC	32,300	99.93	3,227,739.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	81,000	25.89	2,097,090.00
ELI LILLY & CO.	150,300	245.58	36,910,674.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,600	144.59	1,532,654.00
JOHNSON & JOHNSON	486,600	167.21	81,364,386.00
MERCK & CO INC	467,900	77.22	36,131,238.00
PFIZER INC	1,036,300	49.68	51,483,384.00
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	63,000	40.50	2,551,500.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	195,000	8.49	1,655,550.00
VIATRIS INC	229,000	15.25	3,492,250.00
ZOETIS INC	88,000	195.09	17,167,920.00
BANK OF AMERICA CORP	1,400,000	47.68	66,752,000.00
CITIGROUP	374,600	66.95	25,079,470.00

CITIZENS FINANCIAL GROUP	78,800	55.23	4,352,124.00	
FIFTH THIRD BANCORP	127,000	49.51	6,287,770.00	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	2,250	788.03	1,773,067.50	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	32,500	175.13	5,691,725.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	271,000	16.19	4,387,490.00	
JPMORGAN CHASE & CO	552,300	155.00	85,606,500.00	
KEYCORP	178,000	26.61	4,736,580.00	
M & T BANK CORP	23,200	186.10	4,317,520.00	
PNC FINANCIAL	78,300	208.59	16,332,597.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	180,000	25.24	4,543,200.00	
SIGNATURE BANK	11,500	349.86	4,023,390.00	
SVB FINANCIAL GROUP	10,890	654.14	7,123,584.60	
TRUIST FINANCIAL CORP	245,900	64.71	15,912,189.00	
US BANCORP	259,500	58.60	15,206,700.00	
WEBSTER FINANCIAL CORP	33,000	61.98	2,045,340.00	
WELLS FARGO CO	759,000	58.14	44,128,260.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	66,500	67.96	4,519,340.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	245,000	315.65	77,334,250.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	69,000	34.59	2,386,710.00	
AFLAC INC	116,900	64.52	7,542,388.00	
ALLEGHANY CORP	2,590	693.45	1,796,035.50	
ALLSTATE CORP	54,800	123.48	6,766,704.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	13,900	140.99	1,959,761.00	
AMERICAN INTL GROUP	158,100	60.34	9,539,754.00	
AON PLC	42,000	285.05	11,972,100.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	75,000	47.65	3,573,750.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	38,000	156.21	5,935,980.00	
ASSURANT INC	10,200	167.20	1,705,440.00	
BROWN & BROWN INC	42,700	66.61	2,844,247.00	
CHUBB LTD	81,500	204.91	16,700,165.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	28,500	128.14	3,651,990.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	4,400	184.46	811,624.00	
EVEREST RE GROUP LTD	7,100	303.08	2,151,868.00	
FNF GROUP	50,000	48.69	2,434,500.00	
GLOBE LIFE INC	17,700	105.89	1,874,253.00	

HARTFORD FINANCIAL SERVICES	65,300	71.22	4,650,666.00
LINCOLN NATIONAL CORP	33,200	73.51	2,440,532.00
LOEWS CORP	41,800	62.06	2,594,108.00
MARKEL CORP	2,500	1,275.06	3,187,650.00
MARSH & MCLENNAN COS	93,400	153.94	14,377,996.00
METLIFE INC	135,800	71.53	9,713,774.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	50,700	75.65	3,835,455.00
PROGRESSIVE CO	108,000	106.08	11,456,640.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	70,600	118.16	8,342,096.00
TRAVELERS COS INC/THE	46,600	172.27	8,027,782.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	23,800	225.79	5,373,802.00
WR BERKLEY CORP	26,600	90.95	2,419,270.00
ACCENTURE PLC-CL A	117,200	333.72	39,111,984.00
AFFIRM HOLDINGS INC	15,600	42.92	669,552.00
AKAMA I TECHNOLOGIES	29,200	104.86	3,061,912.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	77,900	204.24	15,910,296.00
BLOCK INC	78,725	109.00	8,581,025.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	21,800	145.97	3,182,146.00
CLOUDFLARE INC - CLASS A	44,600	111.99	4,994,754.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	97,300	89.42	8,700,566.00
EPAM SYSTEMS INC	10,310	450.39	4,643,520.90
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	113,900	100.43	11,438,977.00
FISERV INC	110,000	96.81	10,649,100.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	14,200	244.29	3,468,918.00
GARTNER INC	15,300	298.23	4,562,919.00
GLOBAL PAYMENTS INC	54,900	144.29	7,921,521.00
GODADDY INC - CLASS A	32,300	84.26	2,721,598.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	165,700	129.18	21,405,126.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	13,900	169.54	2,356,606.00
MASTERCARD INC	162,800	382.93	62,341,004.00
MONGODB INC	10,510	436.13	4,583,726.30
OKTA INC	23,400	188.55	4,412,070.00
PAYCHEX INC	60,500	120.02	7,261,210.00
PAYPAL HOLDINGS INC	206,300	110.54	22,804,402.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	39,200	304.70	11,944,240.00

TWILIO INC - A	31,000	186.99	5,796,690.00
VERISIGN INC	18,500	212.25	3,926,625.00
VISA INC-CLASS A SHARES	311,900	228.82	71,368,958.00
WESTERN UNION CO	75,000	19.83	1,487,250.00
WIX.COM LTD	10,200	89.06	908,412.00
ADOBE INC	88,050	477.70	42,061,485.00
ANSYS INC	16,400	323.60	5,307,040.00
ASANA INC - CL A	11,900	74.13	882,147.00
AUTODESK INC.	41,000	233.74	9,583,340.00
AVALARA INC	15,300	101.76	1,556,928.00
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	33,000	40.12	1,323,960.00
BILL.COM HOLDINGS INC	14,200	256.90	3,647,980.00
BLACK KNIGHT INC	29,800	60.44	1,801,112.00
CADENCE DESIGN SYS INC	51,700	145.85	7,540,445.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	24,000	71.06	1,705,440.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	20,100	132.55	2,664,255.00
CITRIX SYSTEMS INC	23,800	101.95	2,426,410.00
COUPA SOFTWARE INC	14,200	128.79	1,828,818.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	34,800	183.28	6,378,144.00
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	7,100	155.16	1,101,636.00
DATADOG INC - CLASS A	35,000	173.92	6,087,200.00
DOCUSIGN INC	36,400	120.14	4,373,096.00
DROPBOX INC-CLASS A	57,000	24.90	1,419,300.00
DYNATRACE INC	33,000	43.73	1,443,090.00
FAIR ISAAC CORP	5,120	511.56	2,619,187.20
FORTINET INC	25,900	320.36	8,297,324.00
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	13,600	95.45	1,298,120.00
HUBSPOT INC	8,400	542.80	4,559,520.00
INTUIT INC	50,510	528.15	26,676,856.50
MICROSOFT CORP	1,319,500	299.50	395,190,250.00
NORTONLIFELOCK INC	110,000	28.84	3,172,400.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	56,700	55.28	3,134,376.00
ORACLE CORPORATION	309,600	79.19	24,517,224.00
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	286,000	13.97	3,995,420.00

PALO ALTO NETWORKS INC	17,800	526.41	9,370,098.00
PAYCOM SOFTWARE INC	9,600	344.48	3,307,008.00
PTC INC	20,300	114.65	2,327,395.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	14,500	164.94	2,391,630.00
SALESFORCE.COM INC	180,940	211.74	38,312,235.60
SERVICENOW INC	36,610	590.89	21,632,482.90
SPLUNK INC	30,400	123.55	3,755,920.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	42,700	76.27	3,256,729.00
SYNOPSYS INC	28,500	306.79	8,743,515.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	79,900	80.91	6,464,709.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	7,510	469.74	3,527,747.40
UNITY SOFTWARE INC	11,200	110.28	1,235,136.00
VMWARE INC - CLASS A	38,000	125.90	4,784,200.00
WORKDAY INC-CLASS A	35,400	228.31	8,082,174.00
ZENDESK INC	22,600	118.00	2,666,800.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	40,600	138.51	5,623,506.00
ZSCALER INC	15,400	280.87	4,325,398.00
ARISTA NETWORKS INC	42,000	132.44	5,562,480.00
CISCO SYSTEMS	778,900	54.25	42,255,325.00
F5 INC	11,300	204.07	2,305,991.00
JUNIPER NETWORKS INC	60,000	34.75	2,085,000.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	31,600	221.00	6,983,600.00
APPLE INC	3,055,200	172.55	527,174,760.00
DELL TECHNOLOGIES-C	49,600	60.29	2,990,384.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	246,000	17.64	4,339,440.00
HP INC	224,000	37.89	8,487,360.00
NETAPP INC	40,300	91.55	3,689,465.00
SEAGATE TECHNOLOGY	38,400	111.85	4,295,040.00
WESTERN DIGITAL CORP	58,600	56.39	3,304,454.00
AMPHENOL CORP-CL A	109,600	76.95	8,433,720.00
ARROW ELECTRS INC	13,700	127.70	1,749,490.00
CDW CORPORATION	25,000	185.48	4,637,000.00
COGNEX CORP	33,600	64.12	2,154,432.00
CORNING INC	149,000	42.39	6,316,110.00
IPG PHOTONICS CORP	6,900	140.65	970,485.00

KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	33,500	170.13	5,699,355.00
TE CONNECTIVITY LTD	60,000	149.74	8,984,400.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	8,600	426.47	3,667,642.00
TRIMBLE INC	47,300	68.59	3,244,307.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	9,750	430.97	4,201,957.50
ADVANCED MICRO DEVICES	303,648	117.69	35,736,333.12
ANALOG DEVICES INC	99,800	168.34	16,800,332.00
APPLIED MATERIALS	166,900	140.96	23,526,224.00
BROADCOM INC	75,830	597.21	45,286,434.30
ENPHASE ENERGY INC	23,200	154.03	3,573,496.00
ENTEGRIS INC	25,700	135.39	3,479,523.00
INTEL CORP	749,500	48.23	36,148,385.00
KLA CORP	28,400	385.65	10,952,460.00
LAM RESEARCH	26,380	591.47	15,602,978.60
MARVELL TECHNOLOGY INC	152,100	72.10	10,966,410.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	102,400	75.50	7,731,200.00
MICRON TECHNOLOGY	209,100	96.06	20,086,146.00
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	8,000	487.57	3,900,560.00
NVIDIA CORP	462,040	265.11	122,491,424.40
NXP SEMICONDUCTORS NV	48,500	199.66	9,683,510.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	78,000	63.11	4,922,580.00
QORVO INC	20,700	136.80	2,831,760.00
QUALCOMM INC	208,500	172.60	35,987,100.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	30,200	140.20	4,234,040.00
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	10,000	266.72	2,667,200.00
TERADYNE INC	30,200	119.11	3,597,122.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	170,600	168.24	28,701,744.00
AT & T INC	1,320,000	23.94	31,600,800.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	31,000	28.99	898,690.00
LIBERTY GLOBAL PLC-C	64,000	28.94	1,852,160.00
LUMEN TECHNOLOGIES INC	180,000	9.86	1,774,800.00
VERIZON COMMUNICATIONS	765,200	53.40	40,861,680.00
T-MOBILE US INC	115,100	127.46	14,670,646.00
ALLIANT ENERGY CORP	44,700	56.33	2,517,951.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	91,700	85.41	7,832,097.00

CONSTELLATION ENERGY	59,166	47.20	2,792,635.20
DUKE ENERGY CORP	141,800	99.51	14,110,518.00
EDISON INTERNATIONAL	69,600	59.92	4,170,432.00
ENTERGY CORP	37,600	103.96	3,908,896.00
EVERGY INC	42,900	61.21	2,625,909.00
EVERSOURCE ENERGY	64,400	81.65	5,258,260.00
EXELON CORPORATION	183,000	42.00	7,686,000.00
FIRSTENERGY CORP	99,000	41.08	4,066,920.00
NEXTERA ENERGY INC	362,600	75.23	27,278,398.00
NRG ENERGY INC	45,000	39.09	1,759,050.00
PG&E CORP	277,000	11.74	3,251,980.00
PPL CORPORATION	142,000	28.23	4,008,660.00
SOUTHERN CO.	196,900	64.87	12,772,903.00
XCEL ENERGY INC	99,800	65.94	6,580,812.00
ATMOS ENERGY CORP	24,400	106.09	2,588,596.00
UGI CORP	40,000	37.98	1,519,200.00
AMEREN CORPORATION	47,200	84.47	3,986,984.00
CENTERPOINT ENERGY INC	113,000	26.88	3,037,440.00
CMS ENERGY CORP	54,300	61.92	3,362,256.00
CONSOLIDATED EDISON INC	66,300	81.08	5,375,604.00
DOMINION ENERGY INC	150,500	78.67	11,839,835.00
DTE ENERGY COMPANY	36,200	116.49	4,216,938.00
NISOURCE INC	73,000	28.40	2,073,200.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	92,200	64.79	5,973,638.00
SEMPRA ENERGY	59,100	135.23	7,992,093.00
WEC ENERGY GROUP INC	58,100	89.12	5,177,872.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	33,100	146.29	4,842,199.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	44,000	45.19	1,988,360.00
ALLY FINANCIAL INC	67,000	50.44	3,379,480.00
AMERICAN EXPRESS CO	124,800	198.38	24,757,824.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	83,000	158.86	13,185,380.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	55,600	126.82	7,051,192.00
SOFI TECHNOLOGIES INC	92,000	13.08	1,203,360.00
SYNCHRONY FINANCIAL	103,800	44.85	4,655,430.00
UPSTART HOLDINGS INC	3,500	148.01	518,035.00

AMERIPRISE FINANCIAL INC	20,700	312.11	6,460,677.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	150,100	62.50	9,381,250.00
BLACKROCK INC	28,130	783.42	22,037,604.60
BLACKSTONE INC	127,400	126.78	16,151,772.00
CARLYLE GROUP INC/THE	29,000	47.89	1,388,810.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	19,500	121.22	2,363,790.00
CME GROUP INC	66,200	238.92	15,816,504.00
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	6,700	207.96	1,393,332.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,900	412.32	2,845,008.00
FRANKLIN RESOURCES INC	57,000	31.38	1,788,660.00
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	8,200	45.64	374,248.00
GOLDMAN SACHS GROUP	62,800	360.05	22,611,140.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	104,700	125.72	13,162,884.00
INVESCO LTD	65,000	23.58	1,532,700.00
KKR & CO INC-A	97,400	62.20	6,058,280.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	7,200	374.78	2,698,416.00
MOODYS CORP	31,000	330.62	10,249,220.00
MORGAN STANLEY	252,900	101.15	25,580,835.00
MSCI INC	15,390	543.60	8,366,004.00
NASDAQ INC	21,200	174.66	3,702,792.00
NORTHERN TRUST CORP	36,300	126.28	4,583,964.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	34,200	112.79	3,857,418.00
ROBINHOOD MARKETS INC -A	32,000	13.51	432,320.00
S&P GLOBAL INC	44,400	386.55	17,162,820.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	267,400	89.33	23,886,842.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	22,500	60.55	1,362,375.00
STATE STREET CORP	67,200	100.28	6,738,816.00
T ROWE PRICE GROUP INC	42,100	146.15	6,152,915.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	18,700	83.94	1,569,678.00
AES CORP	127,000	21.89	2,780,030.00
VISTRA CORP	80,000	21.72	1,737,600.00
CERNER CORP	54,500	91.92	5,009,640.00
TELADOC HEALTH INC	27,600	73.77	2,036,052.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	25,400	229.36	5,825,744.00
10X GENOMICS INC-CLASS A	14,400	94.98	1,367,712.00
	56,600	135.15	7,649,490.00

AGILENT TECHNOLOGIES INC				
AVANTOR INC	97,000	35.48	3,441,560.00	
BIO TECHNE CORP	6,990	412.03	2,880,089.70	
BIO-RAD LABORATORIES-A	3,980	612.69	2,438,506.20	
CHARLES RIVER LABORATORIES	9,600	305.28	2,930,688.00	
DANAHER CORP	118,800	267.69	31,801,572.00	
ILLUMINA INC	27,300	333.86	9,114,378.00	
IQVIA HOLDINGS INC	35,700	232.18	8,288,826.00	
METTLER-TOLEDO INTL	4,250	1,462.20	6,214,350.00	
PERKINELMER INC	21,200	181.92	3,856,704.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	72,710	550.35	40,015,948.50	
WATERS CORP	11,200	319.56	3,579,072.00	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	13,500	379.32	5,120,820.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	24,800	73.97	1,834,456.00	
CLARIVATE PLC	65,000	16.67	1,083,550.00	
COSTAR GROUP INC	72,100	67.29	4,851,609.00	
EQUIFAX INC	22,400	221.73	4,966,752.00	
IHS MARKIT LTD	69,400	109.35	7,588,890.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	24,500	121.66	2,980,670.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	23,800	88.72	2,111,536.00	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	20,300	124.49	2,527,147.00	
TRUNSONIC	35,200	101.84	3,584,768.00	
VERISK ANALYTICS INC	28,500	194.07	5,530,995.00	
CBRE GROUP INC	62,300	101.65	6,332,795.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	220,000	5.70	1,254,000.00	
ZILLOW GROUP INC - A	9,800	63.31	620,438.00	
ZILLOW GROUP INC - C	29,600	64.02	1,894,992.00	
CABLE ONE INC	980	1,506.61	1,476,477.80	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	23,920	609.46	14,578,283.20	
COMCAST CORP-CL A	846,100	48.09	40,688,949.00	
DISCOVERY INC - A	31,000	29.38	910,780.00	
DISCOVERY INC - C	58,000	29.28	1,698,240.00	
DISH NETWORK CORP-A	43,400	31.59	1,371,006.00	
FOX CORP-CLASS A	58,000	43.01	2,494,580.00	
FOX CORP-CLASS B	25,400	38.91	988,314.00	
	73,000	36.60	2,671,800.00	

	INTERPUBRIC GROUP				
	LIBERTY BROADBAND CORP-A	4,000	150.64	602,560.00	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C	26,400	153.40	4,049,760.00	
	LIBERTY SIRIUS GROUP-C	29,900	52.34	1,564,966.00	
	LIBERTY SIRIUSXM GROUP	17,000	52.46	891,820.00	
	NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	75,000	23.68	1,776,000.00	
	OMNICOM GROUP	40,000	86.34	3,453,600.00	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	175,000	6.17	1,079,750.00	
	VIACOMCBS INC-CLASS B	114,000	29.58	3,372,120.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	144,800	81.46	11,795,408.00	
	AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	91,000	19.67	1,789,970.00	
	DISNEY (WALT) CO	335,900	156.35	52,517,965.00	
	ELECTRONIC ARTS	53,200	133.29	7,091,028.00	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	37,100	63.33	2,349,543.00	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	30,900	120.25	3,715,725.00	
	NETFLIX INC	81,820	398.08	32,570,905.60	
	ROKU INC	22,000	161.45	3,551,900.00	
	SEA LTD-ADR	24,800	141.58	3,511,184.00	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	21,900	166.09	3,637,371.00	
	ALPHABET INC-CL A	55,650	2,754.76	153,302,394.00	
	ALPHABET INC-CL C	53,260	2,749.75	146,451,685.00	
	IAC/INTERACTIVECORP	15,000	120.88	1,813,200.00	
	MATCH GROUP INC	48,000	117.33	5,631,840.00	
	META PLATFORMS INC	440,600	216.54	95,407,524.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	103,000	25.73	2,650,190.00	
	SNAP INC-A	198,000	40.01	7,921,980.00	
	TWITTER INC	149,000	36.24	5,399,760.00	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	40,100	56.22	2,254,422.00	
小計	銘柄数：607			7,269,583,880.89	
				(839,491,546,565)	
	組入時価比率：70.0%			72.7%	
カナダドル	CAMECO CORP	72,000	27.34	1,968,480.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	220,500	68.43	15,088,815.00	
	CENOVUS ENERGY INC	240,000	19.73	4,735,200.00	
	ENBRIDGE INC	373,000	52.79	19,690,670.00	

IMPERIAL OIL	46,000	55.51	2,553,460.00
KEYERA CORP	41,000	30.39	1,245,990.00
PARKLAND CORP	28,000	34.55	967,400.00
PEMBINA PIPELINE CORP	102,000	42.64	4,349,280.00
SUNCOR ENERGY INC	272,000	37.57	10,219,040.00
TC ENERGY CORP	183,000	66.49	12,167,670.00
TOURMALINE OIL CORP	55,000	46.85	2,576,750.00
NUTRIEN LTD	105,700	95.28	10,071,096.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	28,200	64.25	1,811,850.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	82,688	66.31	5,483,041.28
BARRICK GOLD	325,000	28.21	9,168,250.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	111,000	34.76	3,858,360.00
FRANCO-NEVADA CORP	35,300	184.41	6,509,673.00
IVANHOE MINES LTD-CL A	103,000	11.49	1,183,470.00
KINROSS GOLD CORP	217,000	7.45	1,616,650.00
LUNDIN MINING CORP	118,000	12.05	1,421,900.00
PAN AMERICAN SILVER CORP	35,300	30.83	1,088,299.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	87,000	45.93	3,995,910.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	85,000	54.32	4,617,200.00
WEST FRASER TIMBER	17,800	125.01	2,225,178.00
CAE INC	60,000	33.49	2,009,400.00
WSP GLOBAL INC	21,400	159.23	3,407,522.00
BALLARD POWER SYSTEMS INC	37,000	13.26	490,620.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	15,000	112.56	1,688,400.00
GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	30,000	37.34	1,120,200.00
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	21,100	73.54	1,551,694.00
AIR CANADA	32,000	25.11	803,520.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	130,400	161.04	20,999,616.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	172,900	94.43	16,326,947.00
TFI INTERNATIONAL INC	14,900	133.46	1,988,554.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	52,800	101.19	5,342,832.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	37,000	50.52	1,869,240.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	52,400	74.32	3,894,368.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	10,200	184.53	1,882,206.00
DOLLARAMA INC	52,000	64.81	3,370,120.00

ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	152,000	51.50	7,828,000.00	
EMPIRE CO LTD A	32,000	39.39	1,260,480.00	
LOBLAW COMPANIES	31,400	99.09	3,111,426.00	
METRO INC	46,700	66.94	3,126,098.00	
WESTON(GEORGE)LTD	14,100	138.51	1,952,991.00	
SAPUTO INC	50,000	30.62	1,531,000.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	58,000	32.31	1,873,980.00	
CANOPY GROWTH CORP	35,000	11.08	387,800.00	
BANK OF MONTREAL	119,200	149.38	17,806,096.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	225,700	92.74	20,931,418.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	83,100	162.91	13,537,821.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	63,400	102.90	6,523,860.00	
ROYAL BANK OF CANADA	263,700	144.87	38,202,219.00	
TORONTO DOMINION BANK	337,400	107.75	36,354,850.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,640	654.99	3,039,153.60	
GREAT-WEST LIFECO INC	50,000	39.39	1,969,500.00	
IA FINANCIAL CORP INC	21,100	80.63	1,701,293.00	
INTACT FINANCIAL CORP	32,900	184.53	6,071,037.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	360,000	27.48	9,892,800.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	103,000	41.20	4,243,600.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	106,900	68.77	7,351,513.00	
CGI INC	39,800	107.92	4,295,216.00	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	10,700	79.42	849,794.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	20,840	938.91	19,566,884.40	
BLACKBERRY LTD	94,000	9.09	854,460.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,670	2,092.13	7,678,117.10	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	19,400	38.91	754,854.00	
OPEN TEXT CORP	51,000	56.03	2,857,530.00	
BCE INC	14,400	66.52	957,888.00	
TELUS CORP	78,600	31.80	2,499,480.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	67,000	67.04	4,491,680.00	
EMERA INC	47,000	58.26	2,738,220.00	
FORTIS INC	89,000	57.16	5,087,240.00	
HYDRO ONE LTD	63,000	31.43	1,980,090.00	
ALTAGAS LTD	52,000	27.69	1,439,880.00	

	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	126,000	17.74	2,235,240.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	27,000	34.78	939,060.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	262,300	71.50	18,754,450.00	
	IGM FINANCIAL INC	15,000	45.88	688,200.00	
	ONEX CORPORATION	13,200	90.74	1,197,768.00	
	TMX GROUP LTD	9,500	130.18	1,236,710.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	24,000	44.51	1,068,240.00	
	NORTHLAND POWER INC	40,000	36.55	1,462,000.00	
	THOMSON REUTERS CORP	32,600	130.06	4,239,956.00	
	FIRSTSERVICE CORP	7,200	189.26	1,362,672.00	
	QUEBECOR INC-CL B	34,000	30.72	1,044,480.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	84,000	37.48	3,148,320.00	
小計	銘柄数：86			477,484,236.38	
				(43,460,615,195)	
	組入時価比率：3.6%			3.8%	
ユ-口	TENARIS SA	88,000	11.85	1,043,240.00	
	ENI SPA	472,000	13.30	6,281,376.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	96,000	10.23	982,080.00	
	NESTE OYJ	78,000	38.43	2,997,540.00	
	OMV AG	28,100	57.46	1,614,626.00	
	REPSOL SA	274,000	11.93	3,269,916.00	
	TOTALENERGIES SE	464,400	51.42	23,879,448.00	
	AIR LIQUIDE SA	88,000	148.40	13,059,200.00	
	AKZO NOBEL	34,500	94.74	3,268,530.00	
	ARKEMA	11,600	128.75	1,493,500.00	
	BASF SE	169,400	68.52	11,607,288.00	
	COVESTRO AG	34,400	54.68	1,880,992.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	39,000	29.58	1,153,620.00	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	15,000	37.98	569,700.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	32,100	164.75	5,288,475.00	
	LANXESS	15,500	54.58	845,990.00	
	SOLVAY SA	14,200	110.90	1,574,780.00	
	SYMRISE AG	23,700	104.00	2,464,800.00	
	UMICORE	34,300	35.50	1,217,650.00	
	CRH PLC	146,000	44.17	6,448,820.00	

HEIDELBERGCEMENT AG	27,400	67.44	1,847,856.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	46,200	48.16	2,224,992.00
ARCELORMITTAL	127,000	27.77	3,527,425.00
VOESTALPINE AG	20,000	31.44	628,800.00
STORA ENSO OYJ-R	108,000	18.47	1,994,760.00
UPM-KYMMENE OYJ	97,000	33.84	3,282,480.00
AIRBUS SE	108,600	117.88	12,801,768.00
DASSAULT AVIATION SA	5,000	117.60	588,000.00
MTU AERO ENGINES AG	10,100	210.60	2,127,060.00
SAFRAN SA	62,700	116.00	7,273,200.00
THALES SA	20,600	84.56	1,741,936.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	93,900	62.19	5,839,641.00
KINGSPAN GROUP PLC	27,800	90.82	2,524,796.00
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	45,250	0.45	20,389.65
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	45,263	22.53	1,019,775.39
BOUYGUES	40,000	32.51	1,300,400.00
EIFFAGE SA	15,900	98.14	1,560,426.00
FERROVIAL SA	88,000	25.17	2,214,960.00
VINCI	99,300	102.56	10,184,208.00
LEGRAND SA	48,800	86.42	4,217,296.00
PRYSMIAN SPA	48,000	29.18	1,400,640.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	100,400	145.74	14,632,296.00
SIEMENS ENERGY AG	73,000	19.08	1,392,840.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	45,000	17.06	767,925.00
SIEMENS AG	141,900	142.54	20,226,426.00
ALSTOM	61,000	26.29	1,603,690.00
CNH INDUSTRIAL NV	193,000	14.25	2,750,250.00
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	75,900	31.50	2,390,850.00
GEA GROUP AG	29,000	41.23	1,195,670.00
KION GROUP AG	13,100	79.96	1,047,476.00
KNORR-BREMSE AG	12,700	90.64	1,151,128.00
KONE OYJ	63,500	54.72	3,474,720.00
RATIONAL AG	1,050	688.00	722,400.00
WARTSILA OYJ	82,000	10.54	864,280.00
BRENNTAG SE	29,000	78.50	2,276,500.00

