

【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13日提出
【計算期間】	のむらップ・ファンド（保守型） 第12期 のむらップ・ファンド（やや保守型） 第6期 のむらップ・ファンド（普通型） 第12期 のむらップ・ファンド（やや積極型） 第6期 のむらップ・ファンド（積極型） 第12期 (自 2021年2月19日至 2022年2月18日)
【ファンド名】	のむらップ・ファンド（保守型） のむらップ・ファンド（やや保守型） のむらップ・ファンド（普通型） のむらップ・ファンド（やや積極型） のむらップ・ファンド（積極型）
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【連絡場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【電話番号】	03-6387-5000
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

「のむらップ・ファンド」は、リスク水準が異なるスイッチング可能なファンドで構成されています。

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券、世界各国（日本を含む）の不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象¹とし、以下の投資方針に基づき分散投資を行ないます。

保守型 ²	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を図ることを目的として運用を行ないます。
やや保守型 ²	安定した収益の確保と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないます。
普通型 ²	信託財産の成長と安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行ないます。
やや積極型 ²	信託財産の成長と安定した収益の確保を図ることを目的として積極的な運用を行ないます。
積極型 ²	信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行ないます。

各資産への分散投資を行なうにあたっては、ファンドの投資助言会社である野村證券株式会社³が、独自に開発したモデルを用い最適化した結果を踏まえ、各ファンドごとに投資配分比率を決定します。

- 各ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「世界REITインデックス 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。
- 「保守型」、「やや保守型」、「普通型」、「やや積極型」、「積極型」の名称は、各ファンド間の相対的なリスク量を表すものです。また、いずれの名称も、元本を確保することを意味するものではありません。
- 野村證券株式会社は金融商品取引法に基づき、投資運用業および投資助言・代理業の登録を行なっています。

信託金の限度額

受益権の信託金限度額は、各ファンドにつき1兆円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

<商品分類>

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

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

（のむらップ・ファンド（保守型））

（のむラップ・ファンド（やや保守型））

（のむラップ・ファンド（普通型））

（のむラップ・ファンド（やや積極型））

（のむラップ・ファンド（積極型））

《商品分類表》

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

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

- (1)一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのものをいう。
- (2)公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (3)社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (4)その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

- (5) 格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記(1)から(4)に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1) グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2) 日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) 欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5) アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6) オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7) 中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8) アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9) 中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10) エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

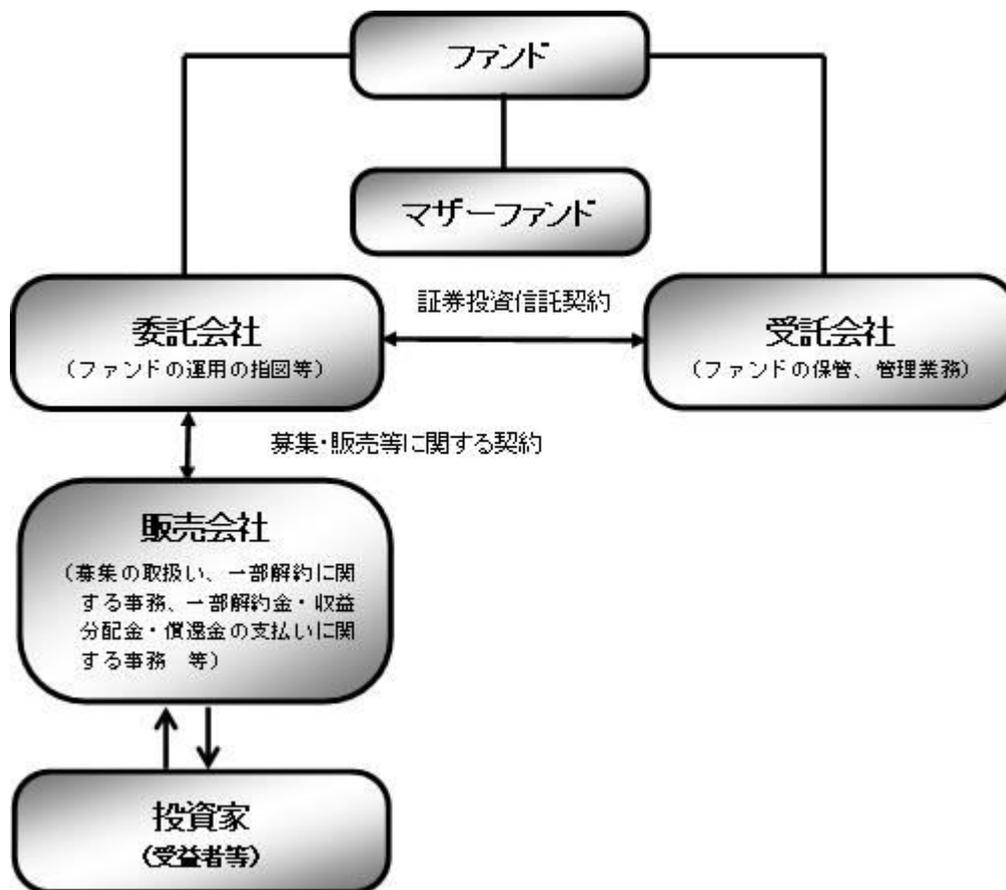
の記載があるものをいう。

- (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】

- 2010年3月15日 「保守型」「普通型」「積極型」につき信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始
- 2016年11月11日 「やや保守型」「やや積極型」につき信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

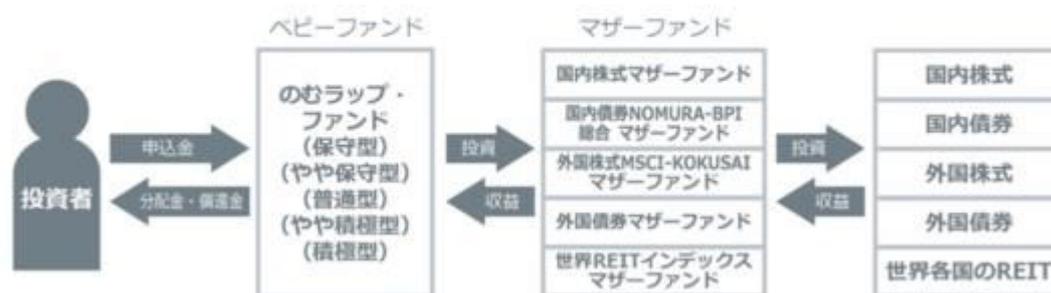
(3)【ファンドの仕組み】



ファンド	のむラップ・ファンド（保守型） のむラップ・ファンド（やや保守型） のむラップ・ファンド（普通型） のむラップ・ファンド（やや積極型） のむラップ・ファンド（積極型）
------	---

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NOMURA-BPI総合 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 世界REITインデックス マザーファンド
委託会社(委託者)	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社(受託者)	野村信託銀行株式会社

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



委託会社の概況(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] マザーファンドへの投資を通じて、国内株式、国内債券、外国株式、外国債券、世界各国(日本を含む)の不動産投資信託証券(REIT)に分散投資を行ないます。

各マザーファンドは、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。

<国内株式> 国内株式マザーファンド	○主要投資対象 わが国の株式 ○対象指数 東証株価指数（TOPIX）
<国内債券> 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	○主要投資対象 わが国の公社債 ○対象指数 NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）
<外国株式> 外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	○主要投資対象 外国の株式 ○対象指数 MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）* * MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が円換算したものです。
<外国債券> 外国債券マザーファンド	○主要投資対象 外国の公社債 ○対象指数 FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
<世界各国のREIT> 世界REITインデックス マザーファンド	○主要投資対象 世界各国のREIT ○対象指数 S&P先進国REIT指数（配当込み、円換算ベース）* * S&P先進国REIT指数（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。

[2] 各マザーファンドへの投資配分比率は、ファンドの投資助言会社である野村証券株式会社、独自に開発したモデルを用い、各資産の期待リターンや推定リスク、各資産間の相関係数等をもとに最適化した結果を踏まえ決定します。

一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

[3] 各ファンドにおける、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「世界REITインデックスマザーファンド」の各受益証券への投資比率の合計は、信託財産の純資産総額に対して以下のとおりとします。

保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
原則50%以内	原則60%以内	原則75%以内	原則85%以内	制限なし

各ファンドにおける各マザーファンドへの投資比率は、上記制限のもと、下記を上限の目処とします。

	保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
国内株式マザーファンド	20%	25%	30%	35%	40%
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	80%	70%	60%	50%	40%
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	30%	35%	45%	50%	60%
外国債券マザーファンド	50%	50%	50%	50%	50%
世界REITインデックスマザーファンド	20%	25%	30%	35%	40%

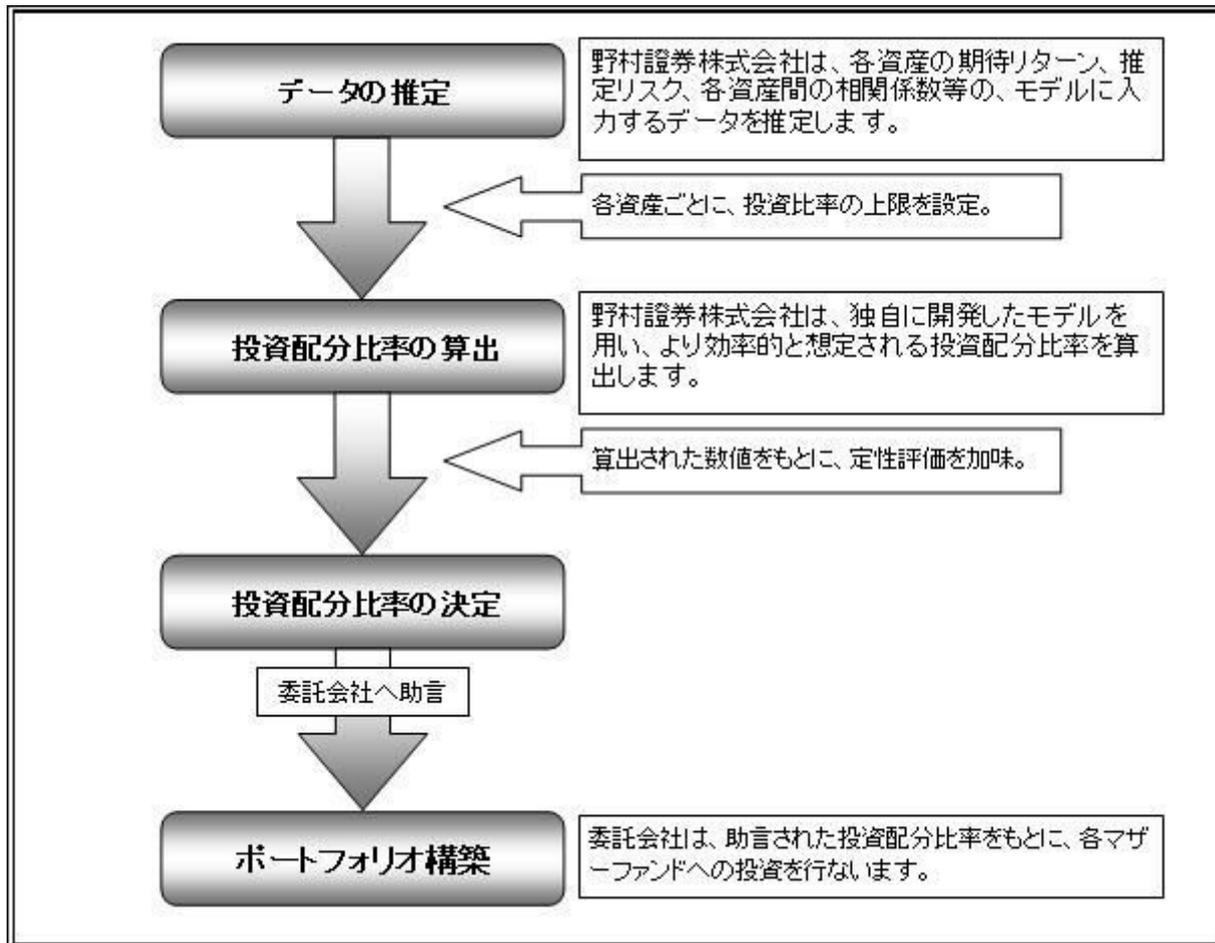
上記の各マザーファンドへの投資比率の上限の目処は、今後変更される場合があります。また、一時的に上限の目処を超える場合があります。

[4] 投資配分比率の見直しを定期的に行なうことを基本とします。

市況見通しの変化等によっては、適宜リバランスや投資配分比率の見直しを行なう場合があります。

[5] 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

ポートフォリオ構築プロセス



* 上記のポートフォリオ構築プロセスは、今後変更となる場合があります。

各マザーファンドが対象とする指数等の著作権等について

「東証株価指数（TOPIX）」

東証株価指数（TOPIX）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）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）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）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）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）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）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）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）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）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）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）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）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総合」