IMCD NV	10,200	142.65	1,455,030.00
DEUTSCHE POST AG-REG	184,600	50.93	9,401,678.00
INPOST SA	34,000	6.18	210,324.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	112,000	7.80	874,384.00
ADP	6,100	135.40	825,940.00
AENA SME SA	14,400	154.65	2,226,960.00
ATLANTIA SPA	89,000	16.63	1,480,515.00
GETLINK	83,000	14.38	1,193,955.00
CONTINENTAL AG	20,600	87.36	1,799,616.00
FAURECIA	20,688	41.50	858,552.00
MICHELIN (CGDE)	31,200	137.90	4,302,480.00
VALEO SA	44,000	26.62	1,171,280.00
BAYER MOTOREN WERK	62,000	94.05	5,831,100.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,200	80.25	818,550.00
FERRARI NV	23,200	195.65	4,539,080.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	157,800	75.82	11,964,396.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	27,300	87.76	2,395,848.00
RENAULT SA	33,700	37.17	1,252,797.50
STELLANTIS NV	373,000	17.17	6,404,410.00
VOLKSWAGEN AG	5,800	253.80	1,472,040.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	34,400	186.02	6,399,088.00
SEB SA	5,400	138.00	745,200.00
ADIDAS AG	35,200	234.25	8,245,600.00
ESSILORLUXOTTICA	53,000	167.84	8,895,520.00
HERMES INTERNATIONAL	5,800	1,241.50	7,200,700.00
KERING SA	13,850	632.60	8,761,510.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	51,310	687.60	35,280,756.00
MONCLER SPA	37,600	55.88	2,101,088.00
PUMA SE	18,900	90.16	1,704,024.00
ACCOR SA	32,000	34.00	1,088,000.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	31,100	132.15	4,109,865.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	15,400	37.84	582,736.00
SODEXO	15,900	84.98	1,351,182.00
DELIVERY HERO SE	29,000	49.67	1,440,430.00
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	32,900	39.38	1,295,602.00

PROSUS NV	172,000	67.65	11,635,800.00
ZALANDO SE	40,200	63.02	2,533,404.00
INDITEX SA	199,000	25.43	5,060,570.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	119,000	17.18	2,045,015.00
COLRUYT SA	8,700	36.24	315,288.00
HELLOFRESH SE	31,800	51.38	1,633,884.00
JERONIMO MARTINS	55,000	19.83	1,090,650.00
KESKO OYJ-B SHS	50,000	27.02	1,351,000.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	194,000	26.86	5,211,810.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	142,200	56.30	8,005,860.00
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	91,000	10.47	952,770.00
HEINEKEN HOLDING NV	22,000	77.95	1,714,900.00
HEINEKEN NV	47,700	97.00	4,626,900.00
PERNOD RICARD SA	39,100	190.90	7,464,190.00
REMY COINTREAU	3,900	176.20	687,180.00
DANONE	121,000	55.37	6,699,770.00
JDE PEET'S BV	21,000	26.76	561,960.00
KERRY GROUP PLC-A	29,300	108.95	3,192,235.00
HENKEL AG & CO KGAA	20,300	70.75	1,436,225.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	33,200	73.18	2,429,576.00
BEIERSDORF AG	17,900	88.24	1,579,496.00
LOREAL-ORD	46,200	355.15	16,407,930.00
BIOMERIEUX	6,900	103.15	711,735.00
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	7,200	140.10	1,008,720.00
DIASORIN SPA	4,800	121.75	584,400.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	168,000	29.78	5,003,040.00
SARTORIUS AG-VORZUG	4,720	420.50	1,984,760.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	50,700	54.90	2,783,430.00
AMPLIFON SPA	24,000	35.67	856,080.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	36,600	59.48	2,176,968.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	78,000	37.88	2,954,640.00
ORPEA	9,300	37.94	352,842.00
ARGENX SE	8,300	259.50	2,153,850.00
GRIFOLS SA	54,000	14.89	804,330.00
BAYER AG-REG	182,900	54.07	9,889,403.00

IPSEN	7,300	96.88	707,224.00
MERCK KGAA	24,300	180.90	4,395,870.00
ORION OYJ	21,000	36.42	764,820.00
RECORDATI SPA	19,900	45.51	905,649.00
SANOFI	211,000	93.49	19,726,390.00
UCB SA	22,700	86.82	1,970,814.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	82,000	12.96	1,063,212.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,245,000	5.81	7,240,920.00
BANCO SANTANDER SA	3,200,000	3.37	10,812,800.00
BNP PARIBAS	207,200	62.75	13,001,800.00
CAIXABANK	830,000	3.28	2,723,230.00
COMMERZBANK AG	188,000	8.57	1,612,664.00
CREDIT AGRICOLE SA	226,000	13.43	3,036,988.00
ERSTE GROUP BANK AG	65,000	41.91	2,724,150.00
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	111,000	15.98	1,773,780.00
ING GROEP NV	727,000	12.94	9,408,834.00
INTESA SANPAOLO	3,080,000	2.79	8,596,280.00
KBC GROEP NV	46,000	76.28	3,508,880.00
MEDIOBANCA S.P.A.	107,000	10.38	1,110,660.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	29,000	26.20	759,800.00
SOCIETE GENERALE	151,000	33.89	5,117,390.00
UNICREDIT SPA	389,000	15.09	5,870,788.00
EURAZEO SE	7,800	71.85	560,430.00
EXOR NV	19,500	74.34	1,449,630.00
GROUPE BRUXELLES LAM	21,400	94.88	2,030,432.00
SOFINA SA	2,900	350.20	1,015,580.00
WENDEL	4,300	93.25	400,975.00
AEGON NV	329,000	4.89	1,609,468.00
AGEAS	32,000	44.35	1,419,200.00
ALLIANZ SE-REG	75,900	225.40	17,107,860.00
ASSICURAZIONI GENERALI	208,000	18.95	3,942,640.00
AXA SA	357,000	28.00	9,996,000.00
CNP ASSURANCES	28,000	21.82	610,960.00
HANNOVER RUECK SE	10,900	176.05	1,918,945.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	25,900	267.65	6,932,135.00

NN GROUP NV	49,400	50.60	2,499,640.00
POSTE ITALIANE SPA	103,000	11.09	1,142,785.00
SAMPO OYJ-A SHS	91,000	44.51	4,050,410.00
ADYEN NV	3,700	2,032.00	7,518,400.00
AMADEUS IT GROUP SA	82,900	62.70	5,197,830.00
BECHTLE AG	15,700	47.75	749,675.00
CAPGEMINI SA	30,000	183.00	5,490,000.00
EDENRED	47,000	39.22	1,843,340.00
NEXI SPA	89,000	12.99	1,156,555.00
WORLDLINE SA	44,800	45.99	2,060,352.00
DASSAULT SYSTEMES SE	125,000	41.02	5,128,125.00
NEMETSCHEK SE	11,000	77.58	853,380.00
SAP SE	193,700	105.50	20,435,350.00
NOKIA OYJ	1,002,000	5.10	5,119,218.00
ASM INTERNATIONAL NV	8,400	286.30	2,404,920.00
ASML HOLDING NV	76,390	573.90	43,840,221.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	244,000	33.19	8,099,580.00
STMICROELECTRONICS NV	128,000	39.90	5,107,840.00
CELLNEX TELECOM SA	95,000	39.32	3,735,400.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	615,000	17.50	10,762,500.00
ELISA OYJ	25,700	51.22	1,316,354.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	55,000	8.86	487,520.00
KONINKLIJKE KPN NV	610,000	3.09	1,886,120.00
ORANGE SA	367,000	10.87	3,990,758.00
PROXIMUS	26,000	18.29	475,540.00
TELECOM ITALIA SPA	1,930,000	0.41	799,792.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	210,000	2.65	558,180.00
TELEFONICA SA	990,000	4.38	4,340,160.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	34.82	584,976.00
ELECTRICITE DE FRANCE	79,000	8.35	659,966.00
ELIA GROUP SA/NV	6,200	116.90	724,780.00
ENDESA S.A.	57,000	18.63	1,061,910.00
ENEL SPA	1,501,000	6.51	9,771,510.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	509,000	4.12	2,097,080.00
FORTUM OYJ	79,000	23.26	1,837,540.00

IBERDROLA SA	1,075,133	9.41	10,121,302.06	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	79,000	16.99	1,342,605.00	
TERNA SPA	251,000	6.78	1,702,282.00	
VERBUND AG	12,700	93.40	1,186,180.00	
ENAGAS SA	48,000	18.57	891,360.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	34,000	24.91	846,940.00	
SNAM SPA	384,000	4.82	1,851,264.00	
E.ON SE	410,000	12.01	4,924,100.00	
ENGIE	337,000	14.13	4,762,484.00	
RWE AG	119,000	36.88	4,388,720.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	119,000	32.26	3,838,940.00	
AMUNDI SA	10,000	68.30	683,000.00	
DEUTSCHE BANK AG-REG	387,000	13.88	5,373,108.00	
DEUTSCHE BOERSE AG	34,700	159.05	5,519,035.00	
EURONEXT NV	15,300	82.40	1,260,720.00	
EDP RENOVAVEIS SA	49,000	17.92	878,080.00	
UNIPER SE	15,100	38.60	582,860.00	
EUROFINS SCIENTIFIC SE	25,500	85.78	2,187,390.00	
QIAGEN N.V.	44,000	42.87	1,886,280.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,950	356.20	1,763,190.00	
BUREAU VERITAS SA	54,000	24.57	1,326,780.00	
RANDSTAD NV	21,400	64.82	1,387,148.00	
TELEPERFORMANCE	10,800	316.70	3,420,360.00	
WOLTERS KLUWER	50,300	87.02	4,377,106.00	
AROUNDTOWN SA	173,000	5.60	968,800.00	
LEG IMMOBILIEN SE	14,000	115.85	1,621,900.00	
VONOVIA SE	135,400	47.91	6,487,014.00	
PUBLICIS GROUPE	43,300	63.60	2,753,880.00	
VIVENDI SE	145,000	11.58	1,679,825.00	
BOLLORE	168,000	4.89	822,864.00	
UBISOFT ENTERTAINMENT	17,300	45.66	789,918.00	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	135,000	20.60	2,781,000.00	
SCOUT24 SE	15,200	52.14	792,528.00	
小計 銘柄数：228			890,153,546.60	
			(116,992,880,629)	

	組入時価比率：9.8%			10.1%
英ボンド	BP PLC	3,734,000	4.03	15,076,025.00
	SHELL PLC-NEW	1,423,000	20.23	28,794,405.00
	CRODA INTERNATIONAL PLC	26,300	73.22	1,925,686.00
	JOHNSON MATTHEY PLC	34,800	18.20	633,534.00
	ANGLO AMERICAN PLC	239,000	35.82	8,560,980.00
	ANTOFAGASTA PLC	70,000	14.03	982,100.00
	BHP GROUP LTD	386,000	25.26	9,750,360.00
	GLENCORE PLC	1,861,000	4.25	7,914,833.00
	RIO TINTO PLC-REG	206,900	57.08	11,809,852.00
	MONDI PLC	91,000	19.14	1,741,740.00
	BAE SYSTEMS PLC	599,000	5.98	3,583,218.00
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,520,000	1.21	1,850,144.00
	DCC PLC	18,400	62.84	1,156,256.00
	MELROSE INDUSTRIES PLC	765,000	1.58	1,211,760.00
	SMITHS GROUP PLC	71,000	15.42	1,094,820.00
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	14,100	120.10	1,693,410.00
	ASHTED GROUP PLC	83,200	49.36	4,106,752.00
	BUNZLE	61,000	27.07	1,651,270.00
	FERGUSON PLC	40,500	110.55	4,477,275.00
	RENTOKIL INTIAL PLC	345,000	5.00	1,727,070.00
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	181,000	6.12	1,108,444.00
	PERSIMMON PLC	58,000	24.44	1,417,520.00
	TAYLOR WIMPEY PLC	710,000	1.52	1,084,525.00
	THE BERKELEY GRP HOLDINGS	20,871	40.52	845,692.92
	BURBERRY GROUP PLC	73,000	19.68	1,436,640.00
	COMPASS GROUP PLC	333,000	17.79	5,924,070.00
	ENTAIN PLC	110,000	17.04	1,874,400.00
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	32,500	51.02	1,658,150.00
	WHITBREAD PLC	36,300	31.92	1,158,696.00
	NEXT PLC	23,800	69.78	1,660,764.00
	JD SPORTS FASHION PLC	465,000	1.66	771,900.00
	KINGFISHER PLC	390,000	3.18	1,243,710.00
	OCADO GROUP PLC	92,000	13.42	1,235,100.00
	SAINSBURY	340,000	2.80	953,020.00

TESCO PLC	1,420,000	2.94	4,185,450.00
COCA-COLA HBC AG-DI	39,000	24.46	953,940.00
DIAGEO PLC	432,000	36.05	15,573,600.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	68,000	19.00	1,292,000.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	405,000	34.39	13,927,950.00
IMPERIAL BRANDS PLC	172,000	18.05	3,105,460.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	133,000	58.07	7,723,310.00
UNILEVER PLC	479,600	38.18	18,311,128.00
SMITH & NEPHEW PLC	160,000	12.12	1,939,200.00
NMC HEALTH PLC	13,300	0.02	266.00
ASTRAZENECA PLC	286,280	89.16	25,524,724.80
GLAXOSMITHKLINE PLC	934,000	15.76	14,719,840.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	29,600	19.84	587,264.00
BARCLAYS PLC	3,100,000	1.96	6,076,000.00
HSBC HOLDINGS PLC	3,775,000	5.48	20,698,325.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	12,990,000	0.51	6,745,707.00
NATWEST GROUP PLC	1,070,000	2.43	2,604,380.00
STANDARD CHARTERED PLC	479,000	5.48	2,627,794.00
M&G PLC	500,000	2.16	1,082,000.00
ADMIRAL GROUP PLC	35,000	30.42	1,064,700.00
AVIVA PLC	737,000	4.41	3,255,329.00
LEGAL & GENERAL	1,080,000	2.77	2,992,680.00
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	122,000	6.63	809,592.00
PRUDENTIAL PLC	488,000	12.16	5,934,080.00
AVEVA GROUP PLC	19,911	27.01	537,796.11
SAGE GROUP PLC (THE)	197,000	6.88	1,355,360.00
HALMA PLC	70,000	23.46	1,642,200.00
BT GROUP PLC	1,620,000	2.00	3,254,580.00
VODAFONE GROUP PLC	5,120,000	1.39	7,142,400.00
SSE PLC	195,000	15.84	3,088,800.00
NATIONAL GRID PLC	668,000	10.80	7,219,744.00
SEVERN TRENT PLC	48,000	28.42	1,364,160.00
UNITED UTILITIES GROUP PLC	122,000	10.54	1,285,880.00
3I GROUP PLC	178,000	13.45	2,394,100.00
ABRDN PLC	420,000	2.41	1,015,560.00

	HARGREAVES LANSDOWN PLC	65,000	13.09	851,175.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	60,500	68.84	4,164,820.00	
	SCHRODERS PLC	24,000	32.70	784,800.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	104,000	15.16	1,577,160.00	
	EXPERIAN PLC	172,000	29.10	5,005,200.00	
	INTERTEK GROUP PLC	31,000	52.20	1,618,200.00	
	RELX PLC	357,000	22.61	8,071,770.00	
	INFORMA PLC	275,000	6.20	1,705,000.00	
	PEARSON	148,000	6.23	922,336.00	
	WPP PLC	218,000	12.12	2,643,250.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	171,000	6.40	1,095,426.00	
	小計 銘柄数：80			352,588,558.83	
				(55,335,248,422)	
	組入時価比率：4.6%			4.8%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	41,000	17.16	703,765.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,370	947.00	1,297,390.00	
	GIVAUDAN-REG	1,690	3,681.00	6,220,890.00	
	SIKA AG-REG	26,400	302.90	7,996,560.00	
	HOLCIM LTD	96,500	51.62	4,981,330.00	
	GEBERIT AG-REG	6,580	608.40	4,003,272.00	
	ABB LTD	303,000	32.37	9,808,110.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,700	212.80	787,360.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,400	214.70	1,588,780.00	
	VAT GROUP AG	4,810	353.00	1,697,930.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	10,100	256.10	2,586,610.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	97,100	132.00	12,817,200.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	5,500	289.10	1,590,050.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10,500	55.70	584,850.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	630	2,112.00	1,330,560.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	195	10,120.00	1,973,400.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	20	104,900.00	2,098,000.00	
	NESTLE SA-REG	520,300	117.30	61,031,190.00	
	ALCON INC	92,600	73.98	6,850,548.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	10,300	327.40	3,372,220.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,900	1,462.00	2,777,800.00	
		405,000	80.73	32,695,650.00	

	NOVARTIS AG-REG				
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	129,900	349.30	45,374,070.00	
	ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	5,800	379.80	2,202,840.00	
	VIFOR PHARMA AG	9,100	162.90	1,482,390.00	
	BALOISE HOLDING AG	8,600	160.90	1,383,740.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	5,710	599.40	3,422,574.00	
	SWISS RE LTD	55,100	99.44	5,479,144.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	28,000	442.00	12,376,000.00	
	TEMENOS AG-REG	12,000	101.15	1,213,800.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	31,600	74.46	2,352,936.00	
	SWISSCOM AG-REG	4,850	546.60	2,651,010.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	481,000	8.45	4,065,412.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	42,200	59.58	2,514,276.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	4,140	1,276.00	5,282,640.00	
	UBS GROUP AG	649,000	18.92	12,282,325.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,100	516.00	567,600.00	
	LONZA AG-REG	13,890	613.00	8,514,570.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	28,100	47.42	1,332,502.00	
	SGS SA-REG	1,140	2,597.00	2,960,580.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	13,500	89.50	1,208,250.00	
小計	銘柄数：41			285,460,124.00	
				(35,762,444,334)	
	組入時価比率：3.0%			3.1%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	37,000	330.80	12,239,600.00	
	BOLIDEN AB	49,000	403.70	19,781,300.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B	112,000	164.45	18,418,400.00	
	ASSA ABLOY AB-B	183,000	267.80	49,007,400.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	273,000	89.42	24,411,660.00	
	SKANSKA AB-B SHS	66,000	240.50	15,873,000.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	26,000	274.30	7,131,800.00	
	LIFCO AB-B SHS	42,000	210.40	8,836,800.00	
	ALFA LAVAL AB	57,000	294.60	16,792,200.00	
	ATLAS COPCO AB-A	123,100	508.00	62,534,800.00	
	ATLAS COPCO AB-B	73,100	447.00	32,675,700.00	
	EPIROC AB - A	121,000	197.25	23,867,250.00	

EPIROC AB - B	69,000	168.80	11,647,200.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	73,000	122.00	8,906,000.00	
SANDVIK AB	210,000	244.10	51,261,000.00	
SKF AB-B SHARES	68,000	192.00	13,056,000.00	
VOLVO AB-A SHS	40,000	218.20	8,728,000.00	
VOLVO AB-B SHS	269,000	214.65	57,740,850.00	
SECURITAS AB-B SHS	54,000	120.05	6,482,700.00	
ELECTROLUX AB-B	41,000	184.60	7,568,600.00	
EVOLUTION AB	31,400	1,077.20	33,824,080.00	
HENNES&MAURITZ AB-B	133,000	179.30	23,846,900.00	
SWEDISH MATCH AB	285,000	73.20	20,862,000.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	116,000	264.40	30,670,400.00	
GETINGE AB-B SHS	41,000	361.40	14,817,400.00	
NORDEA BANK ABP	607,000	109.00	66,163,000.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	299,000	121.85	36,433,150.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	266,000	97.36	25,897,760.00	
SWEDBANK AB	170,000	169.92	28,886,400.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	24,092	297.40	7,164,960.80	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	32,000	292.60	9,363,200.00	
INVESTOR AB-A SHS	96,000	214.40	20,582,400.00	
INVESTOR AB-B SHS	334,000	200.40	66,933,600.00	
KINNEVIK AB - B	44,000	255.50	11,242,000.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	15,500	484.70	7,512,850.00	
SINCH AB	92,000	99.14	9,120,880.00	
ERICSSON LM-B	547,000	99.11	54,213,170.00	
HEXAGON AB-B SHS	363,000	124.95	45,356,850.00	
TELIA CO AB	480,000	37.70	18,098,400.00	
TELE 2 AB-B SHS	92,000	132.30	12,171,600.00	
EQT AB	53,000	343.40	18,200,200.00	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	18,700	616.80	11,534,160.00	
SAGAX AB-B	29,000	272.00	7,888,000.00	
EMBRACER GROUP AB	110,000	80.25	8,827,500.00	
小計 銘柄数：44			1,046,571,120.80	
			(13,008,879,031)	
組入時価比率：1.1%				1.1%

ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	22,000	263.10	5,788,200.00	
	EQUINOR ASA	179,000	265.85	47,587,150.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,600	448.80	13,284,480.00	
	NORSK HYDRO	246,000	77.54	19,074,840.00	
	MOWI ASA	84,000	239.30	20,101,200.00	
	ORKLA ASA	133,000	82.66	10,993,780.00	
	DNB BANK ASA	174,000	210.80	36,679,200.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	40,000	214.20	8,568,000.00	
	TELENOR ASA	129,000	138.45	17,860,050.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	18,100	206.60	3,739,460.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	14,400	232.80	3,352,320.00	
	ADEVINTA ASA	45,000	86.10	3,874,500.00	
	小計	銘柄数：12			190,903,180.00
				(2,477,923,276)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	20,400	486.30	9,920,520.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	37,600	399.20	15,009,920.00	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S-B SHS	1,700	2,706.00	4,600,200.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	184,000	172.40	31,721,600.00	
	DSV A/S	37,800	1,270.00	48,006,000.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	560	22,080.00	12,364,800.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,090	23,180.00	25,266,200.00	
	PANDORA A/S	17,700	724.00	12,814,800.00	
	CARLSBERG B	18,000	1,071.50	19,287,000.00	
	AMBU A/S-B	29,000	121.35	3,519,150.00	
	COLOPLAST-B	22,100	934.00	20,641,400.00	
	DEMANT A/S	20,100	278.80	5,603,880.00	
	GN STORE NORD A/S	24,100	371.80	8,960,380.00	
	GENMAB A/S	12,000	2,229.00	26,748,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	311,200	673.00	209,437,600.00	
	DANSKE BANK AS	132,000	130.40	17,212,800.00	
	TRYG A/S	68,000	153.35	10,427,800.00	
	ORSTED A/S	35,100	670.40	23,531,040.00	
	小計	銘柄数：18			505,073,090.00

				(8,919,590,769)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	
豪ドル	AMPOL LTD	40,000	32.18	1,287,200.00	
	SANTOS LTD.	610,000	7.19	4,385,900.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	38,000	26.16	994,080.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	174,000	26.63	4,633,620.00	
	ORICA LTD	79,000	14.93	1,179,470.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	85,000	46.99	3,994,150.00	
	BHP GROUP LIMITED	549,000	47.33	25,984,170.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	90,000	18.92	1,702,800.00	
	EVOLUTION MINING LTD	340,000	4.01	1,363,400.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	313,000	21.15	6,619,950.00	
	NEWCREST MINING	154,000	23.50	3,619,000.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	194,000	9.04	1,753,760.00	
	RIO TINTO LTD	68,000	118.56	8,062,080.00	
	SOUTH32 LTD	870,000	4.45	3,871,500.00	
	REECE LTD	49,000	20.44	1,001,560.00	
	BRAMBLES LTD	270,000	10.01	2,702,700.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	170,000	5.36	911,200.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	305,000	3.63	1,107,150.00	
	SYDNEY AIRPORT	244,000	8.72	2,127,680.00	
	TRANSURBAN GROUP	562,000	12.88	7,238,560.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	110,000	40.98	4,507,800.00	
	CROWN RESORTS LTD	77,000	12.56	967,120.00	
	DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	10,300	105.03	1,081,809.00	
	TABCORP HOLDINGS	420,000	5.15	2,163,000.00	
	WESFARMERS LIMITED	212,000	54.92	11,643,040.00	
	COLES GROUP LTD	243,000	16.62	4,038,660.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	253,000	6.36	1,609,080.00	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	233,000	34.55	8,050,150.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	135,000	11.77	1,588,950.00	
	COCHLEAR LTD	11,500	194.07	2,231,805.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	33,000	64.73	2,136,090.00		
SONIC HEALTHCARE LTD	84,000	38.02	3,193,680.00		
CSL LIMITED	88,800	263.69	23,415,672.00		

	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	530,000	28.10	14,893,000.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	329,000	98.57	32,429,530.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	608,000	30.64	18,629,120.00	
	WESTPAC BANKING CORP	683,000	23.29	15,907,070.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	430,000	4.70	2,021,000.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	520,000	3.22	1,674,400.00	
	QBE INSURANCE	266,000	12.67	3,370,220.00	
	SUNCORP GROUP LTD	245,000	11.52	2,822,400.00	
	BLOCK INC-CDI	14,775	159.30	2,353,657.50	
	COMPUTERSHARE LTD	101,000	23.13	2,336,130.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	28,000	47.00	1,316,000.00	
	XERO LIMITED	25,500	109.04	2,780,520.00	
	TELSTRA CORP LTD	790,000	4.07	3,215,300.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	330,000	6.10	2,013,000.00	
	APA GROUP	229,000	9.93	2,273,970.00	
	ASX LTD	34,500	82.03	2,830,035.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	64,800	196.99	12,764,952.00	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	26,000	18.33	476,580.00	
	IDP EDUCATION LTD	37,000	28.34	1,048,580.00	
	REA GROUP LTD	10,400	138.59	1,441,336.00	
	SEEK LTD	60,000	29.01	1,740,600.00	
	小計 銘柄数：54			279,504,186.50	
				(23,224,002,856)	
	組入時価比率：1.9%			2.0%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	223,000	7.14	1,592,220.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	109,000	29.35	3,199,150.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	74,000	9.35	691,900.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	307,000	4.49	1,379,965.00	
	MERCURY NZ LTD	137,000	5.85	801,450.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	250,000	4.99	1,247,500.00	
	小計 銘柄数：6			8,912,185.00	
				(688,377,169)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	330,000	22.15	7,309,500.00	

	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	509,040	59.10	30,084,264.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	251,000	135.80	34,085,800.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	230,000	32.25	7,417,500.00	
	MTR CORP	272,000	42.80	11,641,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	409,000	48.40	19,795,600.00	
	SANDS CHINA LTD	432,000	23.55	10,173,600.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	410,000	15.88	6,510,800.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	290,000	23.30	6,757,000.00	
	WH GROUP LIMITED	1,538,306	5.66	8,706,811.96	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	670,000	32.10	21,507,000.00	
	HANG SENG BANK	140,000	167.80	23,492,000.00	
	AIA GROUP LTD	2,239,000	88.30	197,703,700.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	719,600	10.86	7,814,856.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	134,000	50.40	6,753,600.00	
	CLP HLDGS	299,000	79.80	23,860,200.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	254,000	50.15	12,738,100.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	2,070,383	12.16	25,175,857.28	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	224,100	439.60	98,514,360.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	383,040	52.85	20,243,664.00	
	ESR CAYMAN LTD	380,000	25.75	9,785,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	360,000	16.36	5,889,600.00	
	HENDERSON LAND	267,443	34.50	9,226,783.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	268,916	32.95	8,860,782.20	
	SINO LAND CO.LTD	620,000	10.42	6,460,400.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	235,000	99.00	23,265,000.00	
	SWIRE PACIFIC-A	104,000	48.20	5,012,800.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	230,000	21.50	4,945,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	311,000	36.75	11,429,250.00	
	小計 銘柄数：29			665,160,428.94	
				(9,844,374,348)	
	組入時価比率：0.8%			0.9%	
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	310,000	3.86	1,196,600.00	
	KEPPEL CORP.	280,000	6.08	1,702,400.00	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	240,000	5.33	1,279,200.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,130,000	0.78	887,050.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	340,000	4.72	1,604,800.00	
	DBS GROUP HLDGS	338,000	36.80	12,438,400.00	
	OCBC-ORD	629,000	13.40	8,428,600.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	220,000	32.75	7,205,000.00	
	VENTURE CORP LTD	45,000	18.52	833,400.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,540,000	2.55	3,927,000.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	148,000	9.79	1,448,920.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	480,000	3.69	1,771,200.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	7.33	513,100.00	
	UOL GROUP LIMITED	87,000	7.25	630,750.00	
	小計 銘柄数：14			43,866,420.00	
				(3,772,950,784)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
新シェケル	ICL GROUP LTD	125,000	32.30	4,037,500.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	5,000	561.00	2,805,000.00	
	BANK HAPOALIM BM	207,000	34.07	7,052,490.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	267,000	35.17	9,390,390.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	213,000	21.70	4,622,100.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	28,000	126.90	3,553,200.00	
	NICE LTD	11,600	831.50	9,645,400.00	
	AZRIELI GROUP	8,600	279.50	2,403,700.00	
	小計 銘柄数：8			43,509,780.00	
				(1,575,515,239)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計				1,154,554,348,617	
				(1,154,554,348,617)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(2022年2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	93,000	1,287,120.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	27,200	5,088,848.00	
		AMERICAN TOWER CORP	83,700	19,446,021.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	267,000	1,943,760.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	25,900	6,212,633.00	
		BOSTON PROPERTIES	26,800	3,285,144.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	18,800	3,078,876.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	79,600	13,107,732.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	52,300	7,039,580.00	
		DUKE REALTY CORP	70,100	3,776,287.00	
		EQUINIX INC	16,560	11,154,484.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	32,100	2,485,503.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	65,000	5,604,950.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,000	3,830,160.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	24,900	4,749,924.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	100,000	3,202,000.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	135,000	2,606,850.00	
		INVITATION HOMES INC	105,000	4,247,250.00	
		IRON MOUNTAIN INC	54,000	2,376,540.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	108,000	2,230,200.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,400	4,465,324.00	
		PROLOGIS INC	136,000	19,635,680.00	
		PUBLIC STORAGE	28,900	10,164,708.00	
		REALTY INCOME CORP	102,100	6,885,624.00	
		REGENCY CENTERS CORP	28,800	1,937,376.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	20,500	6,228,515.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	61,300	8,818,618.00	
		SUN COMMUNITIES INC	21,300	4,087,257.00	
		UDR INC	54,800	3,017,836.00	
		VENTAS INC	73,600	3,858,112.00	
		VICI PROPERTIES INC	111,000	3,194,580.00	
		VORNADO REALTY TRUST	32,000	1,440,000.00	
WELLTOWER INC	77,600	6,509,864.00			
WEYERHAEUSER CO	138,000	5,776,680.00			

小計	WP CAREY INC	34,000	2,606,440.00	
	銘柄数：35	2,338,260	195,380,476.80	(22,562,537,460)
	組入時価比率：1.9%			84.8%
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	826,652.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	28,000	689,080.00	
小計	銘柄数：2	42,900	1,515,732.00	(137,961,926)
	組入時価比率：0.0%			0.5%
ユーロ	COVIVIO	8,500	638,180.00	
	GECINA SA	8,100	935,550.00	
	KLEPIERRE	40,000	998,000.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,900	1,720,800.00	
小計	銘柄数：4	80,500	4,292,530.00	(564,167,217)
	組入時価比率：0.0%			2.1%
英ポンド	BRITISH LAND	159,000	869,730.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	132,000	1,065,768.00	
	SEGRO PLC	220,000	2,811,600.00	
小計	銘柄数：3	511,000	4,747,098.00	(745,009,560)
	組入時価比率：0.1%			2.8%
豪ドル	DEXUS/AU	196,000	2,075,640.00	
	GOODMAN GROUP	307,000	7,368,000.00	
	GPT GROUP	330,000	1,656,600.00	
	LENDLEASE GROUP	135,000	1,366,200.00	
	MIRVAC GROUP	750,000	1,935,000.00	
	SCENTRE GROUP	920,000	2,898,000.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	460,000	1,872,200.00	
	VICINITY CENTRES	670,000	1,249,550.00	
小計	銘柄数：8	3,768,000	20,421,190.00	(1,696,796,677)
	組入時価比率：0.1%			6.4%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	3,713,000.00	
	LINK REIT	392,000	26,087,600.00	
小計	銘柄数：2	862,000	29,800,600.00	

				(441,048,880)	
		組入時価比率：0.0%		1.7%	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	620,040	1,754,713.20	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	904,221	1,898,864.10	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	673,400.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	570,329	998,075.75	
	小計	銘柄数：4	2,464,590	5,325,053.05	
		組入時価比率：0.0%		(458,007,812)	
				1.7%	
	合計			26,605,529,532	
				(26,605,529,532)	

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年 2月17日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	17,053,805,172	-	17,059,311,218	5,506,046
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	665,714,431	-	664,498,602	1,215,829
米ドル	621,228,181	-	620,098,602	1,129,579
香港ドル	44,486,250	-	44,400,000	86,250
合計	-	-	-	4,290,217

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2022年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	2,229,534,187
コール・ローン	747,237,620
国債証券	614,054,446,403
派生商品評価勘定	1,478,707
未収入金	101,033,445
未収利息	4,875,871,691
前払費用	377,315,370
その他未収収益	11,674,512
流動資産合計	622,398,591,935
資産合計	622,398,591,935
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	75,284
未払金	771,815,777
未払解約金	555,632,520
未払利息	506
その他未払費用	4,443,314
流動負債合計	1,331,967,401
負債合計	1,331,967,401
純資産の部	
元本等	
元本	248,128,706,565
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	372,937,917,969
元本等合計	621,066,624,534
純資産合計	621,066,624,534
負債純資産合計	622,398,591,935

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年 2月17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	2.5030円
(10,000口当たり純資産額)	(25,030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	246,160,460,655円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	
3. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価	
貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。	
有価証券	258,189,555,741円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p>

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

2022年 2月17日現在

1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2.時価の算定方法

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 2月17日現在

	2021年 2月18日
期首	
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	230,930,264,606円
同期中における追加設定元本額	45,410,935,700円
同期中における一部解約元本額	28,212,493,741円
期末元本額	248,128,706,565円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	81,624,971円
バランスセレクト50	82,441,264円
バランスセレクト70	79,887,641円
野村外国債券インデックスファンド	271,334,221円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,613,784,931円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	23,266,006,836円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,820,645,884円
野村資産設計ファンド2015	19,123,509円
野村資産設計ファンド2020	19,160,421円
野村資産設計ファンド2025	34,710,179円
野村資産設計ファンド2030	40,485,817円

野村資産設計ファンド2035	29,713,660円
野村資産設計ファンド2040	50,473,775円
野村外国債券インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	73,691,141,716円
のむらップ・ファンド(保守型)	6,399,920,538円
のむらップ・ファンド(普通型)	19,938,502,422円
のむらップ・ファンド(積極型)	5,183,376,042円
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	516,796,021円
野村資産設計ファンド2045	8,035,317円
野村インデックスファンド・外国債券	970,811,660円
マイ・ロード	9,116,130,363円
ネクストコア	144,326,825円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	242,291,318円
野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	8,636,644,135円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,079,541,413円
野村資産設計ファンド2050	8,255,707円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,501,550円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,231,967円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,481,319円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,140,006円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	788,271,781円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	825,474,520円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,747,631円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,586,462円
インデックス・ブレンド(タイプ)	9,445,547円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,660,743円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,715,466円
野村6資産均等バランス	2,120,478,261円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	6,620,297,419円
世界6資産分散ファンド	64,435,303円
野村資産設計ファンド2060	4,039,279円
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信	9,167,389,483円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	5,459,494,678円
野村外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	6,263,094円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,107,993,259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)	180,027,575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)	1,227,782,917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)	685,108,189円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	2,653,970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)	7,967,435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)	328,562円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,057,596,091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)	8,304,710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)	44,010,851円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	7,962,784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)	169,840,045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)	150,180,059円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	1,917,873,360円

野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	74,512,909円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,243,172,536円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	758,722,569円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	6,275,836円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,566,225円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,479,019円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	5,999,770円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	588,538,292円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,449,553,469円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	6,697,907,602円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	5,208,018,640円
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	20,388,392,101円
マイバランスDC30	2,012,123,917円
マイバランスDC50	1,536,063,744円
マイバランスDC70	1,089,850,088円
野村DC外国債券インデックスファンド	8,098,234,854円
野村DC運用戦略ファンド	3,936,610,162円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	473,972,881円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	268,536,575円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	492,726,872円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	236,392,449円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	19,123,630円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	43,488,085円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	20,209,120円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	11,111,439円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	7,610,585円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	4,048,435円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	146,352,819円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	96,157,276円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	52,130,901円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	71,564,164円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	1,965,685円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	16,723,952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)	57,433,575円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	5,685,487円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式(2022年2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	36,400,000.00	39,024,778.52	
		US TREASURY BOND	46,700,000.00	47,491,709.77	
		US TREASURY BOND	66,600,000.00	77,198,763.96	
		US TREASURY BOND	15,000,000.00	18,389,062.50	
		US TREASURY BOND	129,400,000.00	155,906,774.78	
		US TREASURY BOND	100,000.00	128,906.25	
		US TREASURY BOND	100,000.00	106,890.62	
		US TREASURY BOND	200,000.00	243,703.12	
		US TREASURY N/B	20,450,000.00	20,577,812.50	
		US TREASURY N/B	100,000.00	101,203.12	
		US TREASURY N/B	400,000.00	403,515.60	
		US TREASURY N/B	500,000.00	501,289.05	
		US TREASURY N/B	67,400,000.00	67,631,687.50	
		US TREASURY N/B	17,900,000.00	18,168,500.00	
		US TREASURY N/B	500,000.00	496,445.30	
		US TREASURY N/B	400,000.00	401,218.72	
		US TREASURY N/B	100,000.00	101,453.12	
		US TREASURY N/B	900,000.00	889,031.25	
		US TREASURY N/B	15,700,000.00	15,763,781.25	
		US TREASURY N/B	400,000.00	407,000.00	
		US TREASURY N/B	37,200,000.00	37,423,780.32	
		US TREASURY N/B	21,200,000.00	21,286,125.00	
		US TREASURY N/B	9,900,000.00	10,080,210.69	
		US TREASURY N/B	800,000.00	800,062.48	
		US TREASURY N/B	100,000.00	101,726.56	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,292,609.16	
		US TREASURY N/B	37,100,000.00	37,813,013.77	
		US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,606,640.30	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,888,928.87			
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,019,765.60			
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,470,468.75			
US TREASURY N/B	200,000.00	195,945.30			

US TREASURY N/B	35,200,000.00	35,161,498.24	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,022,500.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	195,609.36	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,623,600.90	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,023,203.10	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	43,518,562.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	293,601.54	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,302,780.56	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	30,007,319.58	
US TREASURY N/B	44,400,000.00	44,989,685.28	
US TREASURY N/B	800,000.00	816,124.96	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,460,449.20	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,109,687.20	
US TREASURY N/B	6,900,000.00	7,027,487.85	
US TREASURY N/B	800,000.00	818,874.96	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,652,718.75	
US TREASURY N/B	500,000.00	505,703.10	
US TREASURY N/B	400,000.00	406,546.84	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,312.50	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,741,625.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,367.18	
US TREASURY N/B	500,000.00	504,218.75	
US TREASURY N/B	700,000.00	709,625.00	
US TREASURY N/B	65,400,000.00	66,662,010.72	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,992.18	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,218,390.46	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,820.31	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,849,343.75	
US TREASURY N/B	500,000.00	501,250.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	290,964.84	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,844,234.28	
US TREASURY N/B	500,000.00	501,171.85	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,734.36	
US TREASURY N/B	300,000.00	301,453.11	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,088,140.57	

US TREASURY N/B	100,000.00	96,679.68	
US TREASURY N/B	43,600,000.00	44,073,465.48	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,094,328.07	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,203.12	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,434,312.32	
US TREASURY N/B	500,000.00	497,148.40	
US TREASURY N/B	57,850,000.00	58,654,473.67	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,324,437.50	
US TREASURY N/B	500,000.00	497,031.25	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,926,718.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	100,023.43	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,021,562.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	296,695.29	
US TREASURY N/B	23,000,000.00	23,161,717.60	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,954,031.25	
US TREASURY N/B	17,300,000.00	16,971,569.88	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	33,541,766.67	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,125.00	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	35,650,895.85	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,562.50	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	8,132,386.11	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,033,437.50	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,223,000.00	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,382,406.12	
US TREASURY N/B	23,000,000.00	23,116,796.30	
US TREASURY N/B	700,000.00	721,601.51	
US TREASURY N/B	29,200,000.00	30,372,561.04	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,085.93	
US TREASURY N/B	49,700,000.00	50,367,843.75	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,371,875.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,285,937.00	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	17,065,576.88	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,226.56	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,979,218.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,023,203.10	

US TREASURY N/B	100,000.00	94,562.50	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,069,531.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	190,859.36	
US TREASURY N/B	42,300,000.00	43,086,513.51	
US TREASURY N/B	300,000.00	285,984.36	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,779,750.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	302,484.36	
US TREASURY N/B	300,000.00	285,679.68	
US TREASURY N/B	800,000.00	798,937.44	
US TREASURY N/B	300,000.00	286,968.75	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	7,188,186.96	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,492.18	
US TREASURY N/B	41,900,000.00	41,173,294.78	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,717,811.60	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,953.12	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,316,483.65	
US TREASURY N/B	300,000.00	286,195.29	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,527,812.08	
US TREASURY N/B	300,000.00	289,242.18	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	14,358,093.75	
US TREASURY N/B	81,000,000.00	79,949,527.20	
US TREASURY N/B	500,000.00	484,863.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,273.43	
US TREASURY N/B	200,000.00	196,078.12	
US TREASURY N/B	29,000,000.00	29,459,919.70	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,346,953.02	
US TREASURY N/B	300,000.00	281,062.50	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	15,800,702.70	
US TREASURY N/B	38,000,000.00	38,831,250.00	
US TREASURY N/B	700,000.00	649,414.01	
US TREASURY N/B	300,000.00	278,039.04	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,882.81	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	8,835,937.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	92,343.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,570.31	

US TREASURY N/B	300,000.00	276,257.79	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,014,531.20	
US TREASURY N/B	300,000.00	277,757.79	
US TREASURY N/B	500,000.00	462,226.55	
US TREASURY N/B	500,000.00	465,078.10	
US TREASURY N/B	27,700,000.00	28,888,069.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,070.31	
US TREASURY N/B	500,000.00	478,320.30	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,500.00	
US TREASURY N/B	53,600,000.00	56,275,808.48	
US TREASURY N/B	500,000.00	477,304.65	
US TREASURY N/B	500,000.00	476,835.90	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,765.62	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	10,413,562.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,476.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,140.62	
US TREASURY N/B	300,000.00	287,531.25	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,282,687.44	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,143,570.23	
US TREASURY N/B	23,100,000.00	23,670,281.25	
US TREASURY N/B	300,000.00	291,937.50	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,061,117.03	
US TREASURY N/B	600,000.00	544,125.00	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,634,789.02	
US TREASURY N/B	41,100,000.00	54,361,169.82	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	14,845,326.88	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,023.43	
US TREASURY N/B	150,750,000.00	192,818,671.87	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	925,468.70	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,437.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,109.37	
US TREASURY N/B	6,200,000.00	5,828,726.02	
US TREASURY N/B	29,100,000.00	37,591,286.88	
US TREASURY N/B	8,200,000.00	11,198,125.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	130,851.56	

US TREASURY N/B	100,000.00	116,976.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	127,984.37	
US TREASURY N/B	100,000.00	131,796.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	129,945.31	
US TREASURY N/B	100,000.00	133,875.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	130,371.09	
US TREASURY N/B	100,000.00	122,539.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	128,335.93	
US TREASURY N/B	300,000.00	409,593.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	130,757.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	121,070.31	
US TREASURY N/B	100,000.00	111,183.59	
US TREASURY N/B	100,000.00	111,476.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	109,406.25	
US TREASURY N/B	200,000.00	210,171.86	
US TREASURY N/B	100,000.00	105,007.81	
US TREASURY N/B	290,000.00	322,239.82	
US TREASURY N/B	100,000.00	119,578.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	119,914.06	
US TREASURY N/B	25,500,000.00	29,526,210.30	
US TREASURY N/B	39,950,000.00	44,528,641.53	
US TREASURY N/B	36,700,000.00	40,106,218.75	
US TREASURY N/B	39,900,000.00	40,102,616.19	
US TREASURY N/B	23,400,000.00	25,612,030.08	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	18,796,093.75	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,514,499.84	
US TREASURY N/B	51,500,000.00	51,841,990.90	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	28,378,452.42	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	33,163,125.00	
US TREASURY N/B	14,200,000.00	15,321,577.06	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,208,906.20	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,882,085.81	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	12,099,140.34	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	9,865,991.49	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	10,582,850.85	

	US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,816,390.37	
	US TREASURY N/B	10,500,000.00	11,714,062.50	
	US TREASURY N/B	6,100,000.00	7,286,640.32	
	US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,767,943.75	
	US TREASURY N/B	100,000.00	109,687.50	
	US TREASURY N/B	11,250,000.00	10,919,531.25	
	US TREASURY N/B	300,000.00	299,390.61	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	920,078.10	
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,681,109.32	
	US TREASURY N/B	9,100,000.00	7,183,312.50	
	US TREASURY N/B	6,900,000.00	5,791,147.92	
	US TREASURY N/B	15,200,000.00	13,551,750.00	
	US TREASURY N/B	48,550,000.00	48,512,067.88	
小計	銘柄数：220	2,398,110,000.00	2,540,069,678.41 (293,327,246,462)	
	組入時価比率：47.2%		47.9%	
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,311,019.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,380,000.00	7,392,907.62	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,070,000.00	2,088,267.75	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	506,959.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,366,993.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	34,400,000.00	33,965,321.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,765,930.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	329,354.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	296,726.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	11,400,000.00	10,996,907.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	191,881.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	808,092.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	14,730,000.00	18,624,788.76	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,027,274.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,248,579.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	12,000,000.00	16,381,776.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	2,588,364.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,406,680.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	12,298,697.50	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,436,754.80
	CANADIAN GOVERNMENT	10,600,000.00	10,092,790.00
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	112,339.60
	銘柄数：22 組入時価比率：2.0%	125,580,000.00	136,238,406.23 (12,400,419,735) 2.0%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,300,000.00	4,269,083.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	107,500,000.00	107,965,475.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	65,000,000.00	68,550,794.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	110,000,000.00	102,364,537.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	62,300,000.00	61,615,846.32
	MEX BONOS DESARR FIX RT	77,300,000.00	80,576,638.78
	MEX BONOS DESARR FIX RT	76,600,000.00	76,422,288.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	400,000.00	396,924.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	63,053,372.33
	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,800,000.00	27,022,876.14
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,200,000.00	66,046,244.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	42,624,975.50
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	96,800,000.00	97,113,535.20
	小計	銘柄数：13 組入時価比率：0.7%	790,500,000.00
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	3,800,000.00	3,938,481.12
	BELGIUM KINGDOM	1,900,000.00	1,918,145.00
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,267,200.00
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,019,000.00
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,748,020.58
	BELGIUM KINGDOM	6,700,000.00	7,939,138.20
	BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,425,361.06
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,060,016.00
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,030,314.20
	BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	6,723,756.00
	BELGIUM KINGDOM	10,400,000.00	10,763,376.00
	BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,592,142.10
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	106,060.00
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	535,385.50

BELGIUM KINGDOM	100,000.00	114,203.50
BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	5,416,357.45
BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	6,137,660.00
BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	5,630,674.40
BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	2,975,292.00
BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	3,885,158.70
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,252,132.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	15,199,653.50
BELGIUM KINGDOM GOVT	10,500,000.00	15,935,461.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,168,669.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,056,670.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,300,000.00	7,876,743.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,300,000.00	20,062,326.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,400,000.00	11,278,280.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,700,000.00	6,120,996.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,100,000.00	2,196,999.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,700,000.00	20,349,867.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,600,000.00	7,047,414.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,191,292.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,650,000.00	43,007,458.72
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	830,929.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,200,000.00	9,574,900.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,800,000.00	2,915,118.64
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,192,000.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,000,000.00	17,943,800.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,232,971.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	5,991,300.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,050,400.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,900,000.00	2,919,502.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	6,366,082.38
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,000,000.00	18,170,203.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	3,920,755.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,500,000.00	12,442,500.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,700,000.00	4,917,766.20
BUNDESobligation	100,000.00	100,697.00

BUNDESobligation	2,000,000.00	2,013,980.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	398,334.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	205,258.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,330,000.00	1,381,258.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	6,204,165.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,774,630.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,100,000.00	10,522,382.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000.00	7,949,865.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,761,209.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	8,532,346.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,400,000.00	20,886,744.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,002,940.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	709,254.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	27,296,058.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	205,134.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,300,000.00	25,708,565.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	615,648.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,700,000.00	13,928,618.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,600,000.00	27,647,784.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,750,000.00	27,703,125.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	16,500,000.00	25,619,880.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	12,250,000.00	18,856,964.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,700,000.00	6,141,485.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,800,000.00	4,995,807.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,130,000.00	1,770,884.02	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	9,022,841.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,700,000.00	17,387,370.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,900,000.00	24,933,909.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	7,903,896.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,349.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,399,336.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	535,110.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,037,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,200,000.00	16,349,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	22,800,000.00	24,772,200.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	310,140.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	618,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,600,000.00	7,148,460.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,806,220.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,054,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	31,600,000.00	35,815,440.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	817,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,649,429.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	414,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,750,000.00	16,737,525.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,135,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,900,000.00	19,357,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,099,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	23,400,000.00	30,157,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	211,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	209,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	32,800,000.00	42,416,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	208,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,300,000.00	17,325,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	33,000,000.00	42,094,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	992,460.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,900,000.00	25,853,310.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	886,770.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,400,000.00	14,437,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,478,540.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	22,300,000.00	29,817,330.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,500,000.00	15,554,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	3,358,530.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	548,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	6,334,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	226,380.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	16,222,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	12,544,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	6,377,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,310,160.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	9,892,740.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,900,000.00	7,831,270.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,020,823.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	102,347.60	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	402,819.60	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	735,210.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,097,160.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	103,273.20	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,036,502.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	3,821,716.80	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,416,843.20	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	815,346.08	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	210,173.20	
FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	3,639,382.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	537,064.88	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	897,363.20	
FRANCE (GOVT OF)	200,000.00	201,172.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,615,561.40	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,012,872.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	100,585.00	
FRANCE (GOVT OF)	12,100,000.00	12,793,523.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,803,774.06	
FRANCE (GOVT OF)	13,000,000.00	13,234,130.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,828,375.20	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,337,998.10	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,319,776.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,900,000.00	7,077,744.00	
FRANCE (GOVT OF)	15,100,000.00	15,463,426.80	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,008,826.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,400,000.00	10,924,980.80	
FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	10,587,385.60	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	104,270.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	113,593.90	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	12,618,600.40	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,134,804.00	

FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	435,412.90	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	442,806.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,400,000.00	14,460,878.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,300,000.00	5,583,417.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	11,622,594.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,214,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	298,782.90	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000.00	37,796,890.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	5,137,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,700,000.00	40,457,381.58	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,600,000.00	15,751,502.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	22,500,000.00	34,285,342.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,100,000.00	43,452,003.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	443,720.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,650,000.00	12,327,592.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,150,000.00	34,750,642.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,850,000.00	11,918,431.45	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,340,000.00	24,158,659.96	
IRISH GOVERNMENT	6,130,000.00	7,164,541.71	
IRISH GOVERNMENT	7,300,000.00	7,560,120.90	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	625,761.60	
IRISH TSY 1.3% 2033	4,300,000.00	4,511,439.60	
IRISH TSY 1.35% 2031	3,300,000.00	3,523,053.60	
IRISH TSY 1.5% 2050	2,600,000.00	2,751,240.70	
IRISH TSY 1.7% 2037	3,100,000.00	3,415,815.60	
IRISH TSY 1% 2026	7,100,000.00	7,363,828.90	
IRISH TSY 2.4% 2030	7,000,000.00	8,068,323.20	
IRISH TSY 2% 2045	1,600,000.00	1,895,718.40	
IRISH TSY 3.4% 2024	8,500,000.00	9,148,223.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	418,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	100,732.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,300,000.00	3,482,074.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,517,226.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	1,936,765.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,583,455.00	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	16,113,000.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,034,550.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	796,000.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	12,200,000.00	14,799,612.60	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,700,000.00	7,003,018.80	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	493,183.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3,600,000.00	5,739,315.84	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	8,600,000.00	12,894,306.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,040,952.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	905,526.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	155,355.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,306,370.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	735,156.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,358,247.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	6,473,520.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,056,796.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	10,114,566.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	10,600,000.00	10,662,540.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	8,600,000.00	10,324,214.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	594,181.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	6,450,362.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,000,000.00	7,862,400.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,866,028.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	1,773,037.25	
	REPUBLIC OF IRELAND	10,650,000.00	11,157,014.55	
	SPANISH GOVERNMENT	25,200,000.00	34,109,913.60	
	SPANISH GOVERNMENT	26,900,000.00	38,975,410.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,900,000.00	8,085,731.70	
小計	銘柄数：217	1,451,190,000.00	1,791,671,098.43 (235,479,332,466)	
	組入時価比率：37.9%		38.3%	
英債券	UK TREASURY	1,600,000.00	1,584,080.00	
	UK TREASURY	9,900,000.00	9,827,223.12	
	UK TREASURY	2,800,000.00	2,838,147.20	
	UK TREASURY	300,000.00	292,683.75	