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

「MSCI-KOKUSAI指数」

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

ディングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

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

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

「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は一切負いません。

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

はなく、参加もしておりません。

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

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

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券、世界各国（日本を含む）の不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象とします。

各ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「世界REITインデックスマザーファンド」の各受益証券への投資を通じて、実質的に国内株式、国内債券、外国株式、外国債券、世界各国（日本を含む）の不動産投資信託証券（REIT）に投資を行ないます。

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。

なお、デリバティブの直接利用は行ないません。

<各ファンドに共通>

投資の対象とする資産の種類(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限るものとします。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ハ．金銭債権（イ及びロに掲げるものに該当するものを除きます。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

委託者は、信託金を、主として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の受益証券、国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンドの受益証券、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドの受益証券、外国債券マザーファンドの受益証券、世界REITインデックスマザーファンドの受益証券のほか、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くものとし、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
4. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記 に掲げるものを除く。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

(参考)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NOMURA-BPI総合 マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

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

（外国株式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。

(世界REITインデックス マザーファンド)
運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、S&P先進国REIT指数(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いません。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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。

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。

(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いません。

不動産投信指数先物取引は約款第15条の2の範囲で行いません。

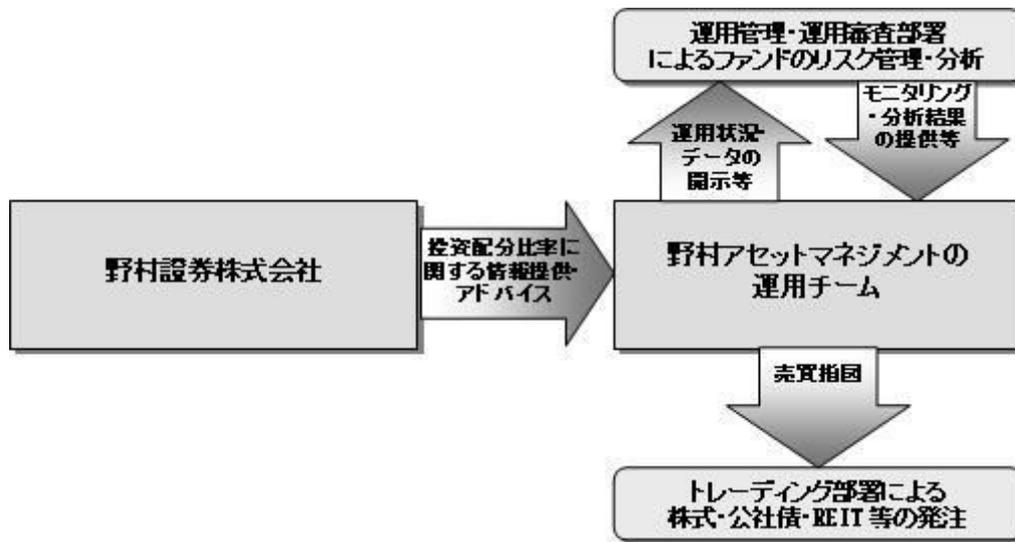
同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S&P先進国REIT指数(配当込み、円換算ベース)における時価の構成割合が30%を超えるREITがある場合には、当該REITをS&P先進国REIT指数(配当込み、円換算ベース)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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。)の利用は行いません。

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

(3) 【運用体制】

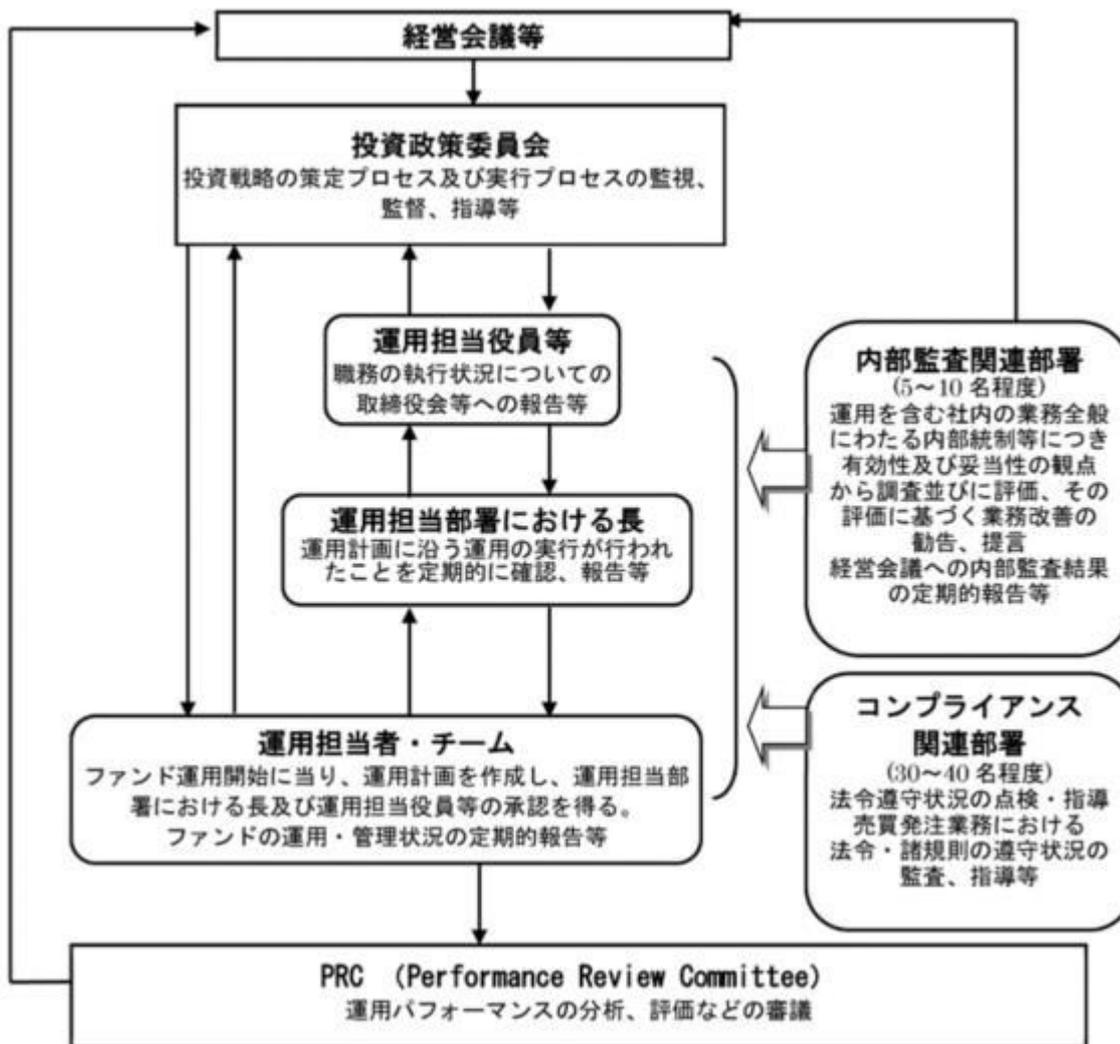
ファンドの運用体制は以下の通りです。



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

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

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

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

います。

利子・配当等収益とは、利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

売買益とは、売買損益に評価損益を加減した利益金額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。

なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

* 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18日**(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

分配金のお支払い

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

「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、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。

(5) 【投資制限】

<各ファンドに共通>

外貨建資産への投資割合(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

外貨建資産への直接投資は行ないません。

デリバティブの使用(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

デリバティブの直接利用は行ないません。

株式への投資割合(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

株式への直接投資は行ないません。

公社債の借入れ(約款第19条)

()委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。

なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行なうものとします。

()上記()の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

()信託財産の一部解約等の事由により、上記()の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

()上記()の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

資金の借入れ(約款第25条)

- ()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。

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。(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

3【投資リスク】

基準価額の変動要因

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

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

[株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

[REITの価格変動リスク]

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

[債券価格変動リスク]

債券(公社債等)は、市場金利や信用度の変動により価格が変動します。ファンドは実質的に債券に投資を行ないますので、これらの影響を受けます。

[為替変動リスク]

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

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。

ファンドで使用するモデルは、委託会社が信頼できると判断したデータ等の評価に基づき採用しておりますが、今後の運用成果を保証するものではありません。また、今後使用するモデルが変更となる場合があります。

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。

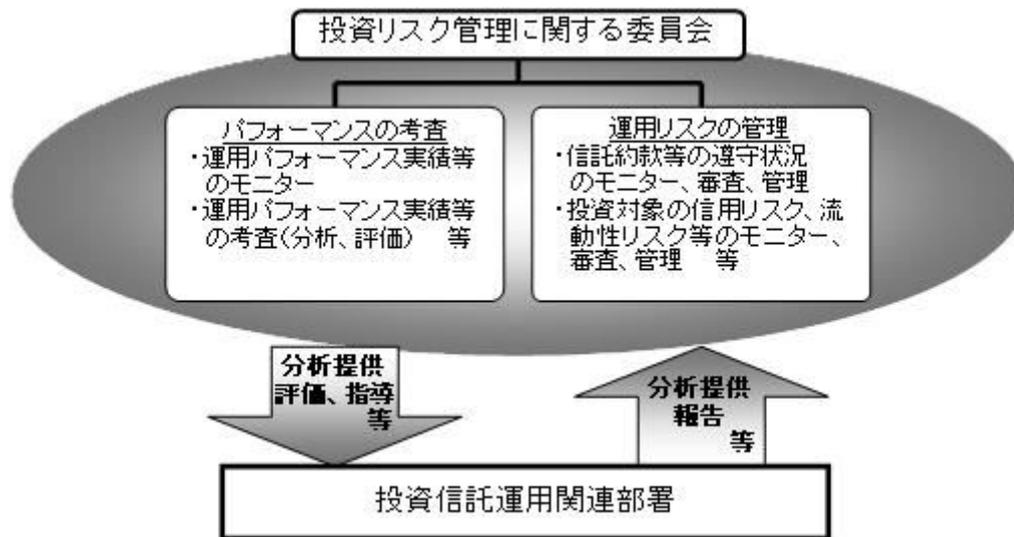
運用リスクの管理

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

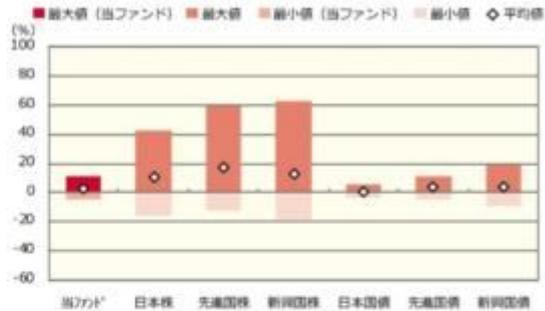
■ リスクの定量的比較 (2017年4月末～2022年3月末：月次)

保守型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	10.9	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 4.8	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	3.1	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。

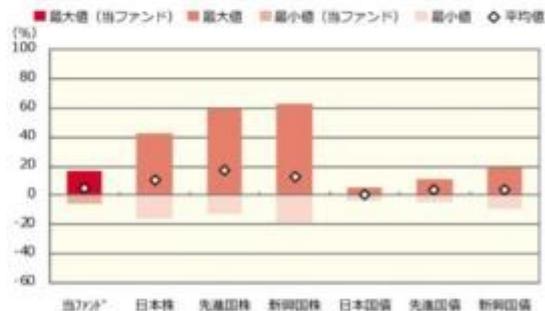
- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2017年4月から2022年3月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

やや保守型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	17.1	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 6.3	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	4.6	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11月から2022年3月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2017年4月から2022年3月の5年間（当ファンドは2017年11月から2022年3月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。



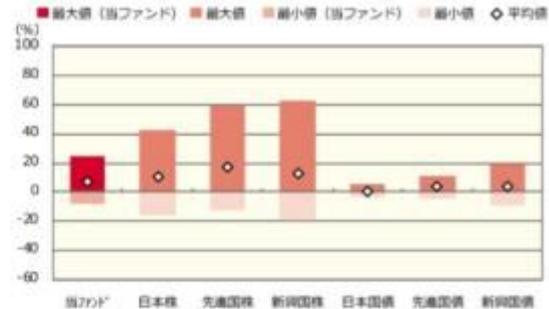
投資リスク

普通型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド*	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	24.8	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 8.1	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	7.1	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。