	UK TREASURY	2,000,000.00	1,984,912.00
	UK TREASURY	4,100,000.00	4,239,119.56
	UK TREASURY	14,670,000.00	16,248,990.78
	UK TREASURY	200,000.00	195,378.40
	UK TREASURY	200,000.00	204,370.00
	UK TREASURY	3,810,000.00	3,836,884.88
	UK TREASURY	400,000.00	397,800.00
	UK TREASURY	12,900,000.00	14,957,859.60
	UK TREASURY	200,000.00	203,250.28
	UK TREASURY	6,300,000.00	8,179,983.00
	UK TREASURY	6,650,000.00	8,464,863.47
	UK TREASURY	7,710,000.00	9,686,458.50
	UK TREASURY	15,750,000.00	20,887,653.15
	UK TREASURY	4,330,000.00	5,751,894.06
	UK TREASURY	100,000.00	145,772.76
	UK TREASURY	350,000.00	489,542.48
	UK TREASURY	300,000.00	425,797.20
	UK TREASURY	320,000.00	480,122.62
	UK TREASURY	18,440,000.00	24,911,023.80
	UK TREASURY	5,900,000.00	9,011,117.20
	UK TREASURY	8,200,000.00	7,978,600.00
	UK TREASURY	16,100,000.00	16,590,824.60
	UK TREASURY	5,350,000.00	8,505,858.00
	UK TREASURY	1,100,000.00	1,008,312.80
	UK TREASURY	6,750,000.00	10,262,430.00
	UK TREASURY	1,300,000.00	1,320,586.80
	UK TREASURY	700,000.00	743,463.00
	UK TREASURY	8,950,000.00	15,508,112.50
	UK TREASURY	100,000.00	134,958.00
	UK TREASURY	200,000.00	341,712.00
	UK TSY 3 1/4% 2044	6,350,000.00	8,207,054.96
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,400,000.00	10,930,124.80
小計	銘柄数：36	180,730,000.00	226,776,965.27 (35,590,376,929)
	組入時価比率：5.7%		5.8%
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT	7,900,000.00	8,110,960.02

ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	36,350,000.00	38,912,675.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,000,000.00	16,419,600.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	17,300,000.00	17,538,200.24	
	SWEDISH GOVERNMENT	18,900,000.00	19,166,679.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	8,100,000.00	7,762,896.63	
	SWEDISH GOVERNMENT	21,300,000.00	30,645,717.93	
	小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.3%	125,850,000.00	138,556,728.82 (1,722,260,139) 0.3%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,341,684.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	37,800,000.00	38,768,995.44	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	12,500,000.00	12,437,562.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,595,171.30	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	10,045,980.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	9,355,350.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	28,000,000.00	27,369,440.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,400,000.00	6,994,517.00	
	小計	銘柄数：8 組入時価比率：0.2%	116,300,000.00	115,908,700.74 (1,504,494,935) 0.2%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	870,000.00	897,438.93	
	KINGDOM OF DENMARK	24,800,000.00	26,279,320.00	
	KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	15,877,665.91	
	KINGDOM OF DENMARK	37,250,000.00	37,454,875.00	
	KINGDOM OF DENMARK	40,200,000.00	66,396,450.60	
	KINGDOM OF DENMARK	3,500,000.00	3,098,795.00	
	小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.4%	122,320,000.00	150,004,545.44 (2,649,080,272) 0.4%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	39,000,000.00	37,680,672.90	
	POLAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	730,518.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	2,948,400.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	59,100,000.00	54,942,315.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,438,475.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,396,550.00	

小計	銘柄数：6	107,100,000.00	101,136,931.70 (2,948,070,763)
	組入時価比率：0.5%		0.5%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	750,000.00	791,539.87
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,135,200.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,300,000.00	10,806,067.84
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	16,380,000.00	17,962,891.12
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	6,030,899.68
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,248,568.92
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	312,595.20
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	3,012,518.04
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	10,531,270.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	22,200,000.00	22,763,915.52
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,155,335.93
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	3,105,161.07
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,809,681.22
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,500,000.00	10,388,415.25
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,354,322.32
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,250,000.00	9,568,553.77
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	760,130.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,512,632.70
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,900,000.00	5,049,450.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,000,000.00
小計	銘柄数：20	109,480,000.00	115,666,148.45 (9,610,700,274)
	組入時価比率：1.5%		1.6%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	504,094.65
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,800,000.00	3,888,109.84
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,472,359.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,393,150.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,132,560.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,427,580.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,650,000.00	5,035,020.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	522,750.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	320,100.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,850,000.00	4,132,975.00
	SINGAPORE GOVERNMENT		

小計	SINGAPORE GOVERNMENT	2,080,000.00	2,361,840.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,920,000.00	1,952,736.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,750,000.00	3,040,867.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,116,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	1,982,400.00	
	銘柄数：15	30,600,000.00	32,283,141.99	(2,776,673,042)
組入時価比率：0.4%			0.5%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	411,675.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,762,279.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,700,000.00	2,639,429.01	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	431,522.32	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,713,028.65	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,900,000.00	3,975,428.34	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,249,274.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,983,628.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	618,630.78	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,600,000.00	16,311,160.32	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,703,119.58	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,027,259.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,217,563.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	283,911.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,400,000.00	16,246,450.22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,595,100.92	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	3,770,565.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	7,228,996.35	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	10,446,807.85	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	7,724,787.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	316,565.28		
小計	銘柄数：21	110,980,000.00	114,657,183.22	(3,165,065,679)
組入時価比率：0.5%			0.5%	
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	96,300,000.00	96,735,083.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	89,500,000.00	90,218,237.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000,000.00	50,472,250.00	

小計	CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	33,487,080.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,084,154.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,918,723.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,000,000.00	13,471,640.00	
	銘柄数：7	306,800,000.00	310,387,167.90	(5,655,471,470)
	組入時価比率：0.9%			0.9%
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,220,452.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,083,267.00	
	ISRAEL FIXED BOND	6,200,000.00	6,610,533.62	
	ISRAEL FIXED BOND	11,900,000.00	12,250,446.67	
	ISRAEL FIXED BOND	6,500,000.00	8,049,181.40	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,211,507.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,287,349.50	
	ISRAEL FIXED BOND	8,500,000.00	8,145,130.95	
	ISRAEL FIXED BOND	3,700,000.00	3,343,441.73	
	ISRAEL FIXED BOND	6,000,000.00	8,912,630.40	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,969,075.50	
	小計	銘柄数：11	67,800,000.00	74,083,015.77
	組入時価比率：0.4%			0.4%
合計			614,054,446,403	(614,054,446,403)

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(3)貸付有価証券の明細(2022年 2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	12,000,000	
		US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	8,117,000	
		US TREASURY N/B	18,000,000	
		US TREASURY N/B	10,385,000	
		US TREASURY N/B	33,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	13,700,000	
		US TREASURY N/B	11,900,000	
		US TREASURY BOND	85,000	

US TREASURY N/B	7,586,000
US TREASURY N/B	19,000,000
US TREASURY N/B	10,700,000
US TREASURY N/B	19,000,000
US TREASURY N/B	33,000,000
US TREASURY N/B	246,000
US TREASURY N/B	17,000,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	16,300,000
US TREASURY N/B	8,435,000
US TREASURY BOND	43,000,000
US TREASURY BOND	50,000,000
US TREASURY BOND	13,000,000
US TREASURY N/B	15,000,000
US TREASURY N/B	26,000,000
US TREASURY N/B	27,000,000
US TREASURY N/B	35,500,000
US TREASURY BOND	50,000,000
US TREASURY BOND	5,000,000
US TREASURY BOND	11,000,000
US TREASURY BOND	30,000,000
US TREASURY N/B	11,000,000
US TREASURY N/B	23,000,000
US TREASURY N/B	765,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	14,450,000
US TREASURY N/B	255,000
US TREASURY N/B	13,298,000
US TREASURY N/B	255,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	170,000
US TREASURY N/B	850,000
US TREASURY N/B	14,705,000
US TREASURY N/B	935,000
US TREASURY N/B	425,000
US TREASURY N/B	29,000,000
US TREASURY N/B	8,400,000
US TREASURY N/B	19,000,000
US TREASURY N/B	46,000,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	12,000,000
US TREASURY N/B	50,000,000
US TREASURY N/B	12,000,000
US TREASURY N/B	18,000,000
US TREASURY N/B	31,000,000
US TREASURY N/B	425,000
US TREASURY N/B	5,000,000

	US TREASURY N/B	19,000,000
	US TREASURY N/B	289,000
	US TREASURY N/B	12,750,000
	US TREASURY N/B	11,050,000
	US TREASURY N/B	5,950,000
	US TREASURY N/B	1,870,000
	US TREASURY N/B	5,000,000
	US TREASURY N/B	37,000,000
	US TREASURY N/B	1,445,000
	US TREASURY N/B	7,395,000
	US TREASURY N/B	37,000,000
	US TREASURY N/B	41,000,000
	US TREASURY N/B	35,000,000
	US TREASURY N/B	1,000,000
	US TREASURY BOND	30,618,000
	US TREASURY N/B	30,000,000
	US TREASURY N/B	17,000,000
	US TREASURY N/B	2,100,000
	US TREASURY N/B	25,000,000
	US TREASURY N/B	7,500,000
	US TREASURY N/B	37,000,000
	US TREASURY N/B	1,350,000
	US TREASURY N/B	8,000,000
	US TREASURY N/B	12,750,000
	US TREASURY N/B	27,000,000
	US TREASURY N/B	578,000
	US TREASURY N/B	23,000,000
	US TREASURY N/B	36,000,000
	US TREASURY N/B	850,000
	US TREASURY N/B	31,000,000
	US TREASURY N/B	7,735,000
	US TREASURY N/B	8,415,000
	US TREASURY N/B	30,000,000
	US TREASURY N/B	27,000,000
	US TREASURY N/B	24,000,000
	US TREASURY N/B	850,000
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,600,000
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,900,000
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,000,000
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,500,000
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	500,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	102,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	351,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	176,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	759,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	36,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	529,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	579,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	500,000

	MEX BONOS DESARR FIX RT	151,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	794,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	365,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	219,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	250,000
	MEX BONOS DESARR FIX RT	407,000
ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,295,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,100,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,240,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000
	BUNDES OBLIGATION	1,700,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	595,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	770,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,450,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,160,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,930,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,375,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,255,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,900,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	945,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	960,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,100,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,410,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,900,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,235,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,380,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,100,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	16,400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,300,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,170,000
	FRANCE (GOVT OF)	8,058,000
	FRANCE (GOVT OF)	12,000,000
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,700,000
	FRANCE (GOVT OF)	10,000,000
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,000,000
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,500,000
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,000,000
	SPANISH GOVERNMENT	22,800,000
	SPANISH GOVERNMENT	20,000,000

	NETHERLANDS GOVERNMENT	10,400,000
	BUONI POLIENNALI DEL TES	16,000,000

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年 2月17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	304,950,542	-	306,245,000	1,294,458
米ドル	161,391,412	-	161,670,460	279,048
ユーロ	143,559,130	-	144,574,540	1,015,410
売建	177,001,242	-	176,892,277	108,965
米ドル	57,846,500	-	57,739,450	107,050
ユーロ	59,173,650	-	59,144,130	29,520
英ポンド	12,551,360	-	12,554,944	3,584
ノルウェークローネ	10,413,952	-	10,383,680	30,272
ズロチ	2,632,590	-	2,623,239	9,351
シンガポールドル	16,349,690	-	16,341,634	8,056
新シェケル	18,033,500	-	18,105,200	71,700
合計	-	-	-	1,403,423

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	2,454,056,391
コール・ローン	179,512,933
株式	67,293,595,174
投資信託受益証券	2,969,862,558
投資証券	64,794,378
派生商品評価勘定	62,823,430
未収入金	4,337,482
未収配当金	95,949,941
差入委託証拠金	838,206,670
流動資産合計	73,963,138,957
資産合計	73,963,138,957
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,310,016
未払金	72,007,741
未払解約金	31,505,912
未払利息	121
その他未払費用	1,277,900
流動負債合計	109,101,690
負債合計	109,101,690
純資産の部	
元本等	
元本	44,775,261,155
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	29,078,776,112
元本等合計	73,854,037,267
純資産合計	73,854,037,267
負債純資産合計	73,963,138,957

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p>
--------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p> <p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年 2月17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	1.6494円
(10,000口当たり純資産額)	(16,494円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
投資信託受益証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
投資証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 2月17日現在	
期首	2021年 2月18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	38,433,241,479円
同期中における追加設定元本額	10,551,559,973円
同期中における一部解約元本額	4,209,540,297円
期末元本額	44,775,261,155円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	20,716,826円
野村資産設計ファンド2020	20,736,192円
野村資産設計ファンド2025	37,289,830円
野村資産設計ファンド2030	54,518,188円
野村資産設計ファンド2035	46,380,515円
野村資産設計ファンド2040	87,111,259円
野村資産設計ファンド2045	16,411,323円
野村インデックスファンド・新興国株式	3,568,972,698円

ネクストコア	5,089,890円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	390,251,951円
野村資産設計ファンド2050	21,553,749円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	6,868,574円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	3,667,353円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	2,900,722円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	2,422,172円
インデックス・ブレンド(タイプ)	954,435円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,116,242円
インデックス・ブレンド(タイプ)	10,059,681円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,409,536円
インデックス・ブレンド(タイプ)	13,550,771円
野村つみたて外国株投信	3,856,765,088円
野村外国株(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	1,067,292,505円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	1,822,598,474円
世界6資産分散ファンド	103,759,589円
野村資産設計ファンド2060	15,144,023円
NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIEマージング・マーケット・インデックス(為替ヘッジなし)連動型上場投信	1,111,461,264円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	1,530,970,423円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	4,272,815円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国株式(適格機関投資家専用)	404,992,444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)	841,721円
野村新興国株式インデックスファンド(確定拠出年金向け)	30,291,658,669円
野村DC運用戦略ファンド	139,558,100円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	10,444,339円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	14,944,718円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	13,142,691円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	10,557,268円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	7,370,989円
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	55,504,128円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	20,300	15.32	310,996.00	
		LUKOIL PJSC-SPON ADR	32,050	92.64	2,969,112.00	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	7,000	215.40	1,507,800.00	

PJSC GAZPROM-ADR	456,300	8.98	4,099,399.20
ROSNEFT OJSC - GDR	83,900	7.91	663,649.00
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	103,000	4.71	485,748.00
TATNEFT-SPONSORED ADR	19,100	40.60	775,460.00
PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	12,100	23.64	286,044.00
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	11,579	66.15	765,950.85
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	21,600	9.78	211,248.00
NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	10,300	31.26	321,978.00
PJSC ALROSA	176,000	1.54	271,073.44
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	48,600	29.56	1,436,616.00
POLYUS PJSC-REG S-GDR	4,710	85.50	402,705.00
SEVERSTAL-GDR REG S	15,800	21.98	347,284.00
SOUTHERN COPPER CORP	6,300	68.63	432,369.00
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	34,600	30.41	1,052,186.00
DIDI GLOBAL INC	18,200	4.46	81,172.00
LI AUTO INC - ADR	43,200	29.79	1,286,928.00
NIO INC ADR	105,000	25.61	2,689,050.00
XPENG INC ADR	29,900	39.15	1,170,585.00
HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR	14,300	45.41	649,363.00
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	39,200	30.01	1,176,392.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	32,400	52.40	1,697,760.00
DADA NEXUS LTD-ADR	4,100	10.80	44,280.00
OZON HOLDINGS PLC - ADR	5,300	22.95	121,635.00
PINDUODUO INC ADR	33,820	60.20	2,035,964.00
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	32,200	10.26	330,372.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	31,300	15.58	487,654.00
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	11,500	24.75	284,625.00
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	7,100	16.80	119,280.00
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	56,300	3.81	214,503.00
BEIGENE, LTD ADR	3,560	220.20	783,912.00
I-MAB-SPONSORED ADR	2,300	28.86	66,378.00
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	4,500	41.60	187,200.00
ZAI LAB LTD - ADR	5,420	58.75	318,425.00
HUTCHMED CHINA-ADR	7,800	26.80	209,040.00
BANCO DE CHILE-ADR	18,100	21.68	392,408.00

BANCO SANTANDER CHILE-ADR	13,800	20.14	277,932.00
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	10,030	34.66	347,639.80
CREDICORP LTD	4,970	158.09	785,707.30
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	811,000	3.68	2,991,113.98
STATE BANK OF INDIA-GDR	13,800	67.80	935,640.00
TCS GROUP HOLDING-REG S	9,300	72.00	669,600.00
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	87,890	1.22	107,753.14
CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	6,000	5.45	32,700.00
GDS HOLDINGS LTD-ADR	6,500	44.50	289,250.00
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	4,000	7.77	31,080.00
VNET GROUP INC	7,200	8.38	60,336.00
AGORA INC-ADR	3,400	11.07	37,638.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	29,000	4.52	131,080.00
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4,100	40.84	167,444.00
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	28,650	7.78	222,897.00
ENEL AMERICAS S.A-ADR	29,900	5.81	173,719.00
ENEL CHILE SA-ADR	42,900	1.85	79,365.00
INTER RAO UES PJSC	3,660,000	0.05	186,477.00
360 DIGITECH INC-ADR	6,000	21.16	126,960.00
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	133,000	1.88	250,117.14
NOAH HLDS LTD ADR	3,000	32.24	96,720.00
NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	109,400	1.62	177,228.00
TAL EDUCATION GROUP-ADR	29,730	3.61	107,325.30
51JOB INC-ADR	2,210	49.81	110,080.10
KE HOLDINGS INC ADR	27,600	20.53	566,628.00
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	87,648	0.93	81,600.28
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	12,020	37.84	454,836.80
IQIYI INC-ADR	21,400	4.43	94,802.00
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	59,400	6.17	366,498.00
AUTOHOME INC-ADR	7,500	29.25	219,375.00
BAIDU INC - SPON ADR	21,440	167.35	3,587,984.00
HELLO GROUP INC-SPN ADR	11,500	10.73	123,395.00
JOYY INC	4,250	53.11	225,717.50
KANZHUN LTD	5,000	34.00	170,000.00
VK CO LTD GDR	7,000	8.00	56,000.00

	WEIBO CORP-SPON ADR	4,500	32.36	145,620.00	
	YANDEX NV-A	23,640	53.58	1,266,631.20	
小計	銘柄数：75			46,441,435.03	
				(5,363,056,917)	
	組入時価比率：7.3%			8.0%	
メキシコペソ	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	93,958	53.05	4,984,471.90	
	CEMEX SAB - CPO	1,121,985	11.67	13,093,564.95	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	230,983	105.85	24,449,550.55	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	228.63	1,922,778.30	
	ALFA S.A.B. -A	218,000	15.41	3,359,380.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	59.11	2,062,939.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	14,300	453.71	6,488,053.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	30,400	311.67	9,474,768.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,400	155.19	2,545,116.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	408,000	75.90	30,967,200.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	32,000	125.83	4,026,560.00	
	BECLE SAB DE CV	47,000	50.54	2,375,380.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	38,000	109.32	4,154,160.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	156,800	159.47	25,004,896.00	
	GRUMA S.A.B. -B	15,600	275.03	4,290,468.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	138,000	63.22	8,724,360.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	110,000	30.38	3,341,800.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	200,100	136.97	27,407,697.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	169,000	31.74	5,364,060.00	
	TELESITES SAB DE CV	111,000	24.02	2,666,220.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,631,000	19.24	50,620,440.00	
	GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	178,000	44.79	7,972,620.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	23,100	63.58	1,468,698.00	
小計	銘柄数：23			246,765,180.70	
				(1,404,686,114)	
	組入時価比率：1.9%			2.1%	
リアル	COSAN SA	86,800	22.92	1,989,456.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	287,000	36.27	10,409,490.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	367,100	32.93	12,088,603.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	48,000	15.80	758,400.00	

BRASKEM SA-PREF A	13,200	51.53	680,196.00
KLABIN SA-UNIT	61,000	23.03	1,404,830.00
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	26.51	1,224,762.00
GERDAU SA PFD NPV	95,000	27.45	2,607,750.00
VALE SA	316,552	89.50	28,331,404.00
SUZANO SA	62,960	57.28	3,606,348.80
WEG SA	134,748	31.30	4,217,612.40
LOCALIZA RENT A CAR	45,660	60.05	2,741,883.00
RUMO SA	96,000	16.71	1,604,160.00
CCR SA	121,000	12.90	1,560,900.00
ALPARGATAS SA-PREF	12,000	27.09	325,080.00
AMERICANAS SA	43,039	35.44	1,525,302.16
AMERICANAS SA-RTS	957	11.51	11,015.07
LOJAS RENNER S.A.	69,074	27.51	1,900,225.74
MAGAZINE LUIZA SA	230,000	6.82	1,568,600.00
VIA S/A	92,000	4.15	381,800.00
VIBRA ENERGIA SA	83,600	24.45	2,044,020.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	29,600	16.85	498,760.00
RAIA DROGASIL SA	78,200	23.50	1,837,700.00
AMBEV SA	355,956	15.08	5,367,816.48
BRF SA	63,000	19.00	1,197,000.00
JBS SA	74,600	37.18	2,773,628.00
NATURA &CO HOLDING SA	62,500	25.00	1,562,500.00
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	297,587	12.72	3,785,306.64
REDE D'OR SAO LUIZ SA	29,800	50.54	1,506,092.00
HYPERA SA	23,900	31.72	758,108.00
BANCO BRADESCO S.A.	111,049	18.01	1,999,992.49
BANCO BRADESCO SA - PREF	373,039	21.44	7,997,956.16
BANCO DO BRASIL SA	72,800	35.33	2,572,024.00
BANCO INTER SA-UNITS	27,300	28.26	771,498.00
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	32.41	790,804.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	373,991	26.44	9,888,322.04
ITAUSA SA	352,817	10.58	3,732,803.86
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	44,100	23.08	1,017,828.00
TOTVS SA	40,000	30.45	1,218,000.00

	TELEFONICA BRASIL S.A.	41,605	49.29	2,050,710.45	
	TIM SA	82,952	13.82	1,146,396.64	
	CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	18,000	34.60	622,800.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	30,000	35.17	1,055,100.00	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	69,683	13.14	915,634.62	
	ENERGISA SA-UNITS	10,200	43.61	444,822.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	70,000	24.74	1,731,800.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	21,300	36.82	784,266.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	475,799	14.59	6,941,907.41	
	BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT	90,000	25.29	2,276,100.00	
	ENGIE BRASIL SA	12,000	40.55	486,600.00	
小計	銘柄数：50			148,714,114.96	
				(3,347,450,627)	
	組入時価比率：4.5%			5.0%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	25,900	6,750.00	174,825,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	71,951	1,450.00	104,328,950.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	50,200	2,625.00	131,775,000.00	
	CENCOSUD SA	126,000	1,485.00	187,110,000.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	3,396	30,601.00	103,920,996.00	
小計	銘柄数：5			701,959,946.00	
				(101,355,996)	
	組入時価比率：0.1%			0.2%	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	15,900	38,120.00	606,108,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	13,000	36,500.00	474,500,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,800	23,040.00	778,752,000.00	
小計	銘柄数：3			1,859,360,000.00	
				(54,150,141)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ユーロ	FF GROUP	2,030	0.00	0.00	
	OPAP SA	13,190	13.62	179,647.80	
	JUMBO SA	6,732	13.80	92,901.60	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	206,500	1.42	294,262.50	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS	180,800	1.14	206,112.00	
	HELLENIC TELECOM	18,000	17.84	321,120.00	

	PUBLIC POWER CORP	20,000	8.71	174,200.00	
小計	銘柄数：7			1,268,243.90	
				(166,685,295)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
英bond	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	27,800	11.86	329,847.00	
小計	銘柄数：1			329,847.00	
				(51,766,188)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,300	195.60	1,623,480.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,000	28.18	3,268,880.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	41,460	22.26	922,899.60	
	KOC HLDGS	53,000	34.66	1,836,980.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	88,000	13.47	1,185,360.00	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	6,200	264.70	1,641,140.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	30,000	75.30	2,259,000.00	
	AKBANK T.A.S	205,000	7.94	1,627,700.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	142,160	11.84	1,683,174.40	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	91,800	8.65	794,070.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	117,000	18.77	2,196,090.00	
小計	銘柄数：11			19,038,774.00	
				(161,726,769)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	990.00	4,999,500.00	
	MONETA MONEY BANK AS	42,000	93.10	3,910,200.00	
	CEZ AS	12,500	856.00	10,700,000.00	
小計	銘柄数：3			19,609,700.00	
				(105,839,433)	
	組入時価比率：0.1%			0.2%	
フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	37,500	2,662.00	99,825,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	9,200	8,100.00	74,520,000.00	
	OTP BANK NYRT	16,200	17,465.00	282,933,000.00	
小計	銘柄数：3			457,278,000.00	
				(169,327,299)	
	組入時価比率：0.2%			0.3%	
ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	25,900	73.72	1,909,348.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	97,770	5.42	530,500.02	

	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	9,900	154.30	1,527,570.00	
	LPP SA	94	15,840.00	1,488,960.00	
	ALLEGRO.EU SA	29,400	34.32	1,009,155.00	
	DINO POLSKA SA	3,820	293.00	1,119,260.00	
	BANK PEKAO SA	15,700	135.25	2,123,425.00	
	MBANK	1,100	484.00	532,400.00	
	PKO BANK POLSKI SA	63,000	47.21	2,974,230.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,100	359.80	1,115,380.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,500	35.88	1,811,940.00	
	ORANGE POLSKA SA	39,150	8.28	324,162.00	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	51,730	7.94	411,150.04	
	CYFROWY POLSAT SA	18,900	30.12	569,268.00	
	CD PROJEKT RED SA	4,960	181.80	901,728.00	
	小計 銘柄数：15			18,348,476.06	
				(534,845,233)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY	367,000	0.05	19,451.00	
	LEGEND HLDS CORP-RTS	18,100	0.00	0.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	130,000	8.75	1,137,500.00	
	CHINA COAL ENERGY CO-H	150,000	4.99	748,500.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,930,900	4.04	7,800,836.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	283,000	22.00	6,226,000.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	129,000	4.68	603,720.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,700,000	4.09	6,953,000.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	138,000	19.30	2,663,400.00	
	DONGYUE GROUP LTD	108,000	9.20	993,600.00	
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS	69,000	4.84	333,960.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	91,000	44.05	4,008,550.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	309,000	11.14	3,442,260.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	176,000	7.12	1,253,120.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	280,000	5.15	1,442,000.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	160,000	10.54	1,686,400.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	240,000	4.64	1,113,600.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD	22,600	125.70	2,840,820.00	

JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	14.62	1,432,760.00
MMG LTD	168,000	2.97	498,960.00
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	36,000	14.38	517,680.00
UNITED CO RUSAL INTERNATIONAL	279,000	8.98	2,505,420.00
ZIJIN MINING GROUP CO-H	431,000	11.54	4,973,740.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	78,000	5.61	437,580.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	118,000	8.16	962,880.00
AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	202,000	4.66	941,320.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	92,000	13.82	1,271,440.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	4.41	769,104.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	134,000	38.00	5,092,000.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	290,000	4.99	1,447,100.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	153,250	10.18	1,560,085.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	55,984	13.28	743,467.52
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	36,300	37.65	1,366,695.00
CITIC LTD	473,000	8.91	4,214,430.00
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	225,940	8.95	2,022,163.00
CRRC CORP LTD-H	320,000	3.65	1,168,000.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	57,000	21.10	1,202,700.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	77,000	8.52	656,040.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	50,000	12.04	602,000.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	149,800	14.16	2,121,168.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H	116,000	5.51	639,160.00
BOC AVIATION LTD	15,000	72.40	1,086,000.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	281,000	5.95	1,671,950.00
AIR CHINA LIMITED-H	102,000	6.53	666,060.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	5.36	568,160.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	273,000	15.16	4,138,680.00
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	98,000	5.50	539,000.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	106,000	15.56	1,649,360.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	6.76	689,520.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	8.65	588,200.00
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS	79,000	8.41	664,390.00

LIMITED			
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	6.88	784,320.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	43,600	42.30	1,844,280.00
MINTH GROUP LTD	54,000	33.90	1,830,600.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	218,000	6.40	1,395,200.00
BYD CO LTD-H	60,500	247.00	14,943,500.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	184,000	7.20	1,324,800.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	454,000	17.10	7,763,400.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	248,000	20.20	5,009,600.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	199,890	7.95	1,589,125.50
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	86,000	11.40	980,400.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	167,000	28.90	4,826,300.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	87,200	129.80	11,318,560.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	204,000	4.21	858,840.00
LI NING CO LTD	174,000	80.40	13,989,600.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	63,700	146.30	9,319,310.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD.	74,000	20.15	1,491,100.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS	57,000	20.45	1,165,650.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	70,800	16.90	1,196,520.00
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	1,170,480	122.50	143,383,800.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	192,000	2.11	405,120.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	33,700	62.20	2,096,140.00
JD.COM, INC.	155,167	297.20	46,115,632.40
MEITUAN-CLASS B	315,200	219.40	69,154,880.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LIMITED	42,000	38.60	1,621,200.00
GOME RETAIL HODINGS LTD	1,100,360	0.65	715,234.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	112,000	8.44	945,280.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	43,000	57.65	2,478,950.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	149,000	3.64	542,360.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	7,000	115.00	805,000.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	111,333	63.55	7,075,212.15
NONGFU SPRING LTD	139,400	47.00	6,551,800.00
TSING TAO BREWERY CO-H	42,000	77.85	3,269,700.00
	292,000	11.38	3,322,960.00

CHINA FEIHE LTD			
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.00	0.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	244,000	48.85	11,919,400.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	4.32	481,680.00
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	168,000	17.68	2,970,240.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	125,000	8.36	1,045,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	349,000	7.76	2,708,240.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	31,000	38.00	1,178,000.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	133,000	35.45	4,714,850.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	23,000	21.50	494,500.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	44,500	40.70	1,811,150.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	47,000	23.50	1,104,500.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	180,000	10.18	1,832,400.00
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC	15,000	25.10	376,500.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO	25,200	41.10	1,035,720.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	86,000	8.38	720,680.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	36,600	25.35	927,810.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	15.14	770,626.00
SINOPHARM GROUP CO-H	96,400	19.58	1,887,512.00
3SBIO, INC	77,000	6.59	507,430.00
AKESO INC	20,000	20.40	408,000.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	84,000	33.50	2,814,000.00
CANSINO BIOLOGICS INC	5,800	127.10	737,180.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	98,000	13.78	1,350,440.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	248,000	4.50	1,116,000.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	707,520	9.59	6,785,116.80
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	84,000	17.28	1,451,520.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	34,500	31.20	1,076,400.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	868,500	5.49	4,768,065.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,160,000	3.07	6,631,200.00
BANK OF CHINA LTD-H	6,120,000	3.15	19,278,000.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	745,790	5.48	4,086,929.20
CHINA BOHAI BANK CO LTD	160,000	1.80	288,000.00

CHINA CITIC BANK-H	640,000	3.80	2,432,000.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	7,414,000	6.00	44,484,000.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	257,000	3.00	771,000.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	301,192	68.35	20,586,473.20
CHINA MINSHENG BANKING-H	374,800	3.18	1,191,864.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,350,000	4.76	20,706,000.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	681,000	6.52	4,440,120.00
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	7.07	1,088,780.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	582,000	13.98	8,136,360.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	198,000	24.50	4,851,000.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	10.92	1,129,914.24
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	59,100	23.85	1,409,535.00
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	587,000	2.60	1,526,200.00
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	550,420	8.39	4,618,023.80
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	488,000	66.55	32,476,400.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	35,800	30.80	1,102,640.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LIMITED	194,000	8.00	1,552,000.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	66,000	16.10	1,062,600.00
CHINA YOUZAN LIMITED	888,000	0.29	261,960.00
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	219,000	19.64	4,301,160.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS	57,000	17.50	997,500.00
WEIMOB INC	125,000	6.44	805,000.00
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	51,500	24.25	1,248,875.00
ZTE CORP-H	76,052	20.20	1,536,250.40
LENOVO GROUP LTD	604,000	8.67	5,236,680.00
XIAOMI CORPORATION	1,102,000	16.60	18,293,200.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	52,000	23.70	1,232,400.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	60,000	39.80	2,388,000.00
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	65,000	14.00	910,000.00
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	54,700	192.60	10,535,220.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD	28,000	30.10	842,800.00
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	46,000	38.90	1,789,400.00
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	398,000	14.36	5,715,280.00

CHINA TOWER CORP LTD	3,610,000	0.98	3,537,800.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	28.00	1,008,000.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	247,000	13.66	3,374,020.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	68,000	39.70	2,699,600.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	61,500	127.10	7,816,650.00
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	316,000	7.88	2,490,080.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	405,000	3.12	1,263,600.00
GUANGDONG INVESTMENT	240,000	10.78	2,587,200.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	1.47	911,400.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	4.67	1,242,220.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H	102,800	20.45	2,102,260.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	197,000	19.68	3,876,960.00
CITIC SECURITIES CO LTD-RTS	29,550	1.86	54,963.00
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	12.74	1,052,324.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	173,600	7.08	1,229,088.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	102,000	13.46	1,372,920.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS	65,000	7.98	518,700.00
CHINA YUHUA EDUCATION CO.LTD	108,000	2.17	234,360.00
CGN POWER CO LTD-H	980,000	2.25	2,205,000.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	284,000	15.86	4,504,240.00
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	490,000	3.78	1,852,200.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	150,000	16.16	2,424,000.00
HUANENG POWER INTL INC-H	238,000	4.09	973,420.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	290,000	6.04	1,751,600.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	98,000	27.95	2,739,100.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	8,000	83.35	666,800.00
PHARMARON BEIJING CO LTD	9,600	92.60	888,960.00
WUXI APPTec CO LTD	30,500	104.60	3,190,300.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	278,000	61.10	16,985,800.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	55,000	16.30	896,500.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	94,000	4.24	398,560.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	410,000	2.98	1,221,800.00

	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	286,000	24.45	6,992,700.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	85,000	9.04	768,400.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	248,444	39.30	9,763,849.20	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	52,200	45.50	2,375,100.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	128,000	19.94	2,552,320.00	
	CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	46,000	15.32	704,720.00	
	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	247,800	5.80	1,437,240.00	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	574,380	6.52	3,744,957.60	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	147,000	50.45	7,416,150.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	56,000	12.12	678,720.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO.LTD.	128,000	8.60	1,100,800.00	
	GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	143,200	3.91	559,912.00	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	52,800	16.38	864,864.00	
	KWG GROUP HOLDINGS LTD	92,000	4.35	400,200.00	
	LOGAN GROUP CO LTD	128,000	3.93	503,040.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	135,000	45.25	6,108,750.00	
	POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	101,000	4.46	450,460.00	
	SEAZEN GROUP LTD	168,000	5.19	871,920.00	
	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	103,000	5.84	601,520.00	
	SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	41,000	7.04	288,640.00	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	190,000	9.45	1,795,500.00	
	SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	43,000	9.10	391,300.00	
	WHARF(HOLDING)	117,000	27.50	3,217,500.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	100,000	8.25	825,000.00	
	CHINA LITERATURE LTD	28,400	46.20	1,312,080.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	870,000	0.82	713,400.00	
	KINGSOFT CORP LTD	67,000	34.10	2,284,700.00	
	NETEASE, INC.	155,250	157.70	24,482,925.00	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	39,800	95.60	3,804,880.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	444,100	476.20	211,480,420.00	
	小計銘柄数：211			1,136,286,421.01	
				(16,817,039,030)	
	組入時価比率：22.8%			24.9%	
リング	DIALOG GROUP BHD	313,044	2.81	879,653.64	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	30,000	21.00	630,000.00	

PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	190,000	9.30	1,767,000.00
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	248,000	7.00	1,736,000.00
HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	7.75	261,950.00
SIME DARBY BERHAD	220,000	2.26	497,200.00
MISC BHD	99,960	6.99	698,720.40
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	56,460	6.40	361,344.00
WESTPORTS HOLDINGS BHD	51,400	3.96	203,544.00
GENTING BHD	187,000	4.65	869,550.00
GENTING MALAYSIA BHD	229,000	2.93	670,970.00
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	7,700	23.84	183,568.00
IOI CORP	162,000	4.34	703,080.00
KUALA LUMPUR KEPONG	26,400	25.60	675,840.00
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	4,400	134.50	591,800.00
PPB GROUP BERHAD	51,740	17.04	881,649.60
QL RESOURCES BHD	60,000	4.90	294,000.00
SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	4.64	669,552.00
HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,000	5.03	588,510.00
TOP GLOVE CORP BHD	428,000	2.10	898,800.00
IHH HEALTHCARE BHD	156,000	6.58	1,026,480.00
AMMB HOLDING	125,000	3.40	425,000.00
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	508,000	5.65	2,870,200.00
HONG LEONG BANK	60,960	20.20	1,231,392.00
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	19.50	261,729.00
MALAYAN BANKING	379,000	8.69	3,293,510.00
PUBLIC BANK BHD	1,177,000	4.41	5,190,570.00
RHB BANK BHD	125,023	5.79	723,883.17
INARI AMERTRON BHD	271,000	3.30	894,300.00
TELEKOM MALAYSIA	62,000	5.48	339,760.00
AXIATA GROUP BERHAD	195,000	3.90	760,500.00
DIGI.COM BERHAD	286,000	4.20	1,201,200.00
MAXIS BHD	146,200	4.52	660,824.00
TENAGA NASIONAL	182,000	9.10	1,656,200.00
PETRONAS GAS BERHAD	63,000	17.22	1,084,860.00
小計銘柄数：35			35,683,139.81 (985,018,801)

	組入時価比率：1.3%			1.5%
パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	113,000	133.00	15,029,000.00
	PTT PCL-NVDR	764,000	40.25	30,751,000.00
	THAI OIL PCL-NVDR	83,000	52.75	4,378,250.00
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	110,967	51.25	5,687,058.75
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	151,994	56.50	8,587,661.00
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	58,700	388.00	22,775,600.00
	SCG PACKAGING PLC-NVDR	89,700	62.75	5,628,675.00
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	476,000	9.35	4,450,600.00
	AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	361,000	64.50	23,284,500.00
	BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	447,100	8.70	3,889,770.00
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	700,000	4.96	3,472,000.00
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	270,978	32.25	8,739,040.50
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	155,025	38.75	6,007,218.75
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	354,597	14.90	5,283,495.30
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	258,000	25.50	6,579,000.00
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	32.50	2,395,250.00
	CP ALL PCL-NVDR	482,000	64.50	31,089,000.00
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	20,900	100.00	2,090,000.00
	OSOTSPA PCL-NVDR	112,000	33.50	3,752,000.00
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	279,000	25.50	7,114,500.00
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	199,800	21.00	4,195,800.00
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	56,000	29.25	1,638,000.00
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	782,000	23.10	18,064,200.00
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,200	154.50	4,974,900.00
	KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	14.40	3,845,520.00
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	50,800	134.50	6,832,600.00
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	26,300	418.00	10,993,400.00
	TRUE CORP PCL-NVDR	920,000	4.98	4,581,600.00
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	85,700	237.00	20,310,900.00
	INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR	140,000	78.00	10,920,000.00
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	68,000	66.50	4,522,000.00
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	54.50	2,670,500.00
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	63,000	60.75	3,827,250.00	
BANGKOK COMMERCIAL ASSET-NVDR	154,000	21.60	3,326,400.00	

	B GRIMM POWER PCL-NVDR	34,000	33.50	1,139,000.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	17,300	176.50	3,053,450.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	134,000	95.50	12,797,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	59,000	75.50	4,454,500.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	261,000	51.50	13,441,500.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	43,000	45.75	1,967,250.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	185,000	56.75	10,498,750.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	620,000	9.75	6,045,000.00	
小計	銘柄数：42			355,083,139.30	
				(1,271,197,638)	
	組入時価比率：1.7%			1.9%	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	63.00	9,198,000.00	
	AYALA CORPORATION	21,102	860.00	18,147,720.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,465	577.00	3,153,305.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	255,005	61.20	15,606,306.00	
	SM INVESTMENTS CORP	17,100	937.00	16,022,700.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	93,000	217.80	20,255,400.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	43,000	251.00	10,793,000.00	
	MONDE NISSIN CORP	330,000	16.92	5,583,600.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	67,000	127.80	8,562,600.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	145,999	100.00	14,599,900.00	
	BDO UNIBANK INC	168,998	136.00	22,983,728.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	127,695	59.70	7,623,391.50	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	3.69	2,759,382.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,070	2,790.00	5,775,300.00	
	PLDT INC	4,970	1,810.00	8,995,700.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	361.00	6,100,900.00	
	AC ENERGY CORP	570,000	8.80	5,016,000.00	
	AYALA LAND LTD	608,000	38.90	23,651,200.00	
	SM PRIME HLDGS	773,975	38.50	29,798,037.50	
小計	銘柄数：19			234,626,170.00	
				(528,166,971)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	
ルピア	ADARO ENERGY PT	839,200	2,240.00	1,879,808,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	147,050	23,800.00	3,499,790,000.00	

	BARITO PACIFIC TBK PT	1,660,000	1,015.00	1,684,900,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	127,000	10,975.00	1,393,825,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	176,000	7,400.00	1,302,400,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	760,000	1,880.00	1,428,800,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,060,000	3,800.00	4,028,000,000.00	
	INDAH KIAT PULP&PAPER	240,000	7,750.00	1,860,000,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,660,000	5,475.00	9,088,500,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	178,000	8,500.00	1,513,000,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	420,000	6,300.00	2,646,000,000.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	700,000	5,800.00	4,060,000,000.00	
	GUDANG GARAM TBK	29,200	31,000.00	905,200,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	523,500	3,870.00	2,025,945,000.00	
	KALBE FARMA PT	1,540,000	1,620.00	2,494,800,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	4,380,000	7,975.00	34,930,500,000.00	
	BANK MANDIRI	1,330,000	7,850.00	10,440,500,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	499,000	7,950.00	3,967,050,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,055,828	4,420.00	22,346,759,760.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,479,000	1,040.00	1,538,160,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,800,000	4,400.00	16,720,000,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	553,000	2,910.00	1,609,230,000.00	
小計	銘柄数：22			131,363,167,760.00	
				(1,064,041,658)	
	組入時価比率：1.4%			1.6%	
ウォン	GS HOLDINGS CORP	3,600	41,050.00	147,780,000.00	
	S-OIL CORPORATION	3,930	84,900.00	333,657,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,942	203,500.00	802,197,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	10,300	33,750.00	347,625,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	1,490	152,500.00	227,225,000.00	
	LG CHEM LTD - PREFERRED	630	309,000.00	194,670,000.00	
	LG CHEMICALS LTD	3,538	653,000.00	2,310,314,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,610	216,500.00	348,565,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	900	130,000.00	117,000,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,060	117,500.00	124,550,000.00	
	SKC CO LTD	1,450	134,000.00	194,300,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	2,241	114,500.00	256,594,500.00	

HYUNDAI STEEL CO	7,399	39,450.00	291,890,550.00	
KOREA ZINC CO LTD	592	529,000.00	313,168,000.00	
POSCO	5,710	280,500.00	1,601,655,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	4,520	34,800.00	157,296,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,220	38,900.00	164,158,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	6,900	41,800.00	288,420,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	14,400	23,100.00	332,640,000.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	25,920	16,350.00	423,792,000.00	
ECOPRO BM CO LTD	810	342,600.00	277,506,000.00	
LG ENERGY SOLUTION	1,620	455,500.00	737,910,000.00	
CJ CORP	1,100	82,500.00	90,750,000.00	
LG CORP	6,554	76,300.00	500,070,200.00	
SAMSUNG C&T CORP	6,720	109,500.00	735,840,000.00	
SK INC	3,370	223,000.00	751,510,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	3,350	37,500.00	125,625,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	2,985	49,350.00	147,309,750.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	3,210	82,500.00	264,825,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	40,863	5,440.00	222,294,720.00	
S-1 CORPORATION	1,450	69,000.00	100,050,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,810	171,000.00	309,510,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	12,600	30,000.00	378,000,000.00	
HMM COMPANY LIMITED	20,600	25,250.00	520,150,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	14,890	6,100.00	90,829,000.00	
CJ LOGISTICS	780	123,500.00	96,330,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	5,320	36,450.00	193,914,000.00	
HANON SYSTEMS	11,650	11,500.00	133,975,000.00	
HYUNDAI MOBIS	4,950	230,500.00	1,140,975,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	10,710	182,000.00	1,949,220,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,640	95,800.00	252,912,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	95,000.00	139,650,000.00	
KIA CORP	20,260	79,500.00	1,610,670,000.00	
COWAY CO LTD	4,970	71,600.00	355,852,000.00	
LG ELECTRONICS INC	8,280	123,000.00	1,018,440,000.00	
HLB INC	7,400	30,850.00	228,290,000.00	

F&F CO LTD / NEW	320	863,000.00	276,160,000.00
KANGWON LAND INC	7,900	26,450.00	208,955,000.00
CJ ENM CO LTD	657	126,800.00	83,307,600.00
LOTTE SHOPPING CO	800	85,600.00	68,480,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	1,960	80,600.00	157,976,000.00
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	164,000.00	79,540,000.00
E-MART CO	1,181	129,500.00	152,939,500.00
CJ CHEILJEDANG CORP	510	369,500.00	188,445,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,800	102,000.00	183,600,000.00
KT & G CORP	9,410	79,900.00	751,859,000.00
AMOREPACIFIC CORP	2,460	181,000.00	445,260,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	45,900.00	69,768,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	670	975,000.00	653,250,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	556,000.00	57,824,000.00
SD BIOSENSOR INC	3,500	56,600.00	198,100,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	7,570	61,900.00	468,583,000.00
ALTEOGEN INC	2,130	51,400.00	109,482,000.00
CELLTRION INC	7,940	158,000.00	1,254,520,000.00
GREEN CROSS CORP	410	191,500.00	78,515,000.00
SEEGENE, INC.	2,720	50,300.00	136,816,000.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	1,950	150,000.00	292,500,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,081	86,400.00	93,398,400.00
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	499	259,500.00	129,490,500.00
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,330	25,000.00	58,250,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,770	79,000.00	139,830,000.00
YUHAN CORPORATION	3,991	57,200.00	228,285,200.00
HANA FINANCIAL HOLDINGS	23,700	50,600.00	1,199,220,000.00
INDUSTRIAL BK OF KOREA	26,100	11,050.00	288,405,000.00
KAKAOBANK CORP	7,000	46,450.00	325,150,000.00
KB FINANCIAL GROUP INC	30,700	64,600.00	1,983,220,000.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP	35,600	41,100.00	1,463,160,000.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	42,300	14,650.00	619,695,000.00
DB INSURANCE CO LTD	2,850	62,000.00	176,700,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	2,510	213,500.00	535,885,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,640	63,800.00	296,032,000.00

	SAMSUNG SDS CO LTD	2,570	137,000.00	352,090,000.00	
	DUZONBIZON CO., LTD.	1,240	51,700.00	64,108,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS	368,210	74,800.00	27,542,108,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	63,400	67,500.00	4,279,500,000.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	2,150	93,500.00	201,025,000.00	
	L&F CO LTD	1,660	189,900.00	315,234,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,260	317,000.00	399,420,000.00	
	LG.DISPLAY CO LTD	16,200	19,450.00	315,090,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	4,070	167,000.00	679,690,000.00	
	SAMSUNG SDI CO,LTD	4,241	540,000.00	2,290,140,000.00	
	SK HYNIX INC	42,100	130,500.00	5,494,050,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	1,629	54,700.00	89,106,300.00	
	LG UPLUS CORP	13,300	13,400.00	178,220,000.00	
	SK TELECOM CO LTD	2,520	55,300.00	139,356,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER	19,600	22,400.00	439,040,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,140	78,300.00	245,862,000.00	
	MERITZ SECURITIES	24,500	6,130.00	150,185,000.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	24,737	8,950.00	221,396,150.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	11,800.00	91,214,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES	3,565	42,200.00	150,443,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,309	757,000.00	990,913,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,900	23,000.00	135,700,000.00	
	HYBE CO LTD	1,220	256,500.00	312,930,000.00	
	KAKAO GAMES CORP	2,810	71,700.00	201,477,000.00	
	KRAFTON INC	1,630	277,500.00	452,325,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,296	492,500.00	638,280,000.00	
	NETMARBLE CORP	1,470	102,000.00	149,940,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	2,860	101,000.00	288,860,000.00	
	KAKAO CORP	24,000	91,900.00	2,205,600,000.00	
	NAVER CORP	9,500	324,500.00	3,082,750,000.00	
小計	銘柄数：111			86,898,558,370.00	
				(8,403,090,594)	
	組入時価比率：11.4%			12.4%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	88,360	98.60	8,712,296.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	289,998	80.60	23,373,838.80	

FORMOSA PLASTIC	309,424	106.50	32,953,656.00
NAN YA PLASTICS CORP	399,726	88.80	35,495,668.80
ASIA CEMENT	152,980	45.40	6,945,292.00
TAIWAN CEMENT	395,294	47.00	18,578,818.00
CHINA STEEL	914,544	35.45	32,420,584.80
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	5,000	1,380.00	6,900,000.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	234,454	29.60	6,939,838.40
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	10,464	942.00	9,857,088.00
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	18,591	276.00	5,131,116.00
EVERGREEN MARINE	202,375	133.50	27,017,062.50
WAN HAI LINES LIMITED	42,900	183.50	7,872,150.00
YANG MING MARINE TRANSPORT	143,000	112.50	16,087,500.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	143,000	29.05	4,154,150.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	142,036	35.60	5,056,481.60
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	378.50	3,785,000.00
GIANT MANUFACTURING	18,752	301.50	5,653,728.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	14,443	594.00	8,579,142.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,815	224.50	7,366,967.50
POU CHEN CORP	175,468	32.60	5,720,256.80
MOMO.COM INC	3,000	1,115.00	3,345,000.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	23,000	634.00	14,582,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	42,816	265.50	11,367,648.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	378,836	68.40	25,912,382.40
ONENESS BIOTECH CO LTD	22,000	259.00	5,698,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	359,013	17.95	6,444,283.35
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,400,212	28.20	39,485,978.40
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	979,063	30.65	30,008,280.95
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	769,943	26.35	20,287,998.05
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	686,374	22.90	15,717,964.60
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	858,380	38.20	32,790,116.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	759,549	17.40	13,216,152.60
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	871,051	20.20	17,595,230.20
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	743,020	27.40	20,358,748.00
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	291,574	48.10	14,024,709.40

CHAILEASE HOLDING CO LTD	96,571	269.00	25,977,599.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	759,152	25.35	19,244,503.20
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	586,035	64.80	37,975,068.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	1,269,789	19.30	24,506,927.70
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	587,775	77.80	45,728,895.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	1,030,113	11.35	11,691,782.55
ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION	36,000	274.00	9,864,000.00
ACER INC	256,767	28.90	7,420,566.30
ADVANTECH CO.,LTD.	26,750	392.00	10,486,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	53,805	369.00	19,854,045.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	45,840	153.50	7,036,440.00
COMPAL ELECTRONICS	354,590	25.35	8,988,856.50
INVENTEC CO.,LTD	251,911	25.70	6,474,112.70
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	145,897	67.90	9,906,406.30
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	52,000	157.00	8,164,000.00
PEGATRON CORP	159,692	69.80	11,146,501.60
QUANTA COMPUTER INC	224,684	93.40	20,985,485.60
WISTRON CORP	212,457	30.40	6,458,692.80
WIWYNN CORP	5,000	1,045.00	5,225,000.00
AU OPTRONICS CORP	572,008	20.45	11,697,563.60
DELTA ELECTRONICS INC	149,681	258.50	38,692,538.50
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,834	62.90	3,449,058.60
HON HAI PRECISION INDUSTRY	961,649	105.50	101,453,969.50
INNOLUX CORP	660,322	16.80	11,093,409.60
LARGAN PRECISION CO LTD	8,040	2,120.00	17,044,800.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORPORATION	16,000	528.00	8,448,000.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	122,566	69.50	8,518,337.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	100,000	233.50	23,350,000.00
WPG HOLDINGS CO LTD	120,387	56.00	6,741,672.00
YAGEO CORPORATION	34,377	472.50	16,243,132.50
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	64,410	93.40	6,015,894.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	248,658	102.50	25,487,445.00
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,795.00	3,590,000.00
EMEMORY TECHNOLOGY INC	5,000	1,810.00	9,050,000.00

	GLOBALWAFERS CO LTD	17,000	722.00	12,274,000.00	
	MEDIATEK INC	115,538	1,130.00	130,557,940.00	
	NANYA TECHNOLOGY CO	100,000	80.50	8,050,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	43,058	456.00	19,634,448.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	6,000	2,070.00	12,420,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	35,417	503.00	17,814,751.00	
	SILERGY CORP	6,000	3,805.00	22,830,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,899,000	646.00	1,226,754,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	904,500	54.10	48,933,450.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	69,000	129.50	8,935,500.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	24,000	316.00	7,584,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	33.85	8,191,700.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	287,065	121.00	34,734,865.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	105,000	67.50	7,087,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	128,200	105.00	13,461,000.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	113,112	67.80	7,668,993.60	
小計	銘柄数：86			2,724,377,977.30	
				(11,289,005,024)	
	組入時価比率：15.3%			16.7%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	70,000	374.10	26,187,000.00	
	COAL INDIA LTD	142,000	163.85	23,266,700.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	34,380	304.65	10,473,867.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	113,000	121.50	13,729,500.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	219,000	168.55	36,912,450.00	
	PETRONET LNG LTD	34,980	218.00	7,625,640.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	219,900	2,412.95	530,607,705.00	
	ASIAN PAINTS LTD	29,800	3,252.85	96,934,930.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	19,000	723.80	13,752,200.00	
	PI INDUSTRIES LTD	7,000	2,596.40	18,174,800.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,400	2,422.70	30,041,480.00	
	SRF LTD	11,000	2,462.65	27,089,150.00	
	UPL LTD	43,200	735.80	31,786,560.00	
	ACC LIMITED	6,000	2,239.40	13,436,400.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	57,000	360.70	20,559,900.00	
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	17,700	1,721.30	30,467,010.00	