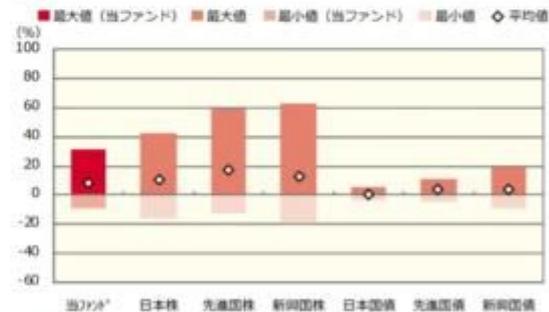
- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2017年4月から2022年3月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

やや積極型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド*	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	30.8	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 9.4	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	7.9	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11月から2022年3月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2017年4月から2022年3月の5年間（当ファンドは2017年11月から2022年3月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。



投資リスク

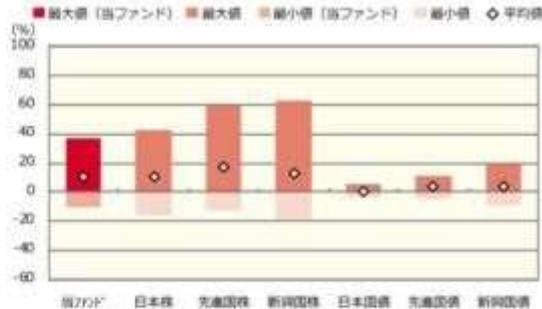
積極型

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 (%)	36.7	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 10.1	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	10.2	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-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）
- 新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
- 日本国債：NOMURA-BPI 国債
- 先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）
- 新興国債：JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（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）に係る標章又は商標は、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、指数値の公表、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）に係る標章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-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
- JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）について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を法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを予想するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J P Morgan Securities LLC（ここでは「JPMS LLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての推奨、保険または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMS LLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPST, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

各ファンドにつき、取得申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率)(税抜1.0%)以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

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

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、各ファンドについて、ファンドの計算期間を通じて毎日、当該ファンドの純資産総額に下記の信託報酬率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り(税抜)とします。

ファンド	信託報酬率	< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
保守型	年1.188% (税抜年1.08%)	年0.70%	年0.35%	年0.03%
やや保守型	年1.2705% (税抜年1.155%)	年0.75%	年0.375%	年0.03%
普通型	年1.353% (税抜年1.23%)	年0.80%	年0.40%	年0.03%
やや積極型	年1.4355% (税抜年1.305%)	年0.85%	年0.425%	年0.03%
積極型	年1.518% (税抜年1.38%)	年0.90%	年0.45%	年0.03%

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。

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬から、毎年2月および8月ならびに信託契約終了のとき支払うものとし、その報酬額は、各ファンドの日々の平均純資産総額に、次の率を乗じて得た額とします。

ファンド	率
保守型	年0.35%
やや保守型	年0.375%
普通型	年0.40%
やや積極型	年0.425%
積極型	年0.45%

支払先の役務の内容

< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
----------	----------	----------

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額 をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

なお、配当控除は適用されません。

< 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対する課税 >

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

損益通算について

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

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

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

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

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

法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

[個人の投資家の場合]

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

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

[法人の投資家の場合]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

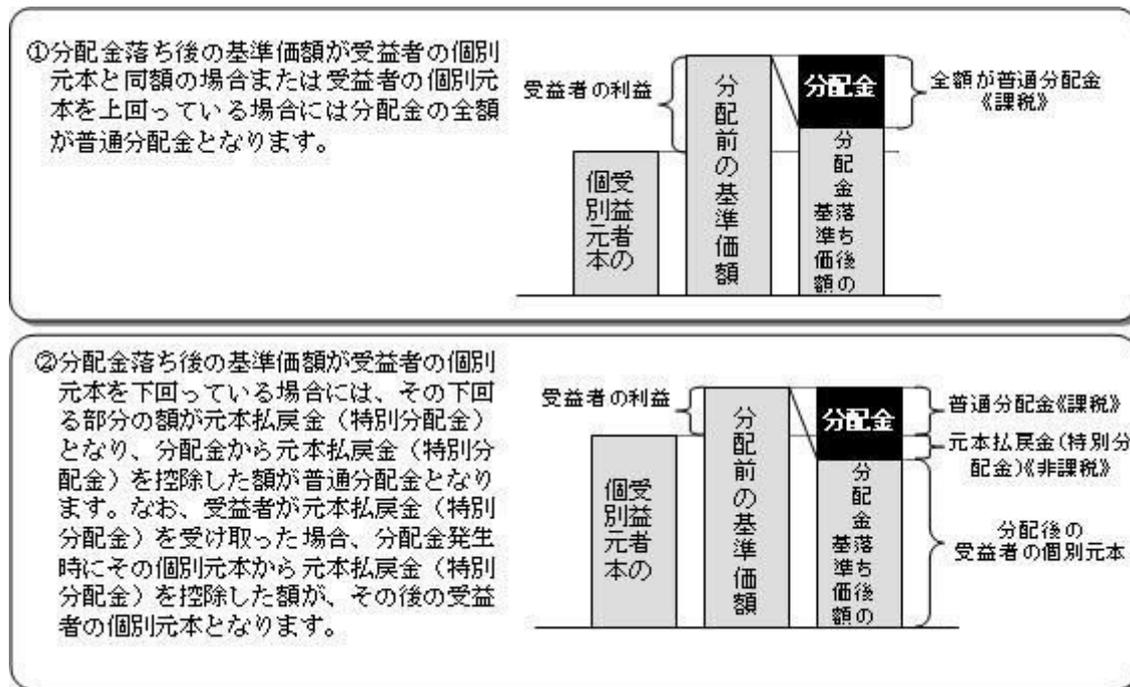
追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

分配金の課税について

分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受

益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）があります。



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

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

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（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】

のむラップ・ファンド（保守型）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	50,137,672,654	98.82
現金・預金・その他資産（負債控除後）		593,574,455	1.17
合計（純資産総額）		50,731,247,109	100.00

のむラップ・ファンド（やや保守型）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	6,574,703,408	98.84

現金・預金・その他資産(負債控除後)		76,779,600	1.15
合計(純資産総額)		6,651,483,008	100.00

のむラップ・ファンド(普通型)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	176,510,805,785	98.96
現金・預金・その他資産(負債控除後)		1,848,023,542	1.03
合計(純資産総額)		178,358,829,327	100.00

のむラップ・ファンド(やや積極型)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	9,312,494,658	98.98
現金・預金・その他資産(負債控除後)		95,953,023	1.01
合計(純資産総額)		9,408,447,681	100.00

のむラップ・ファンド(積極型)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	81,108,645,794	98.90
現金・預金・その他資産(負債控除後)		899,489,504	1.09
合計(純資産総額)		82,008,135,298	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NOMURA - BPI総合 マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	667,251,907,550	80.02
地方債証券	日本	57,337,944,926	6.87
特殊債券	日本	66,316,586,985	7.95
社債券	日本	40,993,825,400	4.91
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,919,775,223	0.23
合計（純資産総額）		833,820,040,084	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）世界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	8,751,541,200	7.31
	アメリカ	84,173,239,598	70.33
	カナダ	2,111,469,508	1.76
	ドイツ	61,873,291	0.05
	イタリア	28,179,553	0.02
	フランス	1,958,640,661	1.63
	オランダ	221,387,290	0.18
	スペイン	456,110,486	0.38
	ベルギー	1,422,923,970	1.18
	アイルランド	126,190,504	0.10
	シンガポール	54,379,260	0.04
	イギリス	6,134,635,843	5.12
	オーストラリア	7,537,649,927	6.29
	ニュージーランド	403,768,760	0.33
	香港	1,491,029,015	1.24
	シンガポール	3,495,833,192	2.92
	韓国	230,839,500	0.19
イスラエル	85,480,151	0.07	
	小計	118,745,171,709	99.21
現金・預金・その他資産（負債控除後）		937,371,325	0.78
合計（純資産総額）		119,682,543,034	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	59,835,000	0.04

株価指数先物取引	買建	アメリカ		712,615,775	0.59
----------	----	------	--	-------------	------

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

のむラップ・ファンド(保守型)

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA - B P I 総 合 マザーファンド	16,059,759,182	1.3072	20,994,106,371	1.3090	21,022,224,769	41.43
2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	6,475,015,461	2.4980	16,175,106,503	2.5743	16,668,632,301	32.85
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	2,479,324,412	2.0311	5,035,755,814	2.0821	5,162,201,358	10.17
4	日本	親投資信託 受益証券	世界REITインデックス マ ザーファンド	1,399,844,824	2.3271	3,257,578,890	2.6313	3,683,411,685	7.26
5	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド	757,972,373	4.3040	3,262,313,094	4.7511	3,601,202,541	7.09

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	98.82
合 計	98.82

のむラップ・ファンド(やや保守型)

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	811,725,485	2.4988	2,028,390,908	2.5743	2,089,624,916	31.41
2	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA - B P I 総 合 マザーファンド	1,448,753,728	1.3071	1,893,764,920	1.3090	1,896,418,629	28.51
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド	210,761,252	4.3024	906,779,211	4.7511	1,001,347,784	15.05
4	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	429,383,434	2.0301	871,691,310	2.0821	894,019,247	13.44
5	日本	親投資信託 受益証券	世界REITインデックス マ ザーファンド	263,479,205	2.3271	613,142,458	2.6313	693,292,832	10.42

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	98.84
合 計	98.84

のむラップ・ファンド（普通型）

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	20,657,827,654	2.4991	51,627,801,050	2.5743	53,179,445,729	29.81
2	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	9,420,417,936	4.3029	40,535,116,337	4.7511	44,757,347,655	25.09
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	12,928,333,266	2.0304	26,249,953,223	2.0821	26,918,082,693	15.09
4	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA-BPI総 合マザーファンド	20,112,939,733	1.3072	26,292,318,664	1.3090	26,327,838,110	14.76
5	日本	親投資信託 受益証券	世界REITインデックスマ ザーファンド	9,625,695,131	2.3272	22,400,917,709	2.6313	25,328,091,598	14.20

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.96
合計	98.96

のむラップ・ファンド（やや積極型）

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	748,143,465	4.3001	3,217,091,714	4.7511	3,554,504,416	37.77
2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	872,595,259	2.4996	2,181,139,539	2.5743	2,246,321,975	23.87
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	669,956,273	2.0287	1,359,149,226	2.0821	1,394,915,956	14.82
4	日本	親投資信託 受益証券	世界REITインデックスマ ザーファンド	524,665,678	2.3273	1,221,088,074	2.6313	1,380,552,798	14.67
5	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA-BPI総 合マザーファンド	562,413,685	1.3072	735,221,803	1.3090	736,199,513	7.82

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	98.98
合計	98.98

のむラップ・ファンド（積極型）

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	8,947,634,713	4.3022	38,494,514,063	4.7511	42,511,107,284	51.83

2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	5,503,289,181	2.5002	13,759,548,352	2.5743	14,167,117,338	17.27
3	日本	親投資信託 受益証券	世界REITインデックス マザーファンド	4,441,359,379	2.3272	10,336,319,185	2.6313	11,686,548,933	14.25
4	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	4,417,220,250	2.0323	8,977,330,040	2.0821	9,197,094,282	11.21
5	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA - B P I 総 合マザーファンド	2,709,532,435	1.3072	3,542,049,559	1.3090	3,546,777,957	4.32

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	98.90
合計	98.90

(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	S M C	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NOMURA - BPI総合 マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第360回	10,900,000,000	100.14	10,916,112,000	99.45	10,840,704,000	0.1	2030/9/20	1.30
2	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第359回	10,600,000,000	100.25	10,626,820,000	99.55	10,552,618,000	0.1	2030/6/20	1.26
3	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第363回	10,450,000,000	100.28	10,480,165,500	99.13	10,360,025,500	0.1	2031/6/20	1.24
4	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第350回	10,150,000,000	100.66	10,217,160,000	100.20	10,171,112,000	0.1	2028/3/20	1.21
5	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第141回	9,600,000,000	100.65	9,662,589,000	100.33	9,631,968,000	0.1	2024/9/20	1.15
6	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第343回	9,500,000,000	100.97	9,592,534,000	100.40	9,538,000,000	0.1	2026/6/20	1.14
7	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第338回	9,000,000,000	101.72	9,154,960,000	101.29	9,116,280,000	0.4	2025/3/20	1.09
8	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第364回	8,650,000,000	100.32	8,677,841,500	99.02	8,565,576,000	0.1	2031/9/20	1.02
9	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第362回	8,500,000,000	100.23	8,520,013,000	99.25	8,436,250,000	0.1	2031/3/20	1.01
10	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第365回	7,500,000,000	99.05	7,429,445,000	98.95	7,421,400,000	0.1	2031/12/20	0.89
11	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第361回	7,400,000,000	100.07	7,405,180,000	99.35	7,352,270,000	0.1	2030/12/20	0.88
12	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第148回	7,300,000,000	100.48	7,335,407,000	100.00	7,300,000,000	0.005	2026/6/20	0.87
13	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第138回	7,100,000,000	100.62	7,144,134,000	100.25	7,118,318,000	0.1	2023/12/20	0.85
14	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第149回	7,100,000,000	100.46	7,133,096,000	99.95	7,096,805,000	0.005	2026/9/20	0.85
15	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第345回	7,000,000,000	100.97	7,068,095,000	100.35	7,024,710,000	0.1	2026/12/20	0.84
16	日本	国債証券	国庫債券 利付(2年)第427回	6,800,000,000	100.26	6,817,956,000	100.09	6,806,324,000	0.005	2023/8/1	0.81
17	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第139回	6,700,000,000	100.61	6,741,485,000	100.27	6,718,425,000	0.1	2024/3/20	0.80
18	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第334回	6,600,000,000	102.37	6,756,816,000	101.42	6,693,786,000	0.6	2024/6/20	0.80
19	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第137回	6,600,000,000	100.54	6,635,949,000	100.23	6,615,510,000	0.1	2023/9/20	0.79

20	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年) 第342回	6,550,000,000	100.93	6,610,915,000	100.41	6,577,248,000	0.1	2026/3/20	0.78
21	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年) 第344回	6,400,000,000	100.99	6,463,360,000	100.37	6,424,256,000	0.1	2026/9/20	0.77
22	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年) 第352回	6,400,000,000	100.97	6,462,200,000	100.09	6,406,144,000	0.1	2028/9/20	0.76
23	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年) 第143回	6,070,000,000	100.87	6,123,123,200	100.40	6,094,280,000	0.1	2025/3/20	0.73
24	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年) 第329回	6,000,000,000	102.08	6,124,860,000	101.06	6,063,660,000	0.8	2023/6/20	0.72
25	日本	国債証券	国庫債券 利付(40年) 第13回	7,020,000,000	93.56	6,568,409,500	86.24	6,054,048,000	0.5	2060/3/20	0.72
26	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年) 第351回	6,000,000,000	100.90	6,054,000,000	100.15	6,009,240,000	0.1	2028/6/20	0.72
27	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年) 第332回	5,900,000,000	102.02	6,019,180,000	101.11	5,966,021,000	0.6	2023/12/20	0.71
28	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年) 第341回	5,800,000,000	101.89	5,909,620,000	101.17	5,867,976,000	0.3	2025/12/20	0.70
29	日本	国債証券	国庫債券 利付(20年) 第176回	6,020,000,000	101.04	6,082,701,300	96.97	5,837,895,000	0.5	2041/3/20	0.70
30	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年) 第348回	5,800,000,000	100.94	5,854,520,000	100.30	5,817,400,000	0.1	2027/9/20	0.69

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	80.02
地方債証券	6.87
特殊債券	7.95
社債券	4.91
合計	99.76

(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) 世界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	404,400	18,796.47	7,601,295,802	20,089.09	8,124,029,856	6.78
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	49,220	89,294.97	4,395,098,872	92,258.80	4,540,978,426	3.79
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	83,400	43,747.50	3,648,542,294	48,486.02	4,043,734,268	3.37
4	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	179,700	18,136.94	3,259,209,228	16,496.94	2,964,501,574	2.47
5	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	238,000	10,472.82	2,492,531,587	11,977.08	2,850,546,325	2.38
6	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	155,200	18,890.21	2,931,761,024	17,643.74	2,738,308,820	2.28
7	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	309,400	8,386.68	2,594,841,059	8,601.56	2,661,325,510	2.22
8	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	76,400	30,089.01	2,298,800,823	30,836.16	2,355,882,662	1.96
9	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	186,900	10,915.41	2,040,091,128	11,198.68	2,093,034,227	1.74
10	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	79,600	25,144.30	2,001,486,385	24,732.57	1,968,712,668	1.64
11	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	927,000	2,107.53	1,953,689,404	2,121.52	1,966,649,040	1.64
12	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	73,300	24,276.64	1,779,478,268	25,573.39	1,874,529,524	1.56
13	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	218,400	6,231.88	1,361,044,482	7,689.76	1,679,444,392	1.40
14	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	63,100	25,581.51	1,614,193,510	26,070.29	1,645,035,545	1.37
15	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	326,500	5,228.89	1,707,233,531	5,006.97	1,634,777,305	1.36
16	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	35,700	41,479.32	1,480,811,836	42,679.84	1,523,670,317	1.27
17	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	208,400	7,107.58	1,481,221,548	7,234.47	1,507,664,152	1.25
18	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	656,000	2,119.34	1,390,289,227	2,188.90	1,435,923,943	1.19
19	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	63,500	23,682.57	1,503,843,748	21,798.88	1,384,229,064	1.15
20	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	295,200	4,353.33	1,285,104,179	4,262.84	1,258,391,460	1.05
21	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	77,800	14,696.70	1,143,403,852	16,015.95	1,246,041,330	1.04
22	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	344,000	3,403.13	1,170,679,075	3,541.96	1,218,436,510	1.01
23	香港	投資証券	LINK REIT	1,147,000	1,047.24	1,201,190,070	1,058.04	1,213,578,762	1.01
24	アメリカ	投資証券	UDR INC	163,700	7,024.52	1,149,915,368	7,101.06	1,162,444,799	0.97
25	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	55,900	19,892.88	1,112,012,042	20,758.56	1,160,403,946	0.96
26	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	158,500	5,324.97	844,009,028	6,787.74	1,075,858,280	0.89
27	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	103,800	9,496.62	985,749,668	10,065.35	1,044,783,704	0.87
28	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	338,000	2,961.84	1,001,103,692	3,059.75	1,034,195,500	0.86
29	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	389,000	2,127.11	827,449,416	2,439.23	948,861,520	0.79
30	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,100	9,561.79	899,765,139	9,472.98	891,407,983	0.74

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.21
合計	99.21

【投資不動産物件】

のむラップ・ファンド(保守型)

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（やや保守型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（普通型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（やや積極型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（積極型）

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAI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）世界REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

のむラップ・ファンド（保守型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（やや保守型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（普通型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（やや積極型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（積極型）

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(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NOMURA - B P I総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式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	SPI200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）世界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 (%)
REIT指数先物取引	日本	大阪取引所	REIT指数先物 (2022年06月限)	買建	30	日本円	56,043,300	56,043,300	59,835,000	59,835,000	0.04
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	137	米ドル	5,425,630	664,042,858	5,822,500	712,615,775	0.59

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

のむラップ・ファンド（保守型）

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3計算期間	(2013年 2月18日)	5,672	5,677	1.1314	1.1324
第4計算期間	(2014年 2月18日)	9,827	9,835	1.2452	1.2462
第5計算期間	(2015年 2月18日)	14,449	14,460	1.3886	1.3896
第6計算期間	(2016年 2月18日)	21,912	21,929	1.3443	1.3453
第7計算期間	(2017年 2月20日)	30,711	30,733	1.3697	1.3707
第8計算期間	(2018年 2月19日)	35,454	35,480	1.4018	1.4028
第9計算期間	(2019年 2月18日)	40,084	40,112	1.4138	1.4148
第10計算期間	(2020年 2月18日)	42,494	42,523	1.4787	1.4797
第11計算期間	(2021年 2月18日)	41,691	41,719	1.5157	1.5167
第12計算期間	(2022年 2月18日)	48,732	48,763	1.5470	1.5480
	2021年 3月末日	42,629		1.5399	
	4月末日	42,810		1.5450	
	5月末日	43,750		1.5570	
	6月末日	44,550		1.5635	
	7月末日	45,320		1.5695	

8月末日	46,196		1.5774	
9月末日	46,631		1.5722	
10月末日	47,593		1.5963	
11月末日	48,044		1.5833	
12月末日	49,127		1.6010	
2022年 1月末日	48,627		1.5623	
2月末日	48,929		1.5458	
3月末日	50,731		1.5908	

のむラップ・ファンド（やや保守型）

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 (2017年 2月20日)	1,754	1,756	1.0428	1.0438
第2計算期間 (2018年 2月19日)	2,561	2,564	1.0771	1.0781
第3計算期間 (2019年 2月18日)	3,292	3,295	1.0905	1.0915
第4計算期間 (2020年 2月18日)	4,330	4,334	1.1619	1.1629
第5計算期間 (2021年 2月18日)	4,097	4,101	1.2108	1.2118
第6計算期間 (2022年 2月18日)	6,168	6,173	1.2645	1.2655
2021年 3月末日	4,311		1.2381	
4月末日	4,427		1.2469	
5月末日	4,765		1.2589	
6月末日	4,943		1.2681	
7月末日	5,113		1.2735	
8月末日	5,309		1.2844	
9月末日	5,431		1.2792	
10月末日	5,698		1.3085	
11月末日	5,716		1.2956	
12月末日	6,097		1.3184	
2022年 1月末日	6,067		1.2757	
2月末日	6,228		1.2622	
3月末日	6,651		1.3155	

のむラップ・ファンド（普通型）

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3計算期間 (2013年 2月18日)	6,993	6,999	1.2232	1.2242
第4計算期間 (2014年 2月18日)	11,197	11,205	1.4361	1.4371

第5計算期間	(2015年 2月18日)	21,005	21,017	1.7185	1.7195
第6計算期間	(2016年 2月18日)	37,150	37,173	1.5776	1.5786
第7計算期間	(2017年 2月20日)	45,690	45,717	1.6899	1.6909
第8計算期間	(2018年 2月19日)	58,457	58,490	1.7636	1.7646
第9計算期間	(2019年 2月18日)	75,805	75,847	1.7954	1.7964
第10計算期間	(2020年 2月18日)	92,176	92,223	1.9561	1.9571
第11計算期間	(2021年 2月18日)	103,707	103,757	2.0652	2.0662
第12計算期間	(2022年 2月18日)	163,445	163,518	2.2197	2.2207
	2021年 3月末日	109,787		2.1286	
	4月末日	112,827		2.1559	
	5月末日	118,079		2.1816	
	6月末日	124,575		2.2058	
	7月末日	130,354		2.2174	
	8月末日	136,338		2.2448	
	9月末日	140,654		2.2317	
	10月末日	149,184		2.3037	
	11月末日	152,879		2.2770	
	12月末日	162,744		2.3330	
	2022年 1月末日	161,523		2.2366	
	2月末日	164,246		2.2138	
	3月末日	178,358		2.3410	

のむラップ・ファンド（やや積極型）

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	(2017年 2月20日)	448	448	1.0761	1.0771
第2計算期間	(2018年 2月19日)	1,565	1,566	1.1287	1.1297
第3計算期間	(2019年 2月18日)	2,229	2,231	1.1485	1.1495
第4計算期間	(2020年 2月18日)	3,070	3,072	1.2717	1.2727
第5計算期間	(2021年 2月18日)	4,445	4,448	1.3517	1.3527
第6計算期間	(2022年 2月18日)	8,492	8,497	1.4851	1.4861
	2021年 3月末日	4,829		1.3998	
	4月末日	4,999		1.4266	
	5月末日	5,331		1.4447	
	6月末日	5,670		1.4654	
	7月末日	6,019		1.4752	
	8月末日	6,371		1.4976	
	9月末日	6,469		1.4840	
	10月末日	7,143		1.5448	

11月末日	7,570		1.5271
12月末日	8,262		1.5725
2022年 1月末日	8,313		1.4952
2月末日	8,508		1.4807
3月末日	9,408		1.5843

のむラップ・ファンド（積極型）

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3計算期間 (2013年 2月18日)	5,173	5,177	1.2607	1.2617
第4計算期間 (2014年 2月18日)	7,914	7,919	1.5322	1.5332
第5計算期間 (2015年 2月18日)	12,370	12,377	1.8855	1.8865
第6計算期間 (2016年 2月18日)	15,939	15,949	1.6702	1.6712
第7計算期間 (2017年 2月20日)	19,026	19,036	1.8662	1.8672
第8計算期間 (2018年 2月19日)	22,241	22,253	1.9744	1.9754
第9計算期間 (2019年 2月18日)	26,325	26,338	2.0233	2.0243
第10計算期間 (2020年 2月18日)	32,358	32,372	2.2782	2.2792
第11計算期間 (2021年 2月18日)	39,717	39,733	2.4423	2.4433
第12計算期間 (2022年 2月18日)	73,291	73,317	2.7430	2.7440
2021年 3月末日	42,906		2.5405	
4月末日	45,068		2.6063	
5月末日	47,572		2.6409	
6月末日	51,581		2.6865	
7月末日	55,278		2.7091	
8月末日	58,516		2.7567	
9月末日	60,072		2.7216	
10月末日	64,797		2.8567	
11月末日	67,178		2.8276	
12月末日	73,320		2.9223	
2022年 1月末日	71,813		2.7601	
2月末日	73,590		2.7352	
3月末日	82,008		2.9559	