SHREE CEMENT LIMITED	880	24,916.35	21,926,388.00
ULTRATECH CEMENT LTD	8,130	7,178.90	58,364,457.00
HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	117,000	529.30	61,928,100.00
JSW STEEL LTD	66,000	638.00	42,108,000.00
TATA STEEL LIMITED	56,200	1,191.80	66,979,160.00
VEDANTA LTD	82,000	367.10	30,102,200.00
BHARAT ELECTRONICS LTD	84,800	199.00	16,875,200.00
LARSEN&TOUBRO LIMITED	53,700	1,860.70	99,919,590.00
HAVELLS INDIA LTD	17,700	1,206.40	21,353,280.00
SIEMENS LIMITED	7,000	2,394.30	16,760,100.00
ADANI ENTERPRISES LTD	19,100	1,738.10	33,197,710.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,200	825.00	18,315,000.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	9,400	2,170.95	20,406,930.00
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,380	600.95	7,439,761.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,600	740.75	31,555,950.00
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,000	2,002.90	14,020,300.00
BHARAT FORGE LIMITED	12,700	722.05	9,170,035.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	106,000	169.00	17,914,000.00
MOTHERSON SUMI WIRING INDIA	106,000	46.33	4,911,448.05
MRF LTD	200	66,140.60	13,228,120.00
BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	3,586.90	20,050,771.00
EICHER MOTORS LTD	11,600	2,706.45	31,394,820.00
HERO MOTOCORP LTD	9,300	2,786.80	25,917,240.00
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	62,200	864.25	53,756,350.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	10,980	8,582.95	94,240,791.00
TATA MOTORS LTD	134,000	498.45	66,792,300.00
PAGE INDUSTRIES LTD	340	41,271.35	14,032,259.00
TITAN CO LTD	26,900	2,488.05	66,928,545.00
JUBILANT FOODWORKS LIMITED	7,200	3,060.15	22,033,080.00
ZOMATO LTD	143,000	84.95	12,147,850.00
TRENT LTD	15,000	1,061.50	15,922,500.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,500	4,051.15	46,588,225.00
UNITED SPIRITS LTD	22,600	849.75	19,204,350.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	7,600	3,462.00	26,311,200.00
NESTLE INDIA LIMITED	2,360	18,223.80	43,008,168.00

TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	45,300	701.00	31,755,300.00	
ITC LTD	221,100	222.75	49,250,025.00	
COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)	10,200	1,428.40	14,569,680.00	
DABUR INDIA LTD	45,900	561.85	25,788,915.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,200	830.25	22,582,800.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	65,100	2,286.50	148,851,150.00	
MARICO LIMITED	46,000	500.20	23,009,200.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	7,000	4,584.80	32,093,600.00	
BIOCON LTD	31,000	401.85	12,457,350.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	690.10	12,904,870.00	
CIPLA LIMITED	34,500	933.10	32,191,950.00	
DR.REDDYS LABORATORIES	9,140	4,316.45	39,452,353.00	
LUPIN LTD	14,900	777.40	11,583,260.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	61,700	868.85	53,608,045.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,270	2,626.95	8,590,126.50	
AXIS BANK LIMITED	176,200	797.05	140,440,210.00	
BANDHAN BANK LTD	56,000	323.00	18,088,000.00	
ICICI BANK LTD	395,400	764.05	302,105,370.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	43,500	1,830.05	79,607,175.00	
YES BANK LTD	839,000	13.55	11,368,450.00	
BAJAJ FINSERV LTD	3,160	16,272.45	51,420,942.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,927	2,270.30	17,996,668.10	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	76,300	586.35	44,738,505.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY	16,000	1,287.10	20,593,600.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	33,200	502.75	16,691,300.00	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	36,500	1,122.15	40,958,475.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	84,900	1,167.80	99,146,220.00	
INFOSYS LTD	262,700	1,733.30	455,337,910.00	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	4,000	6,002.90	24,011,600.00	
MINDTREE LIMITED	4,880	3,892.20	18,993,936.00	
MPHASIS LTD	6,200	2,988.95	18,531,490.00	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	71,300	3,813.10	271,874,030.00	
TECH MAHINDRA LTD	49,700	1,444.00	71,766,800.00	
WIPRO LTD	106,000	563.90	59,773,400.00	

	INDUS TOWERS LTD	61,000	259.20	15,811,200.00	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	191,500	721.80	138,224,700.00	
	ADANI TRANSMISSION LTD	19,100	1,932.55	36,911,705.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	261,966	196.30	51,423,925.80	
	TATA POWER COMPANY LIMITED	106,000	231.35	24,523,100.00	
	ADANI TOTAL GAS LTD	19,000	1,686.35	32,040,650.00	
	GAIL INDIA LTD	94,600	139.35	13,182,510.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	13,500	386.80	5,221,800.00	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	132,300	2,363.85	312,737,355.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	20,940	7,068.60	148,016,484.00	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	28,600	669.75	19,154,850.00	
	MUTHOOT FINANCE LTD	10,000	1,356.00	13,560,000.00	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	13,100	836.40	10,956,840.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	15,700	1,220.60	19,163,420.00	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,800	2,205.60	10,586,880.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	28,000	1,931.75	54,089,000.00	
	NTPC LIMITED	396,000	133.20	52,747,200.00	
	DIVIS LABORATORIES LTD	9,700	4,465.15	43,311,955.00	
	DLF LIMITED	58,000	367.85	21,335,300.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	9,300	1,586.90	14,758,170.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	6,670	4,580.15	30,549,600.50	
	小計銘柄数：106			5,446,288,820.95	
				(8,441,747,672)	
				組入時価比率：11.4%	12.4%
カタールリヤル	QATAR FUEL CO	34,700	19.59	679,773.00	
	QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	220,000	3.53	776,600.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING	305,000	2.78	850,035.00	
	INDUSTRIES QATAR	143,000	17.96	2,568,280.00	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	117,900	6.97	822,116.70	
	MASRAF AL RAYAN	381,000	4.96	1,889,760.00	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	47,000	10.44	490,680.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	83,900	20.23	1,697,297.00	
	QATAR NATIONAL BANK	347,000	20.99	7,283,530.00	
	OOREDOO QSC	43,100	7.58	326,698.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	34,400	18.00	619,200.00	

	BARWA REAL ESTATE CO	113,000	3.49	395,048.00	
小計	銘柄数：12			18,399,017.70	
				(583,800,831)	
	組入時価比率：0.8%			0.9%	
エジプト債券	EASTERN TOBACCO	51,525	10.50	541,012.50	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	121,733	51.50	6,269,249.50	
	FAWRY FOR BANKING & PAYMENT	37,000	9.20	340,400.00	
小計	銘柄数：3			7,150,662.00	
				(52,530,908)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	15,000	195.80	2,937,000.00	
	SASOL LTD	43,800	338.81	14,839,878.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,000	256.96	1,798,720.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,110	1,910.00	7,850,100.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	31,000	327.97	10,167,070.00	
	GOLD FIELDS LTD	71,600	180.13	12,897,308.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	40,800	55.82	2,277,456.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	65,200	237.35	15,475,220.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,900	678.49	2,646,111.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	26,700	213.77	5,707,659.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	205,000	60.50	12,402,500.00	
	BIDVEST GROUP LTD	25,500	210.29	5,362,395.00	
	NASPERS LTD-N SHS	16,790	2,268.06	38,080,727.40	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	94,000	54.20	5,094,800.00	
	MR PRICE GROUP LTD	16,700	219.44	3,664,648.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	96,000	23.58	2,263,680.00	
	BID CORP LTD	27,300	339.82	9,277,086.00	
	CLICKS GROUP LTD	18,300	302.29	5,531,907.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	39,600	228.35	9,042,660.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	15,300	178.79	2,735,487.00	
	TIGER BRANDS LTD	12,800	174.64	2,235,392.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	31,500	205.31	6,467,265.00	
	ABSA GROUP LTD	55,200	181.05	9,993,960.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	6,490	2,087.16	13,545,668.40	
	NEDBANK GROUP LTD	35,779	217.40	7,778,354.60	
	STANDARD BANK GROUP LTD	105,800	164.89	17,445,362.00	

	FIRSTRAND LTD	377,000	67.54	25,462,580.00	
	REMGRO LTD	47,300	141.90	6,711,870.00	
	DISCOVERY LTD	38,500	166.46	6,408,710.00	
	OLD MUTUAL LTD	294,000	14.10	4,145,400.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	40,350	50.65	2,043,727.50	
	SANLAM LIMITED	149,000	67.02	9,985,980.00	
	MTN GROUP LTD	133,000	186.42	24,793,860.00	
	VODACOM GROUP	51,700	149.68	7,738,456.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	8,790	323.79	2,846,114.10	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	26,281	107.91	2,835,982.71	
	MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	130.45	3,477,797.00	
小計	銘柄数：37			323,968,891.71	
				(2,491,320,777)	
	組入時価比率：3.4%			3.7%	
UAE	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	179,000	4.12	737,480.00	
ディール	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	237,870	10.26	2,440,546.20	
ム	ABU DHABI ISLAMIC BANK	128,000	7.90	1,011,200.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	214,029	5.90	1,262,771.10	
	EMIRATES NBD PJSC	197,000	14.00	2,758,000.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	336,000	21.10	7,089,600.00	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	274,900	33.16	9,115,684.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	277,000	4.26	1,180,020.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	290,000	5.05	1,464,500.00	
小計	銘柄数：9			27,059,801.30	
				(849,407,162)	
	組入時価比率：1.2%			1.3%	
クウェート	AGILITY	79,200	1.02	81,417.60	
ディ	BOUBYAN BANK K.S.C	71,400	0.81	58,048.20	
ナル	KUWAIT FINANCE HOUSE	343,200	0.91	313,684.80	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	529,000	1.04	554,392.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	189,000	0.62	118,692.00	
	MABANEE CO SAKC	38,160	0.81	31,062.24	
小計	銘柄数：6			1,157,296.84	

				(442,527,165)	
	組入時価比率：0.6%			0.7%	
サウジアラビア リヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	9,600	23.84	228,864.00	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	169,000	37.75	6,379,750.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,020	75.40	680,108.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	28,000	22.34	625,520.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	16,600	166.00	2,755,600.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	29,300	42.95	1,258,435.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	71,100	122.40	8,702,640.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	18,700	34.30	641,410.00	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	47,000	19.70	925,900.00	
	SAUDI NATIONAL PETROCHEMICAL COMPANY	8,400	43.50	365,400.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	19,900	67.40	1,341,260.00	
	SAUDI CEMENT	6,400	58.10	371,840.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	35,100	95.70	3,359,070.00	
	JARIR MARKETING CO	3,730	206.00	768,380.00	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,700	111.60	412,920.00	
	ALMARAI CO	18,000	50.80	914,400.00	
	SAVOLA	16,600	33.25	551,950.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	5,100	175.00	892,500.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,400	206.00	700,400.00	
	AL RAJHI BANK	92,700	159.40	14,776,380.00	
	ALINMA BANK	81,000	31.95	2,587,950.00	
	ARAB NATIONAL BANK	47,800	29.30	1,400,540.00	
	BANK AL - JAZIRA	34,100	26.65	908,765.00	
	BANK ALBILAD	32,000	59.10	1,891,200.00	
	BANQUE SAUDI FRANSI	49,200	52.30	2,573,160.00	
	RIYAD BANK	97,500	35.15	3,427,125.00	
	SAUDI BRITISH BANK	61,100	39.65	2,422,615.00	
THE SAUDI NATIONAL BANK	172,100	73.00	12,563,300.00		
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	3,900	170.00	663,000.00		
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,700	81.80	220,860.00		
SAUDI TELECOM CO	48,100	118.60	5,704,660.00		
ETIHAD ETISALAT CO	23,900	34.70	829,330.00		

	MOBILE TELECOMMUNICATIONS COMPANY	29,000	14.00	406,000.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	58,200	26.60	1,548,120.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	53,000	10.42	552,260.00	
	EMAAR ECONOMIC CITY	35,000	12.28	429,800.00	
	小計 銘柄数：36			84,781,412.00	
				(2,613,810,931)	
	組入時価比率：3.5%			3.9%	
	合計			67,293,595,174	
				(67,293,595,174)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(2022年2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	4,261,400	25,717,549.00	
	小計	銘柄数：1	4,261,400	25,717,549.00	
		組入時価比率：4.0%		(2,969,862,558)	97.9%
	合計			2,969,862,558	(2,969,862,558)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	234,000	5,400,720.00	
	小計	銘柄数：1	234,000	5,400,720.00	
		組入時価比率：0.0%		(30,743,058)	1.0%
	ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	300,000	4,428,000.00	
	小計	銘柄数：1	300,000	4,428,000.00	
		組入時価比率：0.0%		(34,051,320)	1.1%
	合計			64,794,378	(64,794,378)
	合計			3,034,656,936	(3,034,656,936)

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年 2月17日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	3,398,366,226	-	3,457,077,990	58,711,764
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	115,672,950	-	115,474,600	198,350
米ドル	115,672,950	-	115,474,600	198,350
合計	-	-	-	58,513,414

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	109,673,763
コール・ローン	108,389,090
国債証券	24,863,288,864
派生商品評価勘定	136,880
未収入金	117,573,075
未収利息	281,780,792
前払費用	13,166,996
流動資産合計	25,494,009,460
資産合計	
25,494,009,460	
負債の部	
流動負債	
未払金	41,792,212
未払解約金	187,275,928
未払利息	73
その他未払費用	43,800
流動負債合計	229,112,013
負債合計	
229,112,013	
純資産の部	
元本等	
元本	12,405,234,030
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	12,859,663,417
元本等合計	25,264,897,447
純資産合計	
25,264,897,447	
負債純資産合計	
25,494,009,460	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 2月17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	2.0366円
(10,000口当たり純資産額)	(20,366円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月17日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>国債証券</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており</p> <p>ます。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 2月17日現在	
期首	2021年 2月18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	10,970,246,851円
同期中における追加設定元本額	5,429,315,651円
同期中における一部解約元本額	3,994,328,472円
期末元本額	12,405,234,030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 ネクストコア	569,910,892円 3,868,063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	937,294,522円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,881,641円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,739,231円
インデックス・ブレンド(タイプ)	11,768,567円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,238,592円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,777,304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)	918,512,474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)	1,434,898,431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 ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	967,663,145円 812,743,964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)	3,260,508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)	2,178,085円
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	1,055,574,952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)	5,418,308,072円
野村DC運用戦略ファンド	103,635,836円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	11,130,886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)	140,848,865円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年2月17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	773,506.50	
		BRAZIL GLOBAL	1,070,000.00	1,337,082.70	
		CROATIA	1,100,000.00	1,147,094.30	

CROATIA	1,100,000.00	1,187,313.16	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000.00	1,888,809.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	600,000.00	660,231.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,400,000.00	2,428,068.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,500,000.00	1,477,575.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,700,000.00	1,578,059.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,100,000.00	988,900.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,500,000.00	1,444,605.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,800,000.00	1,582,758.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,800,000.00	2,620,380.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,100,000.00	1,736,280.00	
HUNGARY	700,000.00	726,929.00	
HUNGARY	1,250,000.00	1,332,493.75	
HUNGARY	1,400,000.00	1,494,490.20	
INDONESIA GLOBAL	900,000.00	967,479.30	
MEXICO GLOBAL	2,000,000.00	1,574,920.00	
PANAMA GLOBAL	700,000.00	812,952.00	
PANAMA GLOBAL	1,550,000.00	1,924,797.75	
PHILIPPINES GLOBAL	1,000,000.00	1,021,178.10	
PHILIPPINES GLOBAL	1,750,000.00	2,542,791.47	
PHILIPPINES GLOBAL	1,000,000.00	1,361,505.90	
REPUBLIC OF ARGENTINA	3,975,113.00	1,367,041.36	
REPUBLIC OF ARGENTINA	10,365,309.00	3,490,621.45	
REPUBLIC OF ARGENTINA	13,537,686.00	4,169,742.66	
REPUBLIC OF ARGENTINA	8,386,159.00	3,176,677.02	
REPUBLIC OF ARGENTINA	6,100,000.00	2,124,630.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,000,000.00	310,800.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,300,000.00	1,330,673.50	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,300,000.00	1,264,341.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000.00	1,208,991.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000.00	1,188,082.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,100,000.00	923,670.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	700,000.00	544,250.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,700,000.00	1,531,462.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,500,000.00	2,087,950.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,400,000.00	2,033,616.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,100,000.00	825,132.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	900,000.00	646,074.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	950,000.00	1,417,609.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,368,812.90	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000.00	2,053,655.28	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,100,000.00	1,183,249.65	

REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	622,863.00
REPUBLIC OF INDONESIA	300,000.00	322,184.34
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	669,328.98
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	724,136.00
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	790,676.88
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,072,500.20
REPUBLIC OF INDONESIA	1,750,000.00	2,474,845.97
REPUBLIC OF INDONESIA	1,100,000.00	1,260,832.32
REPUBLIC OF INDONESIA	1,700,000.00	2,331,390.71
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	909,571.84
REPUBLIC OF INDONESIA	1,600,000.00	2,020,224.96
REPUBLIC OF INDONESIA	1,500,000.00	1,555,465.95
REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000.00	2,257,448.52
REPUBLIC OF INDONESIA	1,100,000.00	1,145,216.82
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,062,201.10
REPUBLIC OF PANAMA	700,000.00	721,791.00
REPUBLIC OF PANAMA	800,000.00	829,552.00
REPUBLIC OF PANAMA	1,900,000.00	1,874,939.00
REPUBLIC OF PANAMA	1,100,000.00	976,877.00
REPUBLIC OF PANAMA	1,000,000.00	983,660.00
REPUBLIC OF PANAMA	2,200,000.00	2,146,936.00
REPUBLIC OF PERU	800,000.00	787,200.00
REPUBLIC OF PERU	500,000.00	481,890.00
REPUBLIC OF PERU	2,600,000.00	2,460,926.00
REPUBLIC OF PERU	600,000.00	514,356.00
REPUBLIC OF PERU	1,000,000.00	895,610.00
REPUBLIC OF PERU	2,000,000.00	2,503,280.00
REPUBLIC OF PERU	2,100,000.00	1,594,215.00
REPUBLIC OF PHILIPPINES	500,000.00	519,536.05
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,200,000.00	1,270,333.08
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,300,000.00	1,251,069.56
REPUBLIC OF PHILIPPINES	900,000.00	805,898.88
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,000,000.00	1,299,423.00
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,100,000.00	1,108,332.72
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,800,000.00	1,759,680.00
REPUBLIC OF PHILIPPINES	600,000.00	523,670.64
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,200,000.00	998,968.56
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,300,000.00	1,172,986.10
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,150,000.00	1,239,987.50
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	900,000.00	931,032.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,100,000.00	1,068,419.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000.00	1,769,400.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,000,000.00	1,066,900.00

REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	900,000.00	785,164.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	662,970.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000.00	1,576,350.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000.00	1,732,609.40	
REPUBLIC OF TURKEY	2,000,000.00	2,015,500.00	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	394,500.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,500,000.00	1,416,636.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,900,000.00	2,872,566.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,187,719.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,300,000.00	2,179,687.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,600,000.00	1,426,825.60	
REPUBLIC OF TURKEY	2,200,000.00	2,044,589.80	
REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000.00	2,095,590.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,000,000.00	858,650.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,500,000.00	1,315,725.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000.00	1,044,000.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,600,000.00	1,290,240.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,200,000.00	1,593,231.20	
REPUBLIC OF TURKEY	2,600,000.00	2,195,845.60	
REPUBLIC OF TURKEY	2,200,000.00	1,666,974.76	
ROMANIA	400,000.00	419,688.40	
ROMANIA	1,100,000.00	1,044,450.00	
ROMANIA	800,000.00	959,310.40	
ROMANIA	800,000.00	851,360.00	
ROMANIA	1,200,000.00	1,074,592.80	
RUSSIA	682,500.00	735,932.92	
RUSSIAN FEDERATION	2,000,000.00	2,081,400.00	
RUSSIAN FEDERATION	2,000,000.00	2,073,838.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,800,000.00	1,836,226.80	
RUSSIAN FEDERATION	2,000,000.00	2,034,552.00	
RUSSIAN FEDERATION	2,400,000.00	2,557,632.00	
RUSSIAN FEDERATION	2,200,000.00	2,496,208.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,200,000.00	1,413,380.40	
RUSSIAN FEDERATION	4,600,000.00	4,981,800.00	
TURKEY GLOBAL	1,500,000.00	1,501,320.00	
TURKEY GLOBAL	3,200,000.00	3,286,272.00	
UKRAINE GOVERNMENT	600,000.00	528,727.20	
UKRAINE GOVERNMENT	2,000,000.00	1,896,582.00	
UKRAINE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,008,180.00	
UKRAINE GOVERNMENT	1,600,000.00	1,339,504.00	
UKRAINE GOVERNMENT	2,100,000.00	1,737,267.00	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	656,756.80	

	UKRAINE GOVERNMENT REGS	200,000.00	178,165.00	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	606,550.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,332,630.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,244,568.00	
	UNITED MEXICAN STATES	700,000.00	732,529.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,275,108.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,400,000.00	2,551,524.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,341,398.50	
	UNITED MEXICAN STATES	1,800,000.00	1,908,099.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,260,402.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,900,000.00	1,740,495.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,000,000.00	2,130,000.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,410,000.00	1,614,957.60	
	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,630,045.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,600,000.00	1,528,088.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,900,000.00	1,790,351.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,300,000.00	2,327,301.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,000,000.00	1,608,250.00	
小計	銘柄数：148	245,276,767.00	215,303,852.31	
			(24,863,288,864)	
	組入時価比率：98.4%		100.0%	
合計			24,863,288,864	
			(24,863,288,864)	

(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	2022年 2月17日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	92,520,000	-	92,383,120	136,880
米ドル	92,520,000	-	92,383,120	136,880
合計	92,520,000	-	92,383,120	136,880

(注)時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
(2022年 2月17日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	100,767,877
コール・ローン	13,427,804
国債証券	8,784,790,466
未収利息	109,377,025
前払費用	15,831,868
流動資産合計	9,024,195,040
資産合計	9,024,195,040
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,068
未払解約金	1,273,986
未払利息	9
その他未払費用	264,900
流動負債合計	1,550,963
負債合計	1,550,963
純資産の部	
元本等	
元本	6,295,141,360
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,727,502,717
元本等合計	9,022,644,077
純資産合計	9,022,644,077
負債純資産合計	9,024,195,040

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.運用資産の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3.費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 2月17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	1.4333円
(10,000口当たり純資産額)	(14,333円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p style="padding-left: 20px;">市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p style="padding-left: 20px;">信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p style="padding-left: 20px;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 2月17日現在		2021年 2月18日
期首		2021年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額		6,503,881,954円
同期中における追加設定元本額		1,815,380,511円
同期中における一部解約元本額		2,024,121,105円
期末元本額		6,295,141,360円
期末元本額の内訳*		
野村資産設計ファンド2015		19,560,679円
野村資産設計ファンド2020		19,603,343円
野村資産設計ファンド2025		35,065,247円
野村資産設計ファンド2030		40,224,358円
野村資産設計ファンド2035		29,539,640円
野村資産設計ファンド2040		50,163,241円
野村資産設計ファンド2045		7,982,356円
野村インデックスファンド・新興国債券		738,666,018円
ネクストコア		4,142,066円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		440,516,283円
野村資産設計ファンド2050		8,221,119円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		4,465,269円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		2,217,431円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		1,499,369円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		1,132,604円
世界6資産分散ファンド		117,172,611円
野村資産設計ファンド2060		4,131,738円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用）		4,201,253,335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）		951,360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）		14,018,694円
野村DC新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド		408,108,306円
野村DC運用戦略ファンド		111,086,393円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）		10,780,051円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030		11,038,274円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040		7,560,466円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050		4,030,804円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060		2,010,305円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,500,000.00	8,438,885.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,700,000.00	14,763,651.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,100,000.00	14,870,249.16	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,600,000.00	13,586,565.82	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	4,525,950.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	15,650,000.00	15,478,137.96	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,800,000.00	11,257,796.88	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	13,300,000.00	13,269,144.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,900,000.00	7,839,249.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	3,194,073.27	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	11,600,000.00	12,149,820.28	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,700,000.00	6,488,414.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,500,000.00	8,425,867.25	
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,500,000.00	9,530,770.50	
	小計	銘柄数：14 組入時価比率：9.1%	143,550,000.00	143,818,574.12 (818,672,851) 9.3%	
レアル	レアル	LETRA TESOURO NACIONAL	7,100,000.00	6,061,438.27	
		LETRA TESOURO NACIONAL	8,400,000.00	6,810,991.32	
		LETRA TESOURO NACIONAL	3,500,000.00	2,700,690.65	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	480,000.00	4,772,226.72	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	481,000.00	4,735,866.35	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	490,000.00	4,761,157.03	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	250,000.00	2,378,719.00	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	160,000.00	1,499,658.56	
	小計	銘柄数：8 組入時価比率：8.4%	20,861,000.00	33,720,747.90 (759,030,430) 8.6%	
チリペソ	チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	100,000,000.00	98,495,000.00	
		BONOS TESORERIA PESOS	270,000,000.00	246,874,500.00	
		BONOS TESORERIA PESOS	190,000,000.00	184,024,500.00	
		BONOS TESORERIA PESOS	295,000,000.00	279,438,750.00	

小計	BONOS TESORERIA PESOS	240,000,000.00	226,333,200.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	215,000,000.00	218,859,250.00	
	銘柄数：6	1,310,000,000.00	1,254,025,200.00	(181,068,698)
	組入時価比率：2.0%			2.1%
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,790,000,000.00	1,919,220,100.00	
	TITULOS DE TESORERIA	950,000,000.00	986,480,190.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,900,000,000.00	1,755,795,130.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	779,900,760.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	780,562,620.00	
	TITULOS DE TESORERIA	850,000,000.00	791,555,020.00	
	TITULOS DE TESORERIA	800,000,000.00	705,168,000.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,600,000,000.00	1,383,608,160.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,850,000,000.00	1,594,763,270.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	691,759,440.00	
	小計	銘柄数：10	12,440,000,000.00	11,388,812,690.00
	組入時価比率：3.7%			3.8%
ソル	BONOS DE TESORERIA	200,000.00	206,289.00	
	BONOS DE TESORERIA	1,000,000.00	1,014,516.60	
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	598,388.52	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	633,446.87	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	590,522.66	
	PERU BONO SOBERANO	700,000.00	791,363.37	
	PERU BONO SOBERANO	500,000.00	533,035.65	
	PERU BONO SOBERANO	1,020,000.00	1,027,224.45	
	REPUBLIC OF PERU	1,100,000.00	1,145,840.30	
	小計	銘柄数：9	6,520,000.00	6,540,627.42
	組入時価比率：2.2%			2.3%
ウルグアイペソ	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	4,073,600.00	
小計	銘柄数：1	4,000,000.00	4,073,600.00	(10,942,911)
	組入時価比率：0.1%			0.1%
ドミニカペソ	DOMINICAN REPUBLIC	8,000,000.00	8,464,000.00	
小計	銘柄数：1	8,000,000.00	8,464,000.00	(17,214,929)
	組入時価比率：0.2%			0.2%
セルビアディナール	SERBIA TREASURY BONDS	22,000,000.00	23,567,500.00	
小計	銘柄数：1	22,000,000.00	23,567,500.00	(26,337,223)
	組入時価比率：0.3%			0.3%

トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	790,000.00	759,190.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	200,000.00	190,900.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	770,000.00	689,150.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,162,500.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	437,840.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,110,000.00	874,680.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	731,340.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,416,600.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	400,000.00	291,400.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,100,000.00	1,430,100.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	700,000.00	464,100.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,284,750.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	961,500.00
	小計	銘柄数：13 組入時価比率：1.0%	13,910,000.00
チェココルナ	CZECH REPUBLIC	14,000,000.00	13,236,522.60
	CZECH REPUBLIC	16,600,000.00	15,117,309.58
	CZECH REPUBLIC	11,500,000.00	10,007,930.20
	CZECH REPUBLIC	13,200,000.00	11,227,603.20
	CZECH REPUBLIC	17,800,000.00	15,256,558.00
	CZECH REPUBLIC	6,500,000.00	5,852,275.00
	CZECH REPUBLIC	5,200,000.00	5,882,968.00
	小計	銘柄数：7 組入時価比率：4.6%	84,800,000.00
フォロント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	62,000,000.00	59,408,548.80
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	27,000,000.00	27,715,500.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	68,000,000.00	65,667,600.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	75,000,000.00	71,109,750.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	64,524,600.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	38,000,000.00	33,212,000.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	82,000,000.00	71,909,900.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	86,000,000.00	78,440,600.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	82,000,000.00	74,608,511.80
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	57,000,000.00	63,141,750.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	102,000,000.00	89,596,891.80
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	130,000,000.00	114,367,500.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	40,000,000.00	30,988,000.00
	小計	銘柄数：13 組入時価比率：3.5%	912,000,000.00
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,521,350.00

小計	POLAND GOVERNMENT BOND	700,000.00	684,600.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	600,000.00	579,702.66
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,800,000.00	4,383,112.80
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,100,000.00	1,990,800.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,400,000.00	2,231,160.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	8,600,000.00	8,065,725.00
	銘柄数：7	22,700,000.00	21,456,450.46 (625,440,511)
組入時価比率：6.9%		7.1%	
ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	11,778,997.20
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	21,000,000.00	20,394,150.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	11,542,620.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	21,000,000.00	19,772,865.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	28,300,000.00	26,892,641.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	32,500,000.00	29,834,980.50
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,000,000.00	25,120,530.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	38,700,000.00	36,228,618.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	29,000,000.00	27,314,810.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	10,093,005.60
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,700,000.00	16,495,270.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	16,000,000.00	13,084,800.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	24,000,000.00	20,701,440.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,200,000.00	18,022,642.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	26,500,000.00	25,069,000.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,500,000.00	24,182,125.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	8,430,000.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	51,000,000.00	43,865,100.00
	銘柄数：18	427,400,000.00	388,823,594.30 (594,900,099)
	組入時価比率：6.6%		6.8%
レイ	ROMANIA	550,000.00	559,407.75
	ROMANIA	400,000.00	400,380.00
	ROMANIA	500,000.00	497,333.70
	ROMANIA	1,000,000.00	971,740.00
	ROMANIA	1,300,000.00	1,295,502.00
	ROMANIA	800,000.00	779,930.32
	ROMANIA	920,000.00	917,966.80
	ROMANIA	500,000.00	478,200.00
	ROMANIA	500,000.00	496,420.00
	ROMANIA	1,100,000.00	1,026,622.08
	ROMANIA	760,000.00	781,557.40
	ROMANIA	800,000.00	785,372.00
	ROMANIA	1,400,000.00	1,196,531.00

小計	銘柄数：13	10,530,000.00	10,186,963.05 (270,878,478)	
	組入時価比率：3.0%		3.1%	
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	823,351.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,000,000.00	2,047,000.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	782,053.04	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,400,000.00	1,510,328.12	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	406,311.96	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,019,340.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	700,000.00	715,678.25	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,219,218.48	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,682,316.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,268,312.86	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,435,070.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,460,468.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,519,958.75	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,737,715.22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,107,300.71	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	747,804.16	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,589,912.76	
小計	銘柄数：17	26,900,000.00	27,072,140.81 (747,315,618)	
	組入時価比率：8.3%		8.5%	
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,063,326.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	11,700,000.00	12,175,588.62	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,200,000.00	12,587,753.82	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	14,968,084.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	17,900,000.00	18,155,857.23	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	12,463,231.25	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,300,000.00	10,225,677.36	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,300,000.00	13,768,555.01	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,900,000.00	13,792,133.04	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	12,252,631.68	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,500,000.00	15,017,474.15	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,800,000.00	14,416,476.16	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,906,075.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	17,018,625.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,219,501.60	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	12,373,033.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	13,586,322.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,900,000.00	6,318,435.08	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,700,000.00	15,239,307.05	

小計	銘柄数：19 組入時価比率：9.1%	221,000,000.00	228,548,088.85 (818,202,158) 9.3%
ルピア	INDONESIA GOVERNMENT	4,700,000,000.00	4,828,921,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	4,730,000,000.00	5,116,677,500.00
	INDONESIA GOVERNMENT	3,800,000,000.00	4,110,650,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	6,900,000,000.00	7,241,550,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	1,580,000,000.00	1,889,680,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	6,700,000,000.00	6,758,625,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	2,800,000,000.00	2,777,502,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	6,250,000,000.00	6,643,750,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,022,500,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	3,230,000,000.00	3,706,425,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	4,700,000,000.00	5,195,850,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,390,030,800.00
	INDONESIA GOVERNMENT	6,100,000,000.00	6,290,625,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	2,900,000,000.00	2,905,075,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,871,552,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	1,600,000,000.00	1,776,240,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	3,200,000,000.00	3,379,200,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	4,882,850,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	7,180,000,000.00	8,097,245,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,265,000,000.00
INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,567,500,000.00	
INDONESIA GOVERNMENT	3,400,000,000.00	3,563,200,000.00	
INDONESIA GOVERNMENT	4,600,000,000.00	5,232,500,000.00	
INDONESIA GOVERNMENT	2,300,000,000.00	2,419,600,000.00	
小計	銘柄数：24 組入時価比率：9.6%	100,080,000,000.00	106,932,748,300.00 (866,155,261) 9.9%
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	13,500,000.00	13,560,993.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,200,000.00	15,321,980.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,085,005.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,088,560.00
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,714,368.70
小計	銘柄数：5 組入時価比率：9.6%	47,200,000.00	47,770,906.70 (870,419,359) 9.9%
エジプトポンド	EGYPT GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,007,960.80
	EGYPT GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,429,355.20
小計	銘柄数：2 組入時価比率：0.8%	9,200,000.00	9,437,316.00 (69,329,354) 0.8%

ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,600,000.00	3,688,773.48	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,900,000.00	16,588,774.94	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,700,000.00	10,992,072.78	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,460,000.00	3,826,680.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,200,000.00	9,370,242.24	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000.00	9,159,827.49	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000.00	3,484,378.08	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,200,000.00	9,840,320.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000.00	6,385,681.07	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,450,000.00	3,069,446.24	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000.00	10,219,461.98	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,900,000.00	12,044,994.96	
小計	銘柄数：12 組入時価比率：8.4%	108,010,000.00	98,670,653.26 (758,777,323) 8.6%	
合計			8,784,790,466 (8,784,790,466)	

(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	2022年 2月17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	8,095,290	-	8,083,222	12,068
米ドル	8,095,290	-	8,083,222	12,068
合計	8,095,290	-	8,083,222	12,068

(注)時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	966,241,037
投資証券	42,690,477,239
派生商品評価勘定	605,490
未収入金	20,846,100
未収配当金	274,251,582
差入委託証拠金	154,006,800
流動資産合計	44,106,428,248
資産合計	44,106,428,248
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	69,936,870
未払金	27,879,885
未払解約金	23,505,903
未払利息	654
流動負債合計	121,323,312
負債合計	121,323,312
純資産の部	
元本等	
元本	17,123,088,767
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	26,862,016,169
元本等合計	43,985,104,936
純資産合計	43,985,104,936
負債純資産合計	44,106,428,248

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。</p>
2.費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
-----------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 2月17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	2.5688円
(10,000口当たり純資産額)	(25,688円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、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。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 2月17日現在	
期首	2021年 2月18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	17,302,956,232円
同期中における追加設定元本額	3,835,308,381円
同期中における一部解約元本額	4,015,175,846円
期末元本額	17,123,088,767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）	1,756,867,809円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,262,188,791円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	885,119,202円
野村資産設計ファンド2015	14,527,385円
野村資産設計ファンド2020	14,557,305円
野村資産設計ファンド2025	18,750,505円
野村資産設計ファンド2030	20,292,091円
野村資産設計ファンド2035	20,850,670円
野村資産設計ファンド2040	37,954,226円
野村資産設計ファンド2045	4,429,961円
野村インデックスファンド・J-REIT	3,238,453,999円
ネクストコア	4,109,862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	1,116,102,428円
野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）	2,368,810,890円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	886,753,363円
野村資産設計ファンド2050	4,778,254円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	602,456円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	525,208円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,117,514円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	689,654円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,330,642円
野村6資産均等バランス	2,061,769,137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）	95,165,360円
野村資産設計ファンド2060	3,068,154円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	219,931,424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）	80,256,752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）	75,662,595円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,691,490,909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）	38,501,908円

野村F O F s用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	508,577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	111,910,437円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	8,923,881円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	9,296,929円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	4,228,326円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	9,821,848円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	5,568,873円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	5,721,466円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	2,343,032円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	1,493,159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)	33,506,174円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年2月17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	813	111,787,500	
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,278	144,797,400	
		S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	1,877	281,174,600	
		東海道リート投資法人 投資証券	309	34,577,100	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	1,393	859,481,000	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,745	665,723,500	
		産業ファンド投資法人 投資証券	5,728	981,779,200	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	4,034	1,317,101,000	
		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	2,756	541,278,400	

アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,150	833,125,000	
G L P投資法人 投資証券	13,068	2,292,127,200	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,877	589,378,000	
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	6,602	2,244,680,000	
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	676	446,160,000	
O n eリート投資法人 投資証券	700	207,690,000	
イオンリート投資法人 投資証券	4,745	694,668,000	
ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,764	613,908,400	
日本リート投資法人 投資証券	1,245	486,795,000	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	12,248	955,344,000	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	843	108,999,900	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,611	432,714,600	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	988	141,284,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	914	107,486,400	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	13,048	2,077,241,600	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	668	56,245,600	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,940	860,548,000	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	4,170	252,702,000	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	473	59,456,100	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,589	867,594,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	651	44,723,700	
投資法人みらい 投資証券	4,888	239,023,200	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	947	122,068,300	
三菱地所物流リート投資法人 投資	1,025	456,637,500	

証券			
三菱地所物流リート投資法人 投資証券（権利落ち）	39	17,097,639	
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,563	305,410,200	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	586	71,785,000	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,591	187,419,800	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	1,573	235,635,400	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,704	3,062,304,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,035	2,477,490,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	20,359	1,962,607,600	
オリックス不動産投資法人 投資証券	8,040	1,340,268,000	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,757	1,040,767,500	
N T T 都市開発リート投資法人	3,868	584,454,800	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,705	499,884,000	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,802	316,906,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,083	1,223,480,100	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,884	401,452,800	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	17,760	724,608,000	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,415	674,955,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	2,614	373,017,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,674	822,255,000	
福岡リート投資法人 投資証券	2,087	339,972,300	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,248	863,616,000	
いちごオフィスリート投資法人 投	3,306	277,373,400	

	資証券			
	大和証券オフィス投資法人 投資証券	853	590,276,000	
	阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,823	270,350,900	
	スタートプロシード投資法人 投資証券	628	141,300,000	
	大和ハウスリート投資法人 投資証券	6,059	1,938,880,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	12,361	756,493,200	
	大和証券リビング投資法人 投資証券	5,452	580,638,000	
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,744	481,478,400	
小計	銘柄数：62 組入時価比率：97.1%	235,376	42,690,477,239	100.0%
合計			42,690,477,239	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年 2月17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	1,359,490,800	-	1,290,234,000	69,331,380
合計	1,359,490,800	-	1,290,234,000	69,331,380

(注)時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

海外REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	463,162,012
コール・ローン	93,832,466
投資証券	50,054,685,189
派生商品評価勘定	18,458
未収入金	2,679,401
未収配当金	64,598,568
差入委託証拠金	200,239,063
流動資産合計	50,879,215,157
資産合計	50,879,215,157
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,118,076
未払金	151,774,302
未払解約金	2,884,161
未払利息	63
その他未払費用	120,200
流動負債合計	190,896,802
負債合計	190,896,802
純資産の部	
元本等	
元本	16,192,356,534
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	34,495,961,821
元本等合計	50,688,318,355
純資産合計	50,688,318,355
負債純資産合計	50,879,215,157

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3.費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>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。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>
------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年 2月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	3,1304円
(10,000口当たり純資産額)	(31,304円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、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。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。	
2. 時価の算定方法	
投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、	附属明細表に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 2月17日現在	
期首	2021年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	14,372,600,337円
同期中における追加設定元本額	5,247,211,655円
同期中における一部解約元本額	3,427,455,458円
期末元本額	16,192,356,534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)	1,463,822,561円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	1,884,856,280円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	737,482,104円
野村資産設計ファンド2015	12,103,809円
野村資産設計ファンド2020	12,127,051円
野村資産設計ファンド2025	15,622,349円
野村資産設計ファンド2030	16,906,912円
野村資産設計ファンド2035	17,371,971円
野村資産設計ファンド2040	31,616,732円
野村資産設計ファンド2045	3,691,049円
野村インデックスファンド・外国REIT	1,617,930,031円
ネクストコア	2,447,702円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	392,575,924円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	715,710,418円
野村資産設計ファンド2050	3,981,142円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,735,664円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,576,547円
インデックス・ブレンド(タイプ)	10,309,578円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,921,405円
インデックス・ブレンド(タイプ)	10,914,258円
野村6資産均等バランス	1,717,868,061円
野村資産設計ファンド2060	2,556,300円

NEXT FUNDS 外国REIT・S&P先進国REIT指数（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信	4,287,010,569円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	2,327,570,346円
ノムラ海外REITインデックス・ファンドVA（適格機関投資家専用）	715,617,675円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国REIT（適格機関投資家専用）	63,413,905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）	423,650円
野村DC運用戦略ファンド	66,649,547円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	4,874,675円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	7,746,302円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	3,523,094円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	8,183,805円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	4,640,050円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	4,767,184円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	1,952,236円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,244,112円
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	18,611,536円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年2月17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	24,900	519,912.00	
		AGREE REALTY CORP	19,600	1,241,856.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	20,000	458,200.00	
		ALEXANDERS INC	620	161,832.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	39,390	7,369,475.10	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,700	51,570.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	14,400	524,304.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	38,700	1,945,062.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	78,700	3,017,358.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	74,100	2,105,922.00	
		APARTMENT INCOME REIT CO	43,700	2,296,435.00	

APARTMENT INVT&MGMT CO-A	43,000	304,010.00	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	58,500	1,045,980.00	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	16,400	237,308.00	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	9,200	89,976.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	38,940	9,340,537.80	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	7,000	186,130.00	
BOSTON PROPERTIES	39,700	4,866,426.00	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	16,000	103,200.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	47,400	648,906.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	82,500	2,104,575.00	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	45,100	1,003,926.00	
BRT APARTMENTS CORP	3,500	83,195.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	28,490	4,665,807.30	
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	26,700	519,582.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	3,200	74,976.00	
CENTERSPACE	3,900	369,174.00	
CHATHAM LODGING TRUST	13,000	194,090.00	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	5,200	39,728.00	
CITY OFFICE REIT INC	12,400	225,184.00	
CLIPPER REALTY INC	2,400	22,608.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	6,600	291,456.00	
COREPOINT LODGING INC	10,900	171,348.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	31,600	826,656.00	
COUSINS PROPERTIES INC	41,400	1,662,210.00	
CTO REALTY GROWTH INC	1,600	95,504.00	
CUBESMART	60,700	2,979,156.00	
CYRUSONE INC	35,500	3,189,675.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	60,000	617,400.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	79,060	10,641,476.00	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	145,000	1,064,300.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	68,000	212,160.00	
DOUGLAS EMMETT INC	48,900	1,572,135.00	
DUKE REALTY CORP	106,100	5,715,607.00	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	100,000	0.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	24,300	506,655.00	

INC			
EASTGROUP PROPERTIES	11,300	2,157,057.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	38,000	364,040.00	
EPR PROPERTIES	20,900	984,181.00	
EQUINIX INC	25,120	16,920,329.60	
EQUITY COMMONWEALTH	34,000	911,880.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	47,800	3,701,154.00	
EQUITY RESIDENTIAL	95,300	8,217,719.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	34,100	858,297.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	18,130	5,786,733.40	
EXTRA SPACE STORAGE INC	37,400	7,134,424.00	
FARMLAND PARTNERS INC	6,800	77,384.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	19,400	2,322,374.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	36,200	2,098,514.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	21,800	573,994.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	25,000	141,500.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	62,800	2,817,836.00	
GETTY REALTY CORP	10,800	302,400.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	10,400	228,280.00	
GLADSTONE LAND CORP	8,400	257,208.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	17,200	283,800.00	
GLOBAL NET LEASE INC	27,800	403,100.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	41,300	1,295,581.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	61,400	1,899,102.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	150,200	4,809,404.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9,600	99,840.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	29,300	1,286,856.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	199,800	3,858,138.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	42,800	1,090,544.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	28,900	693,311.00	
INDUS REALTY TRUST INC	1,800	139,086.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	18,000	404,280.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	6,720	1,299,580.80	
INVITATION HOMES INC	166,700	6,743,015.00	
IRON MOUNTAIN INC	80,900	3,560,409.00	

JBG SMITH PROPERTIES	32,300	910,214.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	210,000	153,300.00	
KILROY REALTY CORP	29,200	2,087,800.00	
KIMCO REALTY CORP	171,900	4,172,013.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	61,500	1,364,070.00	
LIFE STORAGE INC	22,970	2,985,181.20	
LTC PROPERTIES INC	11,200	386,176.00	
LXP INDUSTRIAL TRUST	79,000	1,208,700.00	
MACERICH CO /THE	58,500	963,495.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	419,515	278,977.47	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	166,500	3,438,225.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	32,170	6,712,592.20	
MONMOUTH REIT-CLASS A	27,600	578,220.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	48,800	2,106,696.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	22,900	1,358,199.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	12,500	692,250.00	
NETSTREIT CORP	11,400	250,458.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	6,400	550,592.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	13,200	335,676.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	66,400	1,945,520.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,200	125,874.00	
ORION OFFICE REIT INC	15,500	266,755.00	
PARAMOUNT GROUP INC	47,000	448,380.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	66,200	1,337,240.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	37,200	926,652.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	15,000	14,098.50	
PHILLIPS EDISON & CO INC	5,400	176,904.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	62,100	1,082,403.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	33,800	586,768.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	9,300	260,772.00	
POSTAL REALTY TRUST INC-A	3,200	56,928.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	14,900	384,420.00	
PRIME US REIT	140,000	116,200.00	
PROLOGIS INC	206,230	29,775,487.40	

PS BUSINESS PARKS INC/CA	5,640	898,846.80	
PUBLIC STORAGE	42,570	14,972,720.40	
REALTY INCOME CORP	157,600	10,628,544.00	
REGENCY CENTERS CORP	43,200	2,906,064.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	33,600	626,640.00	
RETAIL VALUE INC	4,401	14,127.21	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	42,400	2,973,088.00	
RLJ LODGING TRUST	47,300	725,582.00	
RPT REALTY	23,700	303,360.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	15,400	1,450,372.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	64,700	895,448.00	
SAFEHOLD INC	3,900	254,358.00	
SAUL CENTERS INC	3,400	161,534.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	9,300	89,094.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	46,000	424,580.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	91,720	13,194,839.20	
SITE CENTERS CORP	50,800	802,640.00	
SL GREEN REALTY CORP	18,662	1,522,819.20	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	34,300	1,614,844.00	
STAG INDUSTRIAL INC	48,600	1,933,308.00	
STORE CAPITAL CORP	68,200	2,093,740.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	30,000	315,600.00	
SUN COMMUNITIES INC	32,300	6,198,047.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	60,000	717,000.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	29,300	506,597.00	
TERRENO REALTY CORP	20,900	1,448,161.00	
THE NECESSITY RETAIL REIT WHERE AMERICA	34,000	292,740.00	
UDR INC	81,000	4,460,670.00	
UMH PROPERTIES INC	12,300	286,713.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,700	213,601.00	
URBAN EDGE PROPERTIES	30,600	571,302.00	
URSTADT BIDDLE-CL A	8,400	162,456.00	
VENTAS INC	111,200	5,829,104.00	
VERIS RESIDENTIAL INC	21,700	383,005.00	

小計	VICI PROPERTIES INC	175,300	5,045,134.00	
	VORNADO REALTY TRUST	44,300	1,993,500.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	23,800	584,052.00	
	WELLTOWER INC	121,300	10,175,857.00	
	WHITESTONE REIT	12,000	141,960.00	
	WP CAREY INC	52,000	3,986,320.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	31,100	600,852.00	
	銘柄数：155	7,079,648	329,520,791.98 (38,053,061,057)	
組入時価比率：75.1%		76.0%		
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	17,800	769,494.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	16,000	208,800.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST	6,000	86,340.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	6,300	343,791.00	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	9,000	36,720.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	23,800	1,320,424.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	44,000	644,600.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	12,600	219,492.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	251,996.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	31,000	501,580.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,700	170,381.00	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,000	47,190.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	30,800	560,560.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,100	854,126.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	40,000	515,600.00	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	4,000	41,240.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19,100	306,937.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	14,200	310,270.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,000	109,450.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	5,800	109,214.00	
	NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	6,000	73,980.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	30,000	403,500.00	
PLAZA RETAIL REIT	12,000	57,960.00		

小計	PRIMARIS REIT	9,425	131,478.75
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	43,700	1,075,457.00
	SLATE GROCERY REIT	8,000	123,840.00
	SLATE OFFICE REIT	8,000	41,040.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	20,100	630,537.00
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	24,000	517,920.00
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	14,000	103,600.00
	銘柄数：30	502,025	10,567,517.75 (961,855,465)
組入時価比率：1.9%		1.9%	
ユーロ	AEDIFICA	10,100	999,395.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,000	66,160.00
	ALTAREA	1,220	187,880.00
	BEFIMMO S.C.A.	6,500	213,200.00
	CARE PROPERTY INVEST	6,800	156,740.00
	CARMILA	13,000	203,060.00
	COFINIMMO	8,230	970,317.00
	COIMA RES SPA	6,000	47,700.00
	COVIVIO	13,300	998,564.00
	CROMWELL REIT EUR	82,000	193,520.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	10,200	237,048.00
	GECINA SA	15,060	1,739,430.00
	HAMBORNER REIT AG	20,000	201,960.00
	HIBERNIA REIT PLC	180,000	218,880.00
	ICADE	9,000	534,600.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	14,000	59,990.00
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	74,000	573,870.00
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	6,800	183,940.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	120,000	186,000.00
	KLEPIERRE	54,800	1,367,260.00
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	16,000	85,920.00
	MERCIALYS	13,000	128,765.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	93,000	967,665.00
	MONTEA	2,780	309,692.00
	NSI NV	5,000	176,750.00
	RETAIL ESTATES	3,300	233,970.00

小計	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	32,600	2,347,200.00
	VASTNED RETAIL NV	5,200	141,440.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	39,100	1,386,486.00
	WERELDHAVE NV	11,400	198,930.00
	XIOR STUDENT HOUSING NV	5,500	269,500.00
	銘柄数：31	881,890	15,585,832.00 (2,048,445,899)
	組入時価比率：4.0%		4.1%
英債券	AEW UK REIT PLC	48,000	56,064.00
	ASSURA PLC	830,000	513,770.00
	BIG YELLOW GROUP PLC	47,600	681,156.00
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	216,000	240,624.00
	BRITISH LAND	261,000	1,427,670.00
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	233,000	399,828.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	162,000	142,884.00
	CUSTODIAN REIT PLC	120,000	125,760.00
	DERWENT LONDON PLC	31,300	1,016,937.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	172,000	156,004.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	71,000	507,650.00
	HAMMERSON PLC	1,160,000	447,992.00
	HOME REIT PLC	150,000	169,500.00
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	105,750	120,555.00
	INTU PROPERTIES PLC	184,000	0.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	209,000	1,687,466.00
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	255,000	672,690.00
	LXI REIT PLC	217,600	301,593.60
	NEWRIVER REIT PLC	80,000	73,200.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	150,000	152,100.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	379,000	510,513.00
	PRS REIT PLC/THE	162,000	167,670.00
	REGIONAL REIT LTD	120,000	106,440.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	57,800	734,638.00
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	160,000	88,960.00
SEGRO PLC	335,000	4,281,300.00	
SHAFTESBURY PLC	81,000	489,240.00	

	STANDARD LIFE INV PROP INC	110,000	88,660.00	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	264,000	312,840.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	96,000	89,664.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	521,000	1,204,552.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	240,000	195,840.00	
	UNITE GROUP PLC	111,900	1,140,820.50	
	WORKSPACE GROUP PLC	36,000	275,940.00	
小計	銘柄数 : 34	7,376,950	18,580,521.10	
			(2,916,026,981)	
	組入時価比率 : 5.8%		5.8%	
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	106,000	372,060.00	
	ARENA REIT	97,000	482,090.00	
	AVENTUS GROUP	110,000	352,000.00	
	BWP TRUST	138,000	549,240.00	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	172,000	512,560.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	153,000	575,280.00	
	CENTURIA OFFICE REIT	120,000	266,400.00	
	CHARTER HALL GROUP	130,000	2,135,900.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	173,000	854,620.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	142,000	583,620.00	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	93,000	359,910.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	410,000	364,900.00	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	60,000	193,200.00	
	DEXUS/AU	299,000	3,166,410.00	
	GDI PROPERTY GROUP	130,000	134,550.00	
	GOODMAN GROUP	473,900	11,373,600.00	
	GPT GROUP	534,000	2,680,680.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	80,000	324,800.00	
	HOME CONSORTIUM LTD	54,000	346,140.00	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	160,000	219,200.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	56,000	194,880.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	105,000	581,700.00	
	IRONGATE GROUP	150,000	278,250.00	
	MIRVAC GROUP	1,096,000	2,827,680.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	298,000	724,140.00	