【分配の推移】

のむラップ・ファンド（保守型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0.0010円

第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0.0010円
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0.0010円
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0.0010円
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円
第12計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0.0010円

のむラップ・ファンド（やや保守型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	0.0010円
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円
第6計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0.0010円

のむラップ・ファンド（普通型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0.0010円
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0.0010円
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0.0010円
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0.0010円
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円
第12計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0.0010円

のむラップ・ファンド（やや積極型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	0.0010円
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円

第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円
第6計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0.0010円

のむラップ・ファンド（積極型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0.0010円
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0.0010円
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0.0010円
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0.0010円
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円
第12計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0.0010円

【収益率の推移】

のむラップ・ファンド（保守型）

	計算期間	収益率
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	14.2%
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	10.1%
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	11.6%
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	3.1%
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	2.0%
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	2.4%
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.9%
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	4.7%
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	2.6%
第12計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	2.1%

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。

のむラップ・ファンド（やや保守型）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	4.4%

第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	3.4%
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	1.3%
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	6.6%
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	4.3%
第6計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	4.5%

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。

のむラップ・ファンド（普通型）

	計算期間	収益率
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	23.3%
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	17.5%
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	19.7%
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	8.1%
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	7.2%
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	4.4%
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	1.9%
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	9.0%
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	5.6%
第12計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	7.5%

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。

のむラップ・ファンド（やや積極型）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	7.7%
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	5.0%
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	1.8%
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	10.8%
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	6.4%
第6計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	9.9%

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

のむラップ・ファンド（積極型）

	計算期間	収益率

第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	27.1%
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	21.6%
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	23.1%
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	11.4%
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	11.8%
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	5.9%
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	2.5%
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	12.6%
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	7.2%
第12計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	12.4%

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

（４）【設定及び解約の実績】

のむラップ・ファンド（保守型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	1,608,337,173	2,703,541,712	5,013,380,932
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	3,849,180,143	970,300,281	7,892,260,794
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	5,232,995,552	2,719,491,723	10,405,764,623
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	8,647,464,358	2,752,459,905	16,300,769,076
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	10,074,422,211	3,953,141,382	22,422,049,905
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	8,245,634,392	5,375,777,007	25,291,907,290
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	6,683,674,568	3,622,632,363	28,352,949,495
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	7,256,673,085	6,871,185,722	28,738,436,858
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	5,853,220,978	7,084,358,604	27,507,299,232
第12計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	9,295,649,362	5,302,580,330	31,500,368,264

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

のむラップ・ファンド（やや保守型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	1,683,928,835	1,075,577	1,682,853,258
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	1,216,556,735	520,704,097	2,378,705,896
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	827,317,233	187,003,223	3,019,019,906
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	1,362,550,967	654,402,581	3,727,168,292
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	1,382,305,912	1,725,139,133	3,384,335,071
第6計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	2,299,623,862	805,460,496	4,878,498,437

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

のむらップ・ファンド（普通型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	1,357,750,676	2,306,257,102	5,717,488,363
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	3,301,811,164	1,221,662,831	7,797,636,696
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	6,938,730,583	2,513,534,586	12,222,832,693
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	14,624,481,293	3,298,164,142	23,549,149,844
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	8,370,562,015	4,882,793,242	27,036,918,617
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	13,898,310,644	7,788,778,406	33,146,450,855
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	14,762,704,987	5,687,029,247	42,222,126,595
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	17,015,753,904	12,114,213,571	47,123,666,928
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	17,367,085,936	14,274,396,250	50,216,356,614
第12計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	35,642,462,288	12,225,527,102	73,633,291,800

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

のむらップ・ファンド（やや積極型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	418,434,475	2,119,224	416,315,251
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	1,136,667,950	165,912,216	1,387,070,985
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	748,002,975	193,991,442	1,941,082,518
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	1,250,105,711	776,826,920	2,414,361,309
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	1,873,074,115	998,933,831	3,288,501,593
第6計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	3,455,675,677	1,026,066,157	5,718,111,113

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

のむらップ・ファンド（積極型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	959,956,709	2,366,840,325	4,103,919,311
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	2,155,523,440	1,094,037,100	5,165,405,651
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	3,164,392,511	1,768,791,397	6,561,006,765
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	4,833,876,039	1,851,238,866	9,543,643,938
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	2,890,629,040	2,239,285,849	10,194,987,129
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	4,305,044,963	3,234,715,551	11,265,316,541
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	4,187,189,703	2,441,328,586	13,011,177,658
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	5,773,245,162	4,580,921,634	14,203,501,186
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	7,849,562,545	5,791,022,042	16,262,041,689
第12計算期間	2021年 2月19日～2022年 2月18日	15,921,073,680	5,463,445,749	26,719,669,620

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

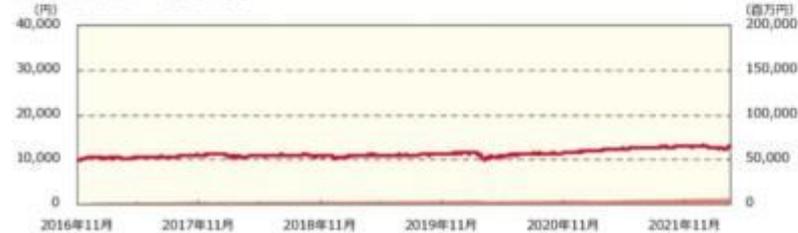


運用実績（2022年3月31日現在）

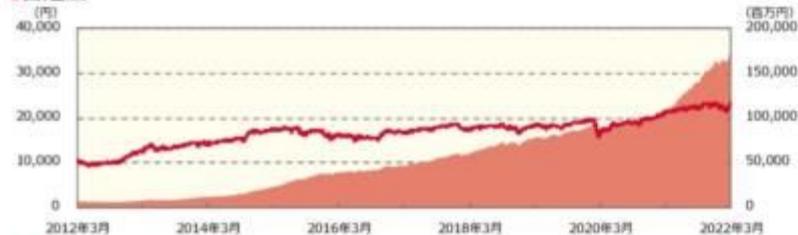
■ 基準価額・純資産の推移（日次）



■ やや保守型（設定来）



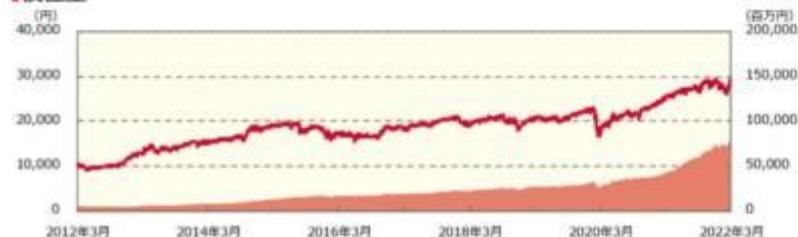
■ 普通型



■ やや積極型（設定来）



■ 積極型



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

保守型

2022年2月	10 円
2021年2月	10 円
2020年2月	10 円
2019年2月	10 円
2018年2月	10 円
設定来累計	100 円

■ やや保守型

2022年2月	10 円
2021年2月	10 円
2020年2月	10 円
2019年2月	10 円
2018年2月	10 円
設定来累計	60 円

■ 普通型

2022年2月	10 円
2021年2月	10 円
2020年2月	10 円
2019年2月	10 円
2018年2月	10 円
設定来累計	110 円

■ やや積極型

2022年2月	10 円
2021年2月	10 円
2020年2月	10 円
2019年2月	10 円
2018年2月	10 円
設定来累計	60 円

■ 積極型

2022年2月	10 円
2021年2月	10 円
2020年2月	10 円
2019年2月	10 円
2018年2月	10 円
設定来累計	110 円



運用実績（2022年3月31日現在）

■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

	投資比率（%）				
	保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
国内株式マザーファンド	10.2	13.4	15.1	14.8	11.2
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	41.4	28.5	14.8	7.8	4.3
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	7.1	15.1	25.1	37.8	51.8
外国債券マザーファンド	32.9	31.4	29.8	23.9	17.3
世界REITインデックス マザーファンド	7.3	10.4	14.2	14.7	14.3

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じた投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（%）				
			保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.4	0.6	0.6	0.6	0.5
2	ソニーグループ	電気機器	0.3	0.4	0.4	0.4	0.3
3	キーエンス	電気機器	0.2	0.3	0.3	0.3	0.2
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.2	0.2	0.3	0.3	0.2
5	東京エレクトロン	電気機器	0.1	0.2	0.2	0.2	0.2

・「国内債券NOMURA-BPI総合 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（%）				
			保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
1	国債債券 利付（10年）第360回	国債証券	0.5	0.4	0.2	0.1	0.1
2	国債債券 利付（10年）第359回	国債証券	0.5	0.4	0.2	0.1	0.1
3	国債債券 利付（10年）第363回	国債証券	0.5	0.4	0.2	0.1	0.1
4	国債債券 利付（10年）第350回	国債証券	0.5	0.3	0.2	0.1	0.1
5	国債債券 利付（5年）第141回	国債証券	0.5	0.3	0.2	0.1	0.0

・「外国株式MSCI-KOKUSAI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（%）				
			保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.4	0.8	1.3	1.9	2.6
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.3	0.6	1.0	1.5	2.0
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.2	0.4	0.7	1.0	1.4
4	TESLA INC	自動車	0.1	0.2	0.4	0.6	0.8
5	ALPHABET INC-CL A	インターネット・メディアおよびサービス	0.1	0.2	0.4	0.6	0.8

・「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（%）				
			保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
1	US TREASURY N/B	国債証券	1.2	1.1	1.1	0.9	0.6
2	US TREASURY BOND	国債証券	0.9	0.9	0.9	0.7	0.5
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.5	0.5	0.4	0.4	0.3
4	US TREASURY BOND	国債証券	0.5	0.4	0.4	0.3	0.2
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.4	0.4	0.4	0.3	0.2

・「世界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（%）				
			保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
1	PROLOGIS INC	投資証券	0.5	0.7	1.0	1.0	1.0
2	EQUINIX INC	投資証券	0.3	0.4	0.5	0.6	0.5
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.2	0.4	0.5	0.5	0.5
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.2	0.3	0.4	0.4	0.4
5	WELLTOWER INC	投資証券	0.2	0.2	0.3	0.3	0.3



運用実績（2022年3月31日現在）

■ 年間収益率の推移（暦年ベース）

■ 保守型



■ やや保守型



■ 普通型



■ やや積極型



■ 積極型



2013年 2014年 2015年 2016年 2017年 2018年 2019年 2020年 2021年 2022年

・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。

・『(やや保守型)』『(やや積極型)』の2016年は設定日（2016年11月11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。●グラフの横軸の目盛りはファンドごとに異なる場合があります。

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、有価証券届出書の「第一部 証券情報」にしたがって受益権の募集が行なわれま
す。

販売会社によっては、一部のファンドのみのお取り扱いと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。

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

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

分配金の受取方法により、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。
(原則として、お買付け後のコース変更はできません。)

販売の単位は、「一般コース」の場合は1万口以上1万口単位(当初元本1口=1円)または1万円以上1円単位、
「自動けいぞく投資コース」の場合は1万円以上1円単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」を選
択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。なお、販売会社や申込形態によっては、どち
らか一方のコースのみのお取り扱いとなる場合や、申込単位が異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお
問い合わせください。

積立方式

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

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

受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

「のむラップ・ファンド」を構成する各ファンド間でスイッチングができます。

なお、「(年3%目標払出)のむラップ・ファンド(普通型)」「(年6%目標払出)のむラップ・ファンド
(普通型)」の換金代金をもって、「のむラップ・ファンド」を構成する各ファンドへのスイッチングが可能
です。

スイッチングの方法等は、購入、換金の場合と同様です。

販売会社によっては、一部または全部のスイッチングのお取扱いを行わない場合があります。

なお、スイッチングの際には、換金時と同様の費用・税金がかかりますのでご留意下さい。(詳しくは「第
1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金」をご覧ください。)

購入およびスイッチングのお申込みの方法ならびに単位等について、販売会社や申込形態によっては、上記
と異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があ
るときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断でファンドの受益権の取得申込み(スイッチングの申込みを含
みます。)の受付けを中止することおよび既に受付けた取得申込み(スイッチングの申込みを含みます。)の受付
けを取り消す場合があります。

取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替

を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとし、振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

2【換金（解約）手続等】

受益者は、受益権を、「一般コース」の場合は1万口単位、1口単位または1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1円単位または1口単位で換金できます。

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。

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、

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

換金価額は、換金のお申込み日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうため、1日1件10億円を超える一部解約は行なえません。また、別途、大口換金について、1日1件10億円以下の金額であっても、ファンドの残高、市場の流動性の状況等によっては、委託者の判断により一部解約の金額に制限を設ける場合や一部解約の実行の請求の受付時間に制限を設ける場合があります。

解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、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付を中止することおよび既に受付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

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

換金の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<基準価額の計算方法>

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 ¹ における以下のいずれかの価額で評価します。 ² 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

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

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

無期限とします。

(保守型、普通型、積極型：2010年3月15日設定)

(やや保守型、やや積極型：2016年11月11日設定)

(4)【計算期間】

原則として、毎年2月19日から翌年2月18日までとします。

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

(5)【その他】

(a)ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより、各ファンドにつき受益権の口数が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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

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

()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委託者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、その委託者と受託者との間において存続します。

(c)運用報告書

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

(d)信託約款の変更等

()委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行な

うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとし、

- ()委託者は、上記()の事項(上記()の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行いません。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行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- ()書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ()上記()から()までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ()上記()から()の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e)公告

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

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

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

(f)受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

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

<自動けいぞく投資契約を結んでいない場合>

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

<自動けいぞく投資契約を結んでいる場合>

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

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

換金(解約)の単位

受益者は、受益権を「一般コース」の場合は1万口単位、1口単位または1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1円単位または1口単位で換金できます。

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。

換金(解約)代金の支払い開始日

一部解約金は、受益者の解約申込みの受付日から起算して、原則として、5営業日目から受益者にお支払いします。

第3【ファンドの経理状況】

のむらップ・ファンド（保守型）

のむらップ・ファンド（普通型）

のむらップ・ファンド（積極型）

(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12期計算期間(2021年2月19日から2022年2月18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。

のむらップ・ファンド（やや保守型）

のむらップ・ファンド（やや積極型）

(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6期計算期間(2021年2月19日から2022年2月18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】

【のむらップ・ファンド（保守型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 (2021年 2月18日現在)	第12期 (2022年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	695,231,242	913,003,722
親投資信託受益証券	41,302,918,441	48,043,347,894
未収入金	52,479,000	140,000,000
流動資産合計	42,050,628,683	49,096,351,616
資産合計	42,050,628,683	49,096,351,616
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	27,507,299	31,500,368
未払解約金	81,625,855	46,143,074
未払受託者報酬	6,912,662	7,939,095
未払委託者報酬	241,943,039	277,868,277
未払利息	638	579
その他未払費用	691,207	793,846
流動負債合計	358,680,700	364,245,239
負債合計	358,680,700	364,245,239
純資産の部		
元本等		
元本	27,507,299,232	31,500,368,264
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,184,648,751	17,231,738,113
（分配準備積立金）	3,349,267,699	3,327,695,097
元本等合計	41,691,947,983	48,732,106,377
純資産合計	41,691,947,983	48,732,106,377
負債純資産合計	42,050,628,683	49,096,351,616

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第11期		第12期	
	自 2020年 2月19日	至 2021年 2月18日	自 2021年 2月19日	至 2022年 2月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		1,525,538,748		1,323,426,453
営業収益合計		1,525,538,748		1,323,426,453
営業費用				
支払利息		195,973		169,097
受託者報酬		13,654,553		15,063,249
委託者報酬		477,909,082		527,213,405
その他費用		1,365,338		1,506,202
営業費用合計		493,124,946		543,951,953
営業利益又は営業損失()		1,032,413,802		779,474,500
経常利益又は経常損失()		1,032,413,802		779,474,500
当期純利益又は当期純損失()		1,032,413,802		779,474,500
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()		80,833,435		224,098,764
期首剰余金又は期首欠損金()		13,755,967,743		14,184,648,751
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,685,374,954		5,270,299,306
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,685,374,954		5,270,299,306
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,342,433,884		2,747,085,312
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,342,433,884		2,747,085,312
分配金		27,507,299		31,500,368
期末剰余金又は期末欠損金()		14,184,648,751		17,231,738,113

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年 2月19日から2022年 2月 18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11期 2021年 2月18日現在	第12期 2022年 2月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 27,507,299,232口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 31,500,368,264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 1.5157円 (10,000口当たり純資産額) (15,157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 1.5470円 (10,000口当たり純資産額) (15,470円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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>520,852,338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>592,394,899円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>10,835,381,052円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,263,527,761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>14,212,156,050円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>27,507,299,232口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象 額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>5,166円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>27,507,299円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	520,852,338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	592,394,899円	収益調整金額	C	10,835,381,052円	分配準備積立金額	D	2,263,527,761円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	14,212,156,050円	当ファンドの期末残存口数	F	27,507,299,232口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	5,166円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	27,507,299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>404,000,796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>151,374,940円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>13,904,043,016円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,803,819,729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>17,263,238,481円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>31,500,368,264口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象 額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>5,480円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>31,500,368円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	404,000,796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	151,374,940円	収益調整金額	C	13,904,043,016円	分配準備積立金額	D	2,803,819,729円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,263,238,481円	当ファンドの期末残存口数	F	31,500,368,264口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	5,480円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	31,500,368円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	520,852,338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	592,394,899円																																																											
収益調整金額	C	10,835,381,052円																																																											
分配準備積立金額	D	2,263,527,761円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	14,212,156,050円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	27,507,299,232口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	5,166円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	27,507,299円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	404,000,796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	151,374,940円																																																											
収益調整金額	C	13,904,043,016円																																																											
分配準備積立金額	D	2,803,819,729円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,263,238,481円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	31,500,368,264口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	5,480円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	31,500,368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11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 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。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第11期 2021年 2月18日現在	第12期 2022年 2月18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</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18日
期首元本額 28,738,436,858円	期首元本額 27,507,299,232円
期中追加設定元本額 5,853,220,978円	期中追加設定元本額 9,295,649,362円
期中一部解約元本額 7,084,358,604円	期中一部解約元本額 5,302,580,330円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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	1,601,187,710	1,085,355,640
合計	1,601,187,710	1,085,355,640

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年2月18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18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	2,432,868,853	4,951,617,976	
		外国債券マザーファンド	6,399,920,538	15,987,001,503	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	780,909,569	3,362,674,695	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	15,573,954,338	20,359,830,506	
		世界REITインデックスマザーファンド	1,453,094,696	3,382,223,214	
	小計	銘柄数:5 組入時価比率:98.6%	26,640,747,994	48,043,347,894	100.0%
合計			48,043,347,894		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【のむらップ・ファンド(やや保守型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 (2021年 2月18日現在)	第6期 (2022年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	77,887,189	128,671,318
親投資信託受益証券	4,060,315,947	6,081,757,195
未収入金	5,930,000	-
流動資産合計	4,144,133,136	6,210,428,513
資産合計	4,144,133,136	6,210,428,513
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,384,335	4,878,498
未払解約金	15,921,969	-
未払受託者報酬	698,316	953,555
未払委託者報酬	26,187,142	35,758,344
未払利息	71	81
その他未払費用	69,768	95,293
流動負債合計	46,261,601	41,685,771
負債合計	46,261,601	41,685,771
純資産の部		
元本等		
元本	3,384,335,071	4,878,498,437
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	713,536,464	1,290,244,305
(分配準備積立金)	374,002,336	430,450,717
元本等合計	4,097,871,535	6,168,742,742
純資産合計	4,097,871,535	6,168,742,742
負債純資産合計	4,144,133,136	6,210,428,513

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	2020年 2月19日	自	2021年 2月19日
	至	2021年 2月18日	至	2022年 2月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		151,702,258		233,802,248
営業収益合計		151,702,258		233,802,248
営業費用				
支払利息		19,702		20,561
受託者報酬		1,312,628		1,708,699
委託者報酬		49,223,757		64,076,181
その他費用		131,135		170,747
営業費用合計		50,687,222		65,976,188
営業利益又は営業損失（ ）		101,015,036		167,826,060
経常利益又は経常損失（ ）		101,015,036		167,826,060
当期純利益又は当期純損失（ ）		101,015,036		167,826,060
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（ ）		91,683,806		39,732,659
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		603,454,489		713,536,464
剰余金増加額又は欠損金減少額		186,398,648		630,839,227
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		186,398,648		630,839,227
剰余金減少額又は欠損金増加額		265,631,180		177,346,289
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		265,631,180		177,346,289
分配金		3,384,335		4,878,498
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		713,536,464		1,290,244,305

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年 2月19日から2022年 2月 18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5期 2021年 2月18日現在	第6期 2022年 2月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 3,384,335,071口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 4,878,498,437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 1.2108円 (10,000口当たり純資産額) (12,108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 1.2645円 (10,000口当たり純資産額) (12,645円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第6期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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>61,730,381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>130,968,461円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>339,534,128円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>184,687,829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>716,920,799円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,384,335,071口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象 額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>2,118円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>3,384,335円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	61,730,381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	130,968,461円	収益調整金額	C	339,534,128円	分配準備積立金額	D	184,687,829円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	716,920,799円	当ファンドの期末残存口数	F	3,384,335,071口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F×10,000	2,118円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,384,335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>64,533,431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>63,559,970円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>859,793,588円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>307,235,814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>1,295,122,803円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>4,878,498,437口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象 額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>2,654円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>4,878,498円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	64,533,431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	63,559,970円	収益調整金額	C	859,793,588円	分配準備積立金額	D	307,235,814円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,295,122,803円	当ファンドの期末残存口数	F	4,878,498,437口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F×10,000	2,654円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	4,878,498円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	61,730,381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	130,968,461円																																																											
収益調整金額	C	339,534,128円																																																											
分配準備積立金額	D	184,687,829円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	716,920,799円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,384,335,071口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F×10,000	2,118円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,384,335円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	64,533,431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	63,559,970円																																																											
収益調整金額	C	859,793,588円																																																											
分配準備積立金額	D	307,235,814円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,295,122,803円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	4,878,498,437口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F×10,000	2,654円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	4,878,498円																																																											

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

<p style="text-align: center;">第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日</p>	<p style="text-align: center;">第6期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18日</p>
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、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。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 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。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

<p style="text-align: center;">第5期 2021年 2月18日現在</p>	<p style="text-align: center;">第6期 2022年 2月18日現在</p>
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第6期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第6期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18日
期首元本額 3,727,168,292円	期首元本額 3,384,335,071円
期中追加設定元本額 1,382,305,912円	期中追加設定元本額 2,299,623,862円
期中一部解約元本額 1,725,139,133円	期中一部解約元本額 805,460,496円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第6期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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	238,431,279	204,912,940
合計	238,431,279	204,912,940

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年2月18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18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	404,404,664	823,084,812	
		外国債券マザーファンド	788,271,781	1,969,102,908	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	209,338,054	901,430,594	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	1,357,681,601	1,774,897,156	
		世界REITインデックスマザーファンド	263,465,254	613,241,725	
	小計	銘柄数:5 組入時価比率:98.6%	3,023,161,354	6,081,757,195	100.0%
合計			6,081,757,195		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【のむらップ・ファンド（普通型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 (2021年 2月18日現在)	第12期 (2022年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,030,659,824	3,516,795,289
親投資信託受益証券	102,722,787,166	161,136,655,674
未収入金	79,884,000	-
流動資産合計	104,833,330,990	164,653,450,963
資産合計	104,833,330,990	164,653,450,963
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	50,216,356	73,633,291
未払解約金	403,174,411	102,818,003
未払受託者報酬	16,359,807	25,108,814
未払委託者報酬	654,392,349	1,004,352,360
未払利息	1,863	2,230
その他未払費用	1,635,924	2,510,817
流動負債合計	1,125,780,710	1,208,425,515
負債合計	1,125,780,710	1,208,425,515
純資産の部		
元本等		
元本	50,216,356,614	73,633,291,800
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	53,491,193,666	89,811,733,648
（分配準備積立金）	13,560,150,154	16,969,346,950
元本等合計	103,707,550,280	163,445,025,448
純資産合計	103,707,550,280	163,445,025,448
負債純資産合計	104,833,330,990	164,653,450,963

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自 2020年 2月19日	至 2021年 2月18日	自 2021年 2月19日	至 2022年 2月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		7,426,724,434		9,262,931,508
その他収益		38		-
営業収益合計		7,426,724,472		9,262,931,508
営業費用				
支払利息		468,777		548,770
受託者報酬		30,950,882		44,248,330
委託者報酬		1,238,035,530		1,769,932,804
その他費用		3,094,972		4,424,710
営業費用合計		1,272,550,161		1,819,154,614
営業利益又は営業損失（ ）		6,154,174,311		7,443,776,894
経常利益又は経常損失（ ）		6,154,174,311		7,443,776,894
当期純利益又は当期純損失（ ）		6,154,174,311		7,443,776,894
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（ ）		225,274,351		1,451,794,460
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		45,052,813,650		53,491,193,666
剰余金増加額又は欠損金減少額		15,413,438,460		43,719,074,005
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		15,413,438,460		43,719,074,005
剰余金減少額又は欠損金増加額		13,304,290,750		13,316,883,166
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		13,304,290,750		13,316,883,166
分配金		50,216,356		73,633,291
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		53,491,193,666		89,811,733,648