小計	RURAL FUNDS GROUP	103,000	303,850.00
	SCENTRE GROUP	1,450,000	4,567,500.00
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	305,000	881,450.00
	STOCKLAND TRUST GROUP	664,000	2,702,480.00
	VICINITY CENTRES	1,080,000	2,014,200.00
	WAYPOINT REIT	201,000	550,740.00
	銘柄数：31	9,142,900	41,474,030.00 (3,446,077,152)
組入時価比率：6.8%		6.9%	
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	220,000	308,000.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	300,000	745,500.00
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	440,000	484,000.00
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	360,000	572,400.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	120,000	375,600.00
	銘柄数：5	1,440,000	2,485,500.00 (191,980,020)
組入時価比率：0.4%		0.4%	
香港ドル	CHAMPION REIT	550,000	2,172,500.00
	FORTUNE REIT	400,000	3,248,000.00
	LINK REIT	583,000	38,798,650.00
	PROSPERITY REIT	360,000	1,094,400.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	290,000	1,270,200.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	602,800	1,983,212.00
	銘柄数：6	2,785,800	48,566,962.00 (718,791,037)
組入時価比率：1.4%		1.4%	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	130,000	184,600.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	369,869	319,936.68
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	932,762	2,639,716.46
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	549,956	566,454.68
	CAPITALAND CHINA TRUST	320,279	377,929.22
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,386,694	2,912,057.40
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	200,000	238,000.00
	EC WORLD REIT	60,000	44,700.00
	ESR REIT	769,952	338,778.88

	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	320,000	188,800.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	356,400	108,702.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	303,838	695,789.02	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	819,746	1,164,039.32	
	I REIT GLOBAL	141,212	91,787.80	
	KEPPEL DC REIT	365,211	792,507.87	
	KEPPEL REIT	560,000	632,800.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	260,000	218,400.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	602,716	1,096,943.12	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	542,900	1,378,966.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	839,980	1,469,965.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	590,000	643,100.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	690,216	296,792.88	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	108,000	492,480.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	140,000	114,100.00	
	SPH REIT	250,000	242,500.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	420,000	258,300.00	
	SUNTEC REIT	610,000	988,200.00	
小計	銘柄数：27	12,639,731	18,496,346.33	
			(1,590,870,747)	
	組入時価比率：3.1%		3.2%	
ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	42,000	254,100,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	7,000	40,950,000.00	
	JR REIT XXVII	34,000	180,540,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	9,000	58,770,000.00	
	LOTTE REIT CO LTD	34,000	184,280,000.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	25,000	114,375,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	11,000	88,880,000.00	
小計	銘柄数：7	162,000	921,895,000.00	
			(89,147,246)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
新シケル	REIT 1 LTD	48,000	1,061,280.00	
小計	銘柄数：1	48,000	1,061,280.00	
			(38,429,585)	
	組入時価比率：0.1%		0.1%	

合計		50,054,685,189	
		(50,054,685,189)	

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年 2月17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	629,062,287	-	593,031,372	36,030,915
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	75,310,369	-	75,241,666	68,703
米ドル	55,509,969	-	55,427,808	82,161
カナダドル	4,548,600	-	4,550,930	2,330
英ポンド	4,702,980	-	4,708,104	5,124
豪ドル	4,143,900	-	4,154,480	10,580
香港ドル	2,965,000	-	2,960,000	5,000
シンガポールドル	3,439,920	-	3,440,344	424
合計	-	-	-	36,099,618

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

野村マネー マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,227,518,957
地方債証券	1,501,627,019
特殊債券	2,542,356,933
社債券	802,220,740
未収利息	4,442,940
前払費用	4,531,920
流動資産合計	8,082,698,509
資産合計	8,082,698,509
負債の部	
流動負債	
未払利息	2,185
流動負債合計	2,185
負債合計	2,185
純資産の部	
元本等	
元本	7,924,810,012
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	157,886,312
元本等合計	8,082,696,324
純資産合計	8,082,696,324
負債純資産合計	8,082,698,509

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	地方債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 2月17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	1.0199円
(10,000口当たり純資産額)	(10,199円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 2月18日 至 2022年 2月17日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月17日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 2月17日現在	
期首	2021年 2月18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	10,605,556,358円
同期中における追加設定元本額	3,702,947,491円
同期中における一部解約元本額	6,383,693,837円
期末元本額	7,924,810,012円
期末元本額の内訳*	
野村世界業種別投資シリーズ（マネープール・ファンド）	459,186,399円
ノムラ・アジア・シリーズ（マネープール・ファンド）	163,405,024円
ネクストコア	2,282,012円
野村世界高金利通貨投信	34,318,227円
野村新世界高金利通貨投信	982,608円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（欧州通貨コース）	982,609円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円コース）	982,609円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（豪ドルコース）	982,609円
野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）毎月分配型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）年2回決算型	9,826円
野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型	98,260円
野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）年2回決算型	98,261円
野村日本ブランド株投資（円コース）毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）毎月分配型	982,608円
野村日本ブランド株投資（ブラジルリアルコース）毎月分配型	982,608円
野村日本ブランド株投資（南アフリカランドコース）毎月分配型	98,261円
野村日本ブランド株投資（トルコリラコース）毎月分配型	982,607円
野村日本ブランド株投資（円コース）年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資（ブラジルリアルコース）年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資（南アフリカランドコース）年2回決算型	98,260円
野村日本ブランド株投資（トルコリラコース）年2回決算型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	98,261円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型	98,260円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型	98,261円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）年2回決算型	98,260円
野村新エマージング債券投信（円コース）毎月分配型	982,608円

野村新エマージング債券投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261円
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,607円
野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261円
野村新エマージング債券投信(中国元コース)毎月分配型	982,607円
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信(円コース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261円
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260円
野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826円
野村新エマージング債券投信(中国元コース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	98,261円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834円
野村アジアC B投信(毎月分配型)	982,608円
野村グローバルC B投信(円コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信(円コース)年2回決算型	984,543円
野村グローバルC B投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543円
野村グローバルC B投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,543円
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	984,252円
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	982,609円
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	982,609円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)毎月分配型	982,607円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	982,607円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	982,608円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)年2回決算型	98,261円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	98,261円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	98,261円
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	98,261円
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768円
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	983,768円

野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	983,768円
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	983,768円
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	983,768円
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型	983,672円
野村テンプレトン・トータル・リターン Aコース	983,381円
野村テンプレトン・トータル・リターン Bコース	98,261円
野村テンプレトン・トータル・リターン Cコース	983,381円
野村テンプレトン・トータル・リターン Dコース	983,381円
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609円
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,262円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,261円
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	983,091円
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898円
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801円
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401円
野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,608円
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,415円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,029円
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547円
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547円
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	966円
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型	177,539円
野村通貨選択日本株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	398,357円
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)毎月分配型	123,377円

野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)毎月分配型	626,503円
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	23,859円
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	27,600円
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)毎月分配型	149,947円
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)毎月分配型	48,092円
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型	3,114円
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型	132,547円
野村通貨選択日本株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	100,946円
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型	18,851円
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)年2回決算型	373,897円
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	41,054円
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	14,308円
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)年2回決算型	63,772円
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)年2回決算型	13,741円
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451円
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451円
ノムラ THE USA Aコース	981,258円
ノムラ THE USA Bコース	981,258円
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,809円
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)毎月分配型	9,809円
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,809円
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型	9,809円
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,808円
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,808円
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,808円
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,808円
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,807円
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,807円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,807円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,807円
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489円
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489円
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,805円
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型	9,803円
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)毎月分配型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)毎月分配型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型	9,803円
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)年2回決算型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型	9,803円
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801円

野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801円
グローバル・ストック Aコース	97,953円
グローバル・ストック Bコース	979,528円
グローバル・ストック Cコース	97,953円
グローバル・ストック Dコース	979,528円
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795円
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795円
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型	9,797円
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9,797円
(年3%目標払出)のむラップ・ファンド(普通型)	98,001円
(年6%目標払出)のむラップ・ファンド(普通型)	98,001円
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース	98,011円
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース	98,011円
野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース	98,020円
野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース	98,020円
第1回 野村短期公社債ファンド	1,076,636円
第2回 野村短期公社債ファンド	3,919,169円
第3回 野村短期公社債ファンド	1,371,897円
第4回 野村短期公社債ファンド	1,077,981円
第5回 野村短期公社債ファンド	1,959,729円
第6回 野村短期公社債ファンド	1,077,981円
第7回 野村短期公社債ファンド	204,767円
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261円
第9回 野村短期公社債ファンド	5,094,831円
第10回 野村短期公社債ファンド	391,715円
第11回 野村短期公社債ファンド	1,861,757円
第12回 野村短期公社債ファンド	1,901,723円
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用)	929,623,019円
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付)	188,174,367円
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Hプライス(適格機関投資家専用)	1,977,425,742円
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Iプライス(適格機関投資家専用)	1,997,050,289円
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Kプライス(適格機関投資家専用)	1,941,761,887円
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134円
野村DCテンプレートン・トータル・リターン Aコース	9,818円
野村DCテンプレートン・トータル・リターン Bコース	9,818円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年2月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
地方債証券	日本円	北海道 公募(5年)平成28年度第15回	440,000,000	440,039,600	
		大阪府 公募第361回	300,000,000	300,993,414	
		京都府 公募平成29年度第3回	200,000,000	200,019,322	
		千葉県 公募平成23年度第9回	300,000,000	300,288,292	
		共同発行市場地方債 公募第107回	100,000,000	100,028,437	
		共同発行市場地方債 公募第110回	100,000,000	100,239,882	
		広島市 公募平成23年度第5回	60,000,000	60,018,072	
		小計	銘柄数:7 組入時価比率:18.6%	1,500,000,000	1,501,627,019
	合計			1,501,627,019	
特殊債券	日本円	東京交通債券 第342回	100,000,000	100,805,041	
		住宅金融支援機構債券 財投機関債第95回	500,000,000	500,434,431	
		成田国際空港 第11回	100,000,000	100,003,000	
		日本学生支援債券 財投機関債第59回	510,000,000	510,033,801	
		商工債券 利付第802回い号	30,000,000	30,001,125	
		しんきん中金債券 利付第328回	100,000,000	100,011,826	
		しんきん中金債券 利付第329回	100,000,000	100,014,576	
		しんきん中金債券 利付第331回	50,000,000	50,017,101	
		しんきん中金債券 利付第332回	100,000,000	100,040,964	
		しんきん中金債券 利付第333回	200,000,000	200,093,724	
		商工債券 利付(3年)第234回	100,000,000	100,030,488	
		商工債券 利付(3年)第236回	300,000,000	300,055,732	
		中日本高速道路社債 第42回	50,000,000	50,040,380	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第49回	300,000,000	300,774,744	
	小計	銘柄数:14 組入時価比率:31.5%	2,540,000,000	2,542,356,933	52.4%
合計			2,542,356,933		

社債券	日本円	三井不動産 第46回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	201,018,840	
		東日本旅客鉄道 第85回社債間限 定同順位特約付	300,000,000	301,123,150	
		中部電力 第522回	300,000,000	300,078,750	
	小計	銘柄数：3 組入時価比率：9.9%	800,000,000	802,220,740	16.6%
	合計			802,220,740	
合計				4,846,204,692	

(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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

2022年3月31日現在

資産総額	5,003,430,372円
負債総額	1,104,826,682円
純資産総額（ - ）	3,898,603,690円
発行済口数	3,663,374,145口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0642円

（参考）国内株式マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	464,868,231,593円
負債総額	34,539,600,663円
純資産総額（ - ）	430,328,630,930円
発行済口数	206,677,732,258口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0821円

（参考）国内債券マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	20,608,185,397円
負債総額	513,576,218円
純資産総額（ - ）	20,094,609,179円
発行済口数	14,968,953,407口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3424円

（参考）外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	1,319,612,893,057円
負債総額	4,268,796,686円
純資産総額（ - ）	1,315,344,096,371円
発行済口数	276,853,019,010口
1口当たり純資産額（ / ）	4.7511円

（参考）外国債券マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	647,278,001,016円
負債総額	1,766,308,058円
純資産総額（ - ）	645,511,692,958円
発行済口数	250,751,459,586口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5743円

（参考）新興国株式マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	74,635,320,232円
負債総額	464,258,734円
純資産総額（ - ）	74,171,061,498円
発行済口数	45,565,806,889口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6278円

（参考）新興国債券マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	22,587,503,112円
負債総額	190,360,019円
純資産総額（ - ）	22,397,143,093円
発行済口数	11,618,530,902口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9277円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	8,934,412,435円
負債総額	33,230,168円
純資産総額（ - ）	8,901,182,267円
発行済口数	6,374,948,713口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3963円

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	44,884,737,988円
負債総額	1,447,705,707円
純資産総額（ - ）	43,437,032,281円
発行済口数	16,035,007,118口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7089円

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	57,956,950,458円
負債総額	236,539,539円
純資産総額（ - ）	57,720,410,919円
発行済口数	16,383,675,801口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5230円

（参考）野村マネー マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	8,713,692,968円
負債総額	210,218,755円
純資産総額（ - ）	8,503,474,213円
発行済口数	8,337,552,439口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0199円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または

記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

上記の振替について、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るときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱い

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け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額

2022年3月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

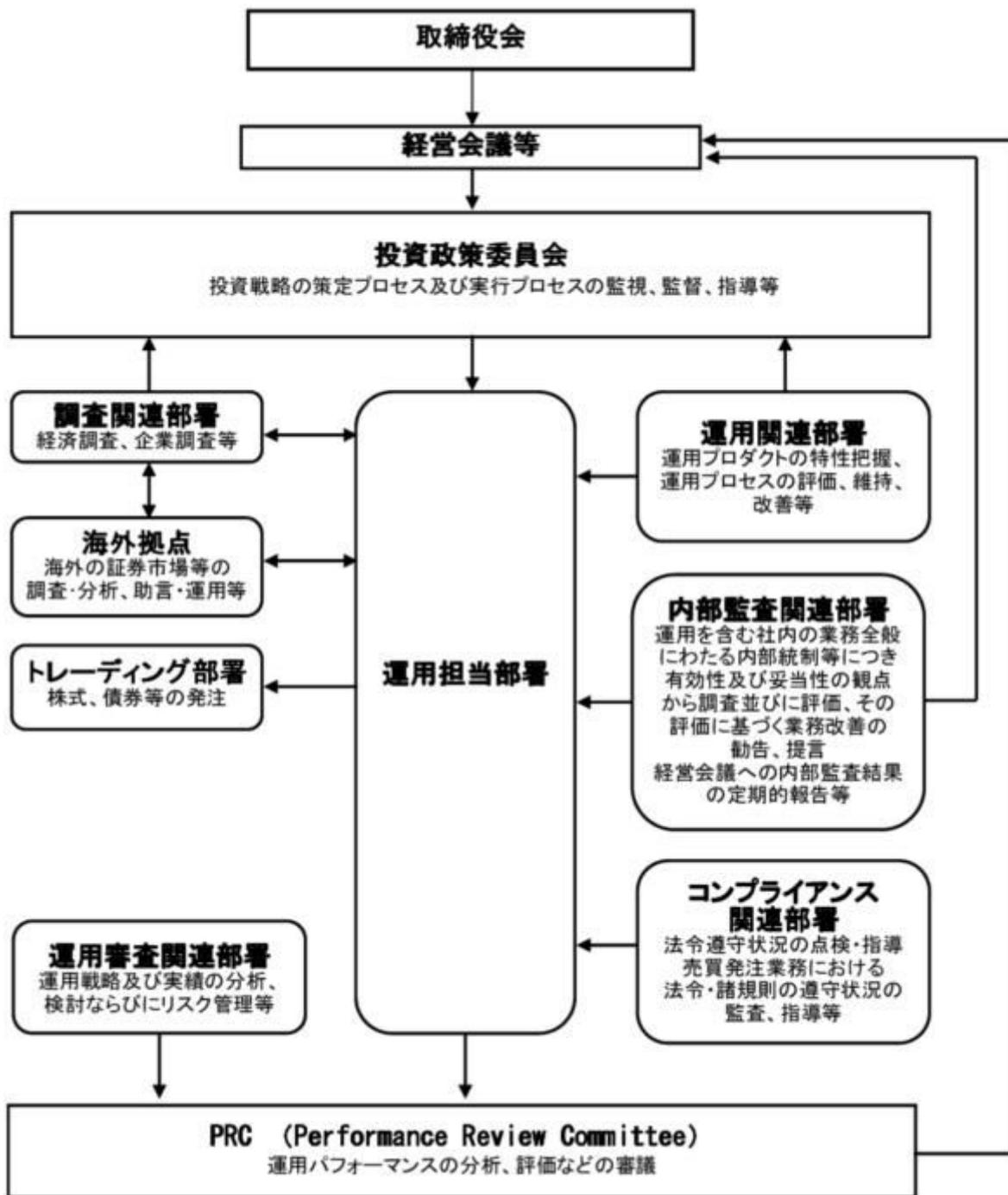
代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2022年2月28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	994	37,512,333
単位型株式投資信託	197	763,289
追加型公社債投資信託	14	6,237,946
単位型公社債投資信託	512	1,509,018
合計	1,717	46,022,587

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金			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

区分	注記 番号	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			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					
資本金			85,270		87,596
資本剰余金			17,180		17,180
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			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】

区分	注記 番号	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)	
		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

区分	注記 番号	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)	
		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 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						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								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	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	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>						
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法						
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 <table style="margin-left: 20px;"> <tr> <td>建物</td> <td>6年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>6～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> </p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	6年	附属設備	6～15年	器具備品	4～15年
建物	6年						
附属設備	6～15年						
器具備品	4～15年						
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p>						

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

[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せん。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

(1) 概要

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

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

[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)

<p>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。</p> <p>受取配当金 4,931百万円</p>	<p>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。</p> <p>受取配当金 4,334百万円</p>
<p>2. 固定資産除却損</p> <p>器具備品 7百万円</p> <p>ソフトウェア 59</p> <p>ア</p> <hr/> <p>合計 67</p>	<p>2. 固定資産除却損</p> <p>器具備品 2百万円</p> <p>ソフトウェア 102</p> <p>ア</p> <hr/> <p>合計 105</p>

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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、過年度に計上してあ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				
其他有価証券	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．其他有価証券(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其他有価証券（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業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。
2．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	57%
株式	24%
生保一般勘定	12%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.6%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.8%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、206百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2020年3月31日)	当事業年度末 (2021年3月31日)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
繰延税金資産 百万円	繰延税金資産 百万円
賞与引当金 1,235	賞与引当金 1,176
退職給付引当金 1,026	退職給付引当金 1,022
関係会社株式評価減 762	関係会社株式評価減 784
未払事業税 285	未払事業税 430
投資有価証券評価減 462	投資有価証券評価減 428
減価償却超過額 171	減価償却超過額 223
時効後支払損引当金 177	時効後支払損引当金 179
関係会社株式売却損 148	関係会社株式売却損 148
ゴルフ会員権評価減 167	ゴルフ会員権評価減 135
未払社会保険料 97	未払社会保険料 95
その他 219	その他 341
繰延税金資産小計 4,754	繰延税金資産小計 4,968
評価性引当額 1,532	評価性引当額 1,530
繰延税金資産合計 3,222	繰延税金資産合計 3,437
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 4	その他有価証券評価差額金 25
前払年金費用 478	前払年金費用 403
繰延税金負債合計 483	繰延税金負債合計 429
繰延税金資産の純額 2,738	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	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率 31.0%	法定実効税率 31.0%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 0.0%	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%	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 2.6%	タックスヘイブン税制 1.9%
外国税額控除 0.7%	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%	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%	その他 0.3%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 29.1%	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	自	2020年4月 1日
	至	2020年3月31日	至	2021年3月31日
期首残高		-		-
有形固定資産の取得に伴う増加		-		1,371
時の経過による調整額		-		-
期末残高		-		1,371

セグメント情報等

前事業年度(自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)

1．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,557円31銭	1株当たり純資産額	17,018円01銭
1株当たり当期純利益	4,658円88銭	1株当たり当期純利益	5,101円61銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	23,996百万円	損益計算書上の当期純利益	26,276百万円
普通株式に係る当期純利益	23,996百万円	普通株式に係る当期純利益	26,276百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

中間財務諸表

中間貸借対照表

		2021年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		2,226
金銭の信託		36,349
有価証券		11,600
未収委託者報酬		26,924
未収運用受託報酬		4,497
その他		1,176
貸倒引当金		15
流動資産計		82,759
固定資産		
有形固定資産	1	2,005
無形固定資産		5,512
ソフトウェア		5,511

その他		0
投資その他の資産		15,622
投資有価証券		1,949
関係会社株式		9,864
前払年金費用		1,305
繰延税金資産		1,951
その他		551
固定資産計		23,140
資産合計		105,899

		2021年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
未払金		12,617
未払収益分配金		0
未払償還金		5
未払手数料		8,203
関係会社未払金		3,481
その他未払金	2	925
未払費用		9,068
未払法人税等		1,282
賞与引当金		1,966
資産除去債務		296
その他		150
流動負債計		25,381
固定負債		
退職給付引当金		3,265
時効後支払損引当金		588
資産除去債務		1,123
固定負債計		4,976
負債合計		30,358
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		75,467
資本剰余金		17,180
資本剰余金		13,729
資本準備金		11,729
その他資本剰余金		2,000
利益剰余金		44,557
利益準備金		685
その他利益剰余金		43,872
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		19,265
評価・換算差額等		74
その他有価証券評価差額金		74
純資産合計		75,541
負債・純資産合計		105,899

中間損益計算書

		自 2021年4月 1日 至 2021年9月30日
区分	注記 番号	金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		57,049
運用受託報酬		8,278
その他営業収益		219

営業収益計		65,547
営業費用		
支払手数料		19,265
調査費		12,882
その他営業費用		2,443
営業費用計		34,591
一般管理費	1	14,589
営業利益		16,366
営業外収益	2	4,136
営業外費用	3	262
経常利益		20,241
特別利益	4	49
特別損失	5	507
税引前中間純利益		19,782
法人税、住民税及び事業税		4,594
法人税等調整額		1,049
中間純利益		14,139

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金			
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596
当中間期変動額									
剰余金の配当							26,268	26,268	26,268
中間純利益							14,139	14,139	14,139
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	12,129	12,129	12,129

当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	19,265	44,557	75,467
---------	--------	--------	-------	--------	-----	--------	--------	--------	--------

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	57	57	87,654
当中間期変動額			
剰余金の配当			26,268
中間純利益			14,139
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	16	16	16
当中間期変動額合計	16	16	12,112
当中間期末残高	74	74	75,541

[重要な会計方針]

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

	<p>(3) 退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法</p> <p>確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。</p> <p>退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p>
5 収益及び費用の計上基準	<p>(4) 時効後支払損引当金</p> <p>時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p>
	<p>委託者報酬</p> <p>委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>運用受託報酬</p> <p>運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき契約期間の純資産総額等に対する一定割合として認識され、確定した報酬を顧問口座によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>成功報酬</p> <p>成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
6 消費税等の会計処理	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。</p>
7 連結納税制度の適用	<p>連結納税制度を適用しております。</p> <p>なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</p>

（収益認識に関する会計基準等の適用）

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

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

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

これによる中間財務諸表に与える影響は軽微であります。

（時価の算定に関する会計基準の適用）

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる中間財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。

[注記事項]

中間貸借対照表関係

2021年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	1,136百万円
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。

中間損益計算書関係

自 2021年4月 1日 至 2021年9月30日	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	286百万円
無形固定資産	1,006百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	3,530百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
金銭の信託運用損	71百万円
時効後支払損引当金繰入	10百万円
4 特別利益の内訳	
投資有価証券等売却益	26百万円
株式報酬受入益	23百万円

5 特別損失の内訳

投資有価証券等売却損	0百万円
関係会社株式評価損	77百万円
固定資産除却損	374百万円
事務所移転費用	54百万円

中間株主資本等変動計算書関係

		自 2021年4月 1日			
		至 2021年9月30日			
1	発行済株式に関する事項				
		株式の種類	当事業年度期首	増加	減少
		普通株式	5,150,693株	-	-
					当中間会計期間末
					5,150,693株
2	配当に関する事項				
	配当金支払額				
	2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。				
	・普通株式の配当に関する事項				
	(1) 配当金の総額			26,268百万円	
	(2) 1株当たり配当額			5,100円	
	(3) 基準日			2021年3月31日	
	(4) 効力発生日			2021年6月30日	

金融商品関係

1. 金融商品の時価等に関する事項

2021年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計 上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	36,349	36,349	-
資産計	36,349	36,349	-

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

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

区分	当中間会計期間(百万円)
市場価格のない株式等 ()1, 2	10,176
組合出資金等	1,637
合計	11,814

()1 市場価格のない株式等には非上場株式等が含まれております。

()2 非上場株式等について、当中間会計期間において77百万円減損処理を行っております。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3

つのレベルに分類しております。

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

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

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

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

(1) 時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

2021年9月30日現在				
	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託（運用目的・その他） （ ）	-	2,452	-	2,452
合計	-	2,452	-	2,452

() 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、投資信託を主要な構成物とする金銭の信託33,897百万円は表中に含まれておりません。

(2) 時価で中間貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

該当事項はありません。

(注) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

金銭の信託

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

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

有価証券関係

当中間会計期間末（2021年9月30日）

1．満期保有目的の債券(2021年9月30日)

該当事項はありません。

2．子会社株式及び関連会社株式(2021年9月30日)

市場価格のない子会社株式及び関連会社株式の貸借対照表計上額

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)
子会社株式	9,758
関連会社株式	106

合計	9,864
----	-------

これらについては市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

3. その他有価証券(2021年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えない もの			
譲渡性預金	11,600	11,600	-
小計	11,600	11,600	-
合計	11,600	11,600	-

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

当該資産除去債務の総額の増減 (単位：百万円)

	自 2021年4月 1日 至 2021年9月30日
期首残高	1,371
有形固定資産の取得に伴う増加 時の経過による調整額	48 -
中間期末残高	1,419

収益認識に関する注記

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

	自 2021年4月 1日 至 2021年9月30日
委託者報酬	57,003百万円
運用受託報酬	8,273百万円
成功報酬(注)	51百万円
その他営業収益	219百万円
合計	65,547百万円

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

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

[重要な会計方針] 5 収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

セグメント情報等

当中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

1 株当たり情報

	自 2021年4月 1日 至 2021年9月30日
1 株当たり純資産額	14,666円31銭
1 株当たり中間純利益	2,745円08銭
(注) 1. 潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。	
2. 1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。	
中間純利益	14,139百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	14,139百万円
期中平均株式数	5,150千株

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

して内閣府令で定めるものを除きます。)。

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

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

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

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託者

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

* 2022年2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。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社山陰合同銀行	20,705百万円	
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	

株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
住友生命保険相互会社	639,000百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

* 2022年2月末現在

住友生命保険相互会社の資本金の額の箇所には「基金」および「基金償却積立金」の合計額を記載しています。

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・連絡等を行いません。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年 5月13日	有価証券届出書
2021年 5月13日	有価証券報告書
2021年11月16日	有価証券届出書の訂正届出書
2021年11月16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 公認会計士 亀井 純子
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 津村 健二郎
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 水永 真太郎
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記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

2022年4月8日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村DC運用戦略ファンド（マイルド）の2021年2月18日から2022年2月17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DC運用戦略ファンド（マイルド）の2022年2月17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. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月24日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第63期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判

断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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

利害関係

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

以 上

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