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年 2月19日から2022年 2月 18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11期 2021年 2月18日現在	第12期 2022年 2月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 50,216,356,614口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 73,633,291,800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 2.0652円 (10,000口当たり純資産額) (20,652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 2.2197円 (10,000口当たり純資産額) (22,197円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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>1,762,609,272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>4,616,839,390円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>39,931,043,512円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>7,230,917,848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>53,541,410,022円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>50,216,356,614口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象 額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>10,662円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>50,216,356円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,762,609,272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	4,616,839,390円	収益調整金額	C	39,931,043,512円	分配準備積立金額	D	7,230,917,848円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	53,541,410,022円	当ファンドの期末残存口数	F	50,216,356,614口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	10,662円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	50,216,356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>2,102,790,228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>3,889,192,206円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>72,842,386,698円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>11,050,997,807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>89,885,366,939円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>73,633,291,800口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象 額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>12,207円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>73,633,291円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,102,790,228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	3,889,192,206円	収益調整金額	C	72,842,386,698円	分配準備積立金額	D	11,050,997,807円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	89,885,366,939円	当ファンドの期末残存口数	F	73,633,291,800口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	12,207円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	73,633,291円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,762,609,272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	4,616,839,390円																																																											
収益調整金額	C	39,931,043,512円																																																											
分配準備積立金額	D	7,230,917,848円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	53,541,410,022円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	50,216,356,614口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	10,662円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	50,216,356円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	2,102,790,228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	3,889,192,206円																																																											
収益調整金額	C	72,842,386,698円																																																											
分配準備積立金額	D	11,050,997,807円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	89,885,366,939円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	73,633,291,800口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	12,207円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	73,633,291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11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 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。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第11期 2021年 2月18日現在	第12期 2022年 2月18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</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18日
期首元本額 47,123,666,928円	期首元本額 50,216,356,614円
期中追加設定元本額 17,367,085,936円	期中追加設定元本額 35,642,462,288円
期中一部解約元本額 14,274,396,250円	期中一部解約元本額 12,225,527,102円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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	7,817,618,818	8,892,854,445
合計	7,817,618,818	8,892,854,445

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年2月18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18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	12,285,155,615	25,003,977,223	
		外国債券マザーファンド	19,938,502,422	49,806,379,050	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	9,152,603,263	39,412,024,910	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	18,977,066,981	24,808,719,664	
		世界REITインデックスマザーファンド	9,497,145,054	22,105,554,827	
	小計	銘柄数:5 組入時価比率:98.6%	69,850,473,335	161,136,655,674 100.0%	
合計			161,136,655,674		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【のむらップ・ファンド(やや積極型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 (2021年 2月18日現在)	第6期 (2022年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	89,955,504	182,235,406
親投資信託受益証券	4,403,953,354	8,372,558,080
未収入金	11,511,000	-
流動資産合計	4,505,419,858	8,554,793,486
資産合計	4,505,419,858	8,554,793,486
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,288,501	5,718,111
未払解約金	26,882,017	3,288,178
未払受託者報酬	692,985	1,230,223
未払委託者報酬	29,451,691	52,284,461
未払利息	82	115
その他未払費用	69,238	122,960
流動負債合計	60,384,514	62,644,048
負債合計	60,384,514	62,644,048
純資産の部		
元本等		
元本	3,288,501,593	5,718,111,113
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,156,533,751	2,774,038,325
(分配準備積立金)	539,992,157	744,842,966
元本等合計	4,445,035,344	8,492,149,438
純資産合計	4,445,035,344	8,492,149,438
負債純資産合計	4,505,419,858	8,554,793,486

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	2020年 2月19日	自	2021年 2月19日
	至	2021年 2月18日	至	2022年 2月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		427,614,328		513,140,726
営業収益合計		427,614,328		513,140,726
営業費用				
支払利息		20,006		27,403
受託者報酬		1,240,809		2,089,265
委託者報酬		52,734,085		88,793,712
その他費用		123,962		208,799
営業費用合計		54,118,862		91,119,179
営業利益又は営業損失（ ）		373,495,466		422,021,547
経常利益又は経常損失（ ）		373,495,466		422,021,547
当期純利益又は当期純損失（ ）		373,495,466		422,021,547
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（ ）		16,568,580		93,219,418
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		656,031,671		1,156,533,751
剰余金増加額又は欠損金減少額		384,095,844		1,681,635,721
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		384,095,844		1,681,635,721
剰余金減少額又は欠損金増加額		237,232,149		387,215,165
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		237,232,149		387,215,165
分配金		3,288,501		5,718,111
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,156,533,751		2,774,038,325

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年 2月19日から2022年 2月 18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5期 2021年 2月18日現在	第6期 2022年 2月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 3,288,501,593口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 5,718,111,113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 1.3517円 (10,000口当たり純資産額) (13,517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 1.4851円 (10,000口当たり純資産額) (14,851円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第6期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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>72,123,597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>284,803,289円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>616,541,594円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>186,353,772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>1,159,822,252円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,288,501,593口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象 額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>3,526円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>3,288,501円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	72,123,597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	284,803,289円	収益調整金額	C	616,541,594円	分配準備積立金額	D	186,353,772円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,159,822,252円	当ファンドの期末残存口数	F	3,288,501,593口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	3,526円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,288,501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>98,212,499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>230,589,630円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,029,195,359円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>421,758,948円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>2,779,756,436円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>5,718,111,113口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象 額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>4,861円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>5,718,111円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	98,212,499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	230,589,630円	収益調整金額	C	2,029,195,359円	分配準備積立金額	D	421,758,948円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,779,756,436円	当ファンドの期末残存口数	F	5,718,111,113口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	4,861円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	5,718,111円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	72,123,597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	284,803,289円																																																											
収益調整金額	C	616,541,594円																																																											
分配準備積立金額	D	186,353,772円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,159,822,252円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,288,501,593口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	3,526円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,288,501円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	98,212,499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	230,589,630円																																																											
収益調整金額	C	2,029,195,359円																																																											
分配準備積立金額	D	421,758,948円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,779,756,436円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	5,718,111,113口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	4,861円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	5,718,111円																																																											

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

<p style="text-align: center;">第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日</p>	<p style="text-align: center;">第6期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18日</p>
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、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。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 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。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

<p style="text-align: center;">第5期 2021年 2月18日現在</p>	<p style="text-align: center;">第6期 2022年 2月18日現在</p>
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第6期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第6期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18日
期首元本額 2,414,361,309円	期首元本額 3,288,501,593円
期中追加設定元本額 1,873,074,115円	期中追加設定元本額 3,455,675,677円
期中一部解約元本額 998,933,831円	期中一部解約元本額 1,026,066,157円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第6期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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	419,800,642	500,705,844
合計	419,800,642	500,705,844

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年2月18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18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	627,628,962	1,277,413,226	
		外国債券マザーファンド	825,474,520	2,062,035,350	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	727,796,992	3,133,966,627	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	526,142,281	687,825,803	
		世界REITインデックスマザーファンド	520,414,622	1,211,317,074	
	小計	銘柄数:5 組入時価比率:98.6%	3,227,457,377	8,372,558,080	100.0%
合計			8,372,558,080		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【のむらップ・ファンド（積極型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 (2021年 2月18日現在)	第12期 (2022年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	839,856,149	1,686,719,543
親投資信託受益証券	39,337,762,128	72,215,893,593
未収入金	114,494,000	-
流動資産合計	40,292,112,277	73,902,613,136
資産合計	40,292,112,277	73,902,613,136
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	16,262,041	26,719,669
未払解約金	274,444,665	76,993,214
未払受託者報酬	6,167,413	11,014,729
未払委託者報酬	277,533,464	495,662,847
未払利息	770	1,069
その他未払費用	616,680	1,101,413
流動負債合計	575,025,033	611,492,941
負債合計	575,025,033	611,492,941
純資産の部		
元本等		
元本	16,262,041,689	26,719,669,620
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	23,455,045,555	46,571,450,575
（分配準備積立金）	6,782,965,780	9,047,637,371
元本等合計	39,717,087,244	73,291,120,195
純資産合計	39,717,087,244	73,291,120,195
負債純資産合計	40,292,112,277	73,902,613,136

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自 2020年 2月19日	至 2021年 2月18日	自 2021年 2月19日	至 2022年 2月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		3,900,729,648		5,859,335,465
営業収益合計		3,900,729,648		5,859,335,465
営業費用				
支払利息		187,359		250,474
受託者報酬		11,312,148		18,744,212
委託者報酬		509,046,505		843,489,507
その他費用		1,131,093		1,874,299
営業費用合計		521,677,105		864,358,492
営業利益又は営業損失（ ）		3,379,052,543		4,994,976,973
経常利益又は経常損失（ ）		3,379,052,543		4,994,976,973
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,379,052,543		4,994,976,973
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（ ）		75,630,301		1,120,400,218
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		18,154,753,422		23,455,045,555
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,932,789,820		27,474,295,353
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,932,789,820		27,474,295,353
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,070,918,490		8,205,747,419
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,070,918,490		8,205,747,419
分配金		16,262,041		26,719,669
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		23,455,045,555		46,571,450,575

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年 2月19日から2022年 2月 18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11期 2021年 2月18日現在	第12期 2022年 2月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 16,262,041,689口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 26,719,669,620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 2.4423円 (10,000口当たり純資産額) (24,423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 2.7430円 (10,000口当たり純資産額) (27,430円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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>646,449,178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>2,808,233,666円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>16,672,079,775円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>3,344,544,977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>23,471,307,596円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>16,262,041,689口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象 額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>14,433円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>16,262,041円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	646,449,178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	2,808,233,666円	収益調整金額	C	16,672,079,775円	分配準備積立金額	D	3,344,544,977円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	23,471,307,596円	当ファンドの期末残存口数	F	16,262,041,689口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	14,433円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	16,262,041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>888,897,768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>2,985,678,987円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>37,523,813,204円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>5,199,780,285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>46,598,170,244円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>26,719,669,620口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象 額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>17,439円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>26,719,669円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	888,897,768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	2,985,678,987円	収益調整金額	C	37,523,813,204円	分配準備積立金額	D	5,199,780,285円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	46,598,170,244円	当ファンドの期末残存口数	F	26,719,669,620口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	17,439円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	26,719,669円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	646,449,178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	2,808,233,666円																																																											
収益調整金額	C	16,672,079,775円																																																											
分配準備積立金額	D	3,344,544,977円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	23,471,307,596円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	16,262,041,689口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	14,433円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	16,262,041円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	888,897,768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	2,985,678,987円																																																											
収益調整金額	C	37,523,813,204円																																																											
分配準備積立金額	D	5,199,780,285円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	46,598,170,244円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	26,719,669,620口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	17,439円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	26,719,669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11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 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。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第11期 2021年 2月18日現在	第12期 2022年 2月18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</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18日
期首元本額 14,203,501,186円	期首元本額 16,262,041,689円
期中追加設定元本額 7,849,562,545円	期中追加設定元本額 15,921,073,680円
期中一部解約元本額 5,791,022,042円	期中一部解約元本額 5,463,445,749円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日	第12期 自 2021年 2月19日 至 2022年 2月18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	3,953,639,258	5,800,190,731
合計	3,953,639,258	5,800,190,731

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年2月18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18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	4,189,859,500	8,527,621,040	
		外国債券マザーファンド	5,183,376,042	12,948,073,352	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	8,634,375,295	37,180,483,457	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	2,548,685,504	3,331,896,559	
		世界REITインデックスマザーファンド	4,394,148,129	10,227,819,185	
	小計	銘柄数:5 組入時価比率:98.5%	24,950,444,470	72,215,893,593	100.0%
合計			72,215,893,593		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2022年2月18日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,186,549,333
株式	411,855,217,650
派生商品評価勘定	108,264,937
未収入金	319,010
未収配当金	612,945,877
未収利息	359,844
その他未収収益	25,377,214
差入委託証拠金	108,586,908

流動資産合計	423,897,620,773
資産合計	423,897,620,773
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,405,395
未払解約金	281,511,263
未払利息	7,095
有価証券貸借取引受入金	6,168,839,023
流動負債合計	6,453,762,776
負債合計	6,453,762,776
純資産の部	
元本等	
元本	205,105,857,885
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	212,338,000,112
元本等合計	417,443,857,997
純資産合計	417,443,857,997
負債純資産合計	423,897,620,773

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18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	2.0353円
(10,000口当たり純資産額)	(20,353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	
	5,813,299,600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19日 至 2022年 2月18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18日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p> (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p> デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p> これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており</p> <p>ます。</p>

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 2月18日現在		2021年 2月19日
期首		2021年 2月19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		205,717,845,140円
同期中における追加設定元本額		38,857,738,032円
同期中における一部解約元本額		39,469,725,287円
期末元本額		205,105,857,885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)		2,286,650,304円
野村世界6資産分散投信(分配コース)		2,945,236,069円
野村世界6資産分散投信(成長コース)		8,072,424,441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		100,407,226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)		13,887,786,557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		30,480,510円
野村インデックスファンド・TOPIX		2,227,739,759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		1,454,050,365円
野村TOPIXインデックス(野村SMA・EW向け)		2,687,326,975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		39,825,816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
のむらップ・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		2,686,854,117円
世界6資産分散ファンド		81,772,493円
野村資産設計ファンド2060		28,085,530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)	444,057,119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)	346,912,271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)	61,163,815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)	287,701,368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)	1,798,027,843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)	2,650,159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)	28,383,494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)	117,332,276円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	8,982,147,402円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	25,240,186,291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)	34,923,649,874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	10,974,798,236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)	1,425,129,667円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,203,539,487円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,066,731,096円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	12,139,028円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	5,529,830円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	89,735,956円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	27,564,684円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	24,355,964円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	19,531,735円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	565,092,128円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	472,460,283円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	293,321,592円

マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	409,930,497円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	13,626,755円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	95,755,402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)	174,441,448円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	4,426,436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18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	3,215.00	23,791,000	貸付有価証券 200株
		日本水産	212,700	560.00	119,112,000	
		マルハニチロ	33,300	2,629.00	87,545,700	
		雪国まいたけ	15,500	1,215.00	18,832,500	
		カネコ種苗	6,000	1,577.00	9,462,000	
		サカタのタネ	25,400	3,420.00	86,868,000	貸付有価証券 100株
		ホクト	17,800	1,980.00	35,244,000	貸付有価証券 1,100株
		ホクリヨウ	2,900	689.00	1,998,100	
		住石ホールディングス	37,200	139.00	5,170,800	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
		日鉄鉱業	4,900	6,460.00	31,654,000	
		三井松島ホールディングス	8,900	1,658.00	14,756,200	貸付有価証券 1,800株(1,500株)
		I N P E X	853,200	1,131.00	964,969,200	貸付有価証券 400株
		石油資源開発	25,000	2,748.00	68,700,000	
		K & O エナジーグループ	9,600	1,575.00	15,120,000	
		ヒノキヤグループ	4,600	2,365.00	10,879,000	
		ショーボンドホールディングス	30,300	5,190.00	157,257,000	貸付有価証券 6,500株
ミライト・ホールディングス	68,500	1,933.00	132,410,500			

タマホーム	12,900	2,312.00	29,824,800	貸付有価証券 6,000株（100株）
サンヨーホームズ	2,500	751.00	1,877,500	貸付有価証券 100株
日本アクア	8,500	592.00	5,032,000	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	1,278.00	5,367,600	貸付有価証券 1,900株
Robot Home	35,400	212.00	7,504,800	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	1,136.00	4,657,600	
第一カッター興業	5,300	1,354.00	7,176,200	
安藤・間	105,600	934.00	98,630,400	貸付有価証券 49,600株
東急建設	62,300	732.00	45,603,600	
コムシスホールディングス	68,600	2,800.00	192,080,000	
ピーアールホールディングス	28,900	350.00	10,115,000	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	2,010.00	26,532,000	
東建コーポレーション	5,900	9,150.00	53,985,000	
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	993.00	10,227,900	貸付有価証券 4,400株
オリエンタル白石	71,500	243.00	17,374,500	貸付有価証券 100株
大成建設	141,900	3,850.00	546,315,000	
大林組	491,100	976.00	479,313,600	
清水建設	460,100	779.00	358,417,900	貸付有価証券 400株
飛島建設	13,100	1,121.00	14,685,100	
長谷工コーポレーション	146,300	1,518.00	222,083,400	

松井建設	19,300	738.00	14,243,400	
銭高組	2,100	4,090.00	8,589,000	
鹿島建設	359,900	1,580.00	568,642,000	貸付有価証券 400株
不動テトラ	10,400	1,559.00	16,213,600	
大末建設	5,200	1,322.00	6,874,400	
鉄建建設	10,700	1,937.00	20,725,900	
西松建設	29,700	3,865.00	114,790,500	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	3,695.00	26,604,000	貸付有価証券 3,200株
佐田建設	10,600	479.00	5,077,400	
ナカノフード建設	11,700	345.00	4,036,500	
奥村組	28,900	3,250.00	93,925,000	
東鉄工業	22,800	2,534.00	57,775,200	
イチケン	3,500	1,900.00	6,650,000	
富士ピー・エス	6,300	492.00	3,099,600	貸付有価証券 2,900株
浅沼組	5,500	5,360.00	29,480,000	
戸田建設	203,900	770.00	157,003,000	
熊谷組	25,000	2,903.00	72,575,000	
北野建設	3,000	2,149.00	6,447,000	
植木組	4,300	1,495.00	6,428,500	貸付有価証券 1,400株
矢作建設工業	21,700	795.00	17,251,500	
ピーエス三菱	16,200	612.00	9,914,400	
日本ハウスホールディングス	33,500	454.00	15,209,000	貸付有価証券 200株
大東建託	50,300	12,840.00	645,852,000	
新日本建設	20,900	756.00	15,800,400	
N I P P O	11,600	3,990.00	46,284,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
東亜道路工業	2,500	5,040.00	12,600,000	貸付有価証券 100株
日本道路	4,700	9,880.00	46,436,000	貸付有価証券 2,200株（500株）
東亜建設工業	12,000	2,675.00	32,100,000	貸付有価証券 5,600株（5,300株）

日本国土開発	47,800	536.00	25,620,800	
若築建設	8,200	1,920.00	15,744,000	
東洋建設	55,100	590.00	32,509,000	
五洋建設	194,700	626.00	121,882,200	
世紀東急工業	23,600	810.00	19,116,000	
福田組	5,200	4,305.00	22,386,000	貸付有価証券 2,400株
住友林業	125,700	2,280.00	286,596,000	貸付有価証券 28,200株
日本基礎技術	13,500	668.00	9,018,000	
巴コーポレーション	21,800	503.00	10,965,400	
大和ハウス工業	453,500	3,366.00	1,526,481,000	貸付有価証券 1,000株
ライト工業	30,900	1,922.00	59,389,800	
積水ハウス	532,700	2,383.50	1,269,690,450	
日特建設	10,100	736.00	7,433,600	
北陸電気工事	10,200	805.00	8,211,000	
ユアテック	28,100	720.00	20,232,000	
日本リーテック	10,300	1,492.00	15,367,600	
四電工	5,300	1,602.00	8,490,600	
中電工	22,600	2,162.00	48,861,200	
関電工	79,900	875.00	69,912,500	
きんでん	109,700	1,630.00	178,811,000	
東京エネシス	16,300	950.00	15,485,000	
トーエネック	4,900	3,280.00	16,072,000	
住友電設	12,100	2,221.00	26,874,100	
日本電設工業	26,900	1,581.00	42,528,900	
エクシオグループ	73,800	2,396.00	176,824,800	
新日本空調	13,000	2,050.00	26,650,000	
九電工	37,900	3,120.00	118,248,000	
三機工業	31,900	1,496.00	47,722,400	
日揮ホールディングス	151,300	1,089.00	164,765,700	
中外炉工業	4,900	1,565.00	7,668,500	
ヤマト	14,400	705.00	10,152,000	
太平電業	10,900	2,707.00	29,506,300	
高砂熱学工業	44,400	1,973.00	87,601,200	
三晃金属工業	1,900	2,521.00	4,789,900	

朝日工業社	3,300	3,030.00	9,999,000	
明星工業	31,800	722.00	22,959,600	
大気社	23,900	3,095.00	73,970,500	
ダイダン	10,900	2,323.00	25,320,700	
日比谷総合設備	15,800	1,890.00	29,862,000	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	1,275.00	13,005,000	
インフロニア・ホールディングス	209,400	1,042.00	218,194,800	貸付有価証券 1,500株
レイズネクスト	23,700	1,140.00	27,018,000	
ニッポン	46,000	1,696.00	78,016,000	
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	4,420.00	10,166,000	
昭和産業	14,900	2,703.00	40,274,700	
鳥越製粉	13,900	672.00	9,340,800	貸付有価証券 400株（400株）
中部飼料	17,700	1,062.00	18,797,400	
フィード・ワン	21,100	689.00	14,537,900	
東洋精糖	2,700	1,111.00	2,999,700	
日本甜菜製糖	8,200	1,712.00	14,038,400	
DM三井製糖ホールディングス	14,300	2,000.00	28,600,000	
塩水港精糖	18,700	216.00	4,039,200	
日新製糖	7,400	1,789.00	13,238,600	
森永製菓	36,900	3,680.00	135,792,000	
中村屋	3,800	3,375.00	12,825,000	貸付有価証券 1,700株
江崎グリコ	43,300	3,960.00	171,468,000	
名糖産業	6,900	1,680.00	11,592,000	
井村屋グループ	8,900	2,293.00	20,407,700	
不二家	8,800	2,494.00	21,947,200	貸付有価証券 3,900株
山崎製パン	117,800	1,555.00	183,179,000	
第一屋製パン	3,000	561.00	1,683,000	
モロゾフ	5,000	2,709.00	13,545,000	
亀田製菓	9,000	4,100.00	36,900,000	

寿スピリッツ	15,100	6,050.00	91,355,000	貸付有価証券 100株
カルビー	71,600	2,557.00	183,081,200	貸付有価証券 1,700株
森永乳業	29,100	5,620.00	163,542,000	
六甲バター	11,500	1,579.00	18,158,500	貸付有価証券 5,300株
ヤクルト本社	116,400	6,120.00	712,368,000	
明治ホールディングス	103,900	6,940.00	721,066,000	
雪印メグミルク	37,800	2,006.00	75,826,800	
プリマハム	19,700	2,435.00	47,969,500	
日本ハム	60,100	4,420.00	265,642,000	
林兼産業	4,800	505.00	2,424,000	
丸大食品	15,500	1,526.00	23,653,000	
S Foods	14,100	3,275.00	46,177,500	貸付有価証券 2,200株(600株)
柿安本店	5,400	2,597.00	14,023,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	101,200	688.00	69,625,600	
サッポロホールディングス	53,600	2,429.00	130,194,400	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	5,147.00	1,903,360,600	貸付有価証券 11,000株
キリンホールディングス	577,700	2,032.00	1,173,886,400	
宝ホールディングス	106,800	1,177.00	125,703,600	
オエノンホールディングス	44,600	345.00	15,387,000	
養命酒製造	4,800	1,771.00	8,500,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	110,300	1,516.00	167,214,800	貸付有価証券 300株
サントリー食品インターナショナル	105,200	4,665.00	490,758,000	貸付有価証券 13,600株
ダイドーグループホールディングス	8,100	5,160.00	41,796,000	貸付有価証券 700株
伊藤園	47,700	6,760.00	322,452,000	貸付有価証券 200株
キーコーヒー	15,400	2,083.00	32,078,200	
ユニカフェ	4,700	971.00	4,563,700	貸付有価証券 2,200株(100株)
ジャパンフーズ	2,200	1,242.00	2,732,400	

日清オイリオグループ	19,700	2,996.00	59,021,200	
不二製油グループ本社	34,100	2,263.00	77,168,300	
かどや製油	1,700	3,580.00	6,086,000	
J - オイルミルズ	14,700	1,743.00	25,622,100	
キッコーマン	113,100	8,970.00	1,014,507,000	
味の素	347,100	3,320.00	1,152,372,000	
ブルドックソース	6,600	2,007.00	13,246,200	貸付有価証券 3,100株(200株)
キュービー	82,600	2,482.00	205,013,200	
ハウス食品グループ本社	58,800	3,040.00	178,752,000	
カゴメ	59,600	3,050.00	181,780,000	貸付有価証券 800株
焼津水産化学工業	7,600	916.00	6,961,600	
アリアケジャパン	14,400	5,850.00	84,240,000	
ピエトロ	2,100	1,817.00	3,815,700	貸付有価証券 900株
エバラ食品工業	3,400	2,800.00	9,520,000	
やまみ	1,400	1,871.00	2,619,400	
ニチレイ	71,700	2,633.00	188,786,100	
東洋水産	75,500	4,905.00	370,327,500	
イトアンドホールディングス	5,900	2,314.00	13,652,600	貸付有価証券 2,700株
大冷	1,800	1,893.00	3,407,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,100	532.00	4,309,200	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	9,140.00	563,938,000	
永谷園ホールディングス	7,000	1,997.00	13,979,000	
一正蒲鉾	6,800	790.00	5,372,000	
フジッコ	14,600	1,965.00	28,689,000	
ロック・フィールド	16,900	1,589.00	26,854,100	貸付有価証券 7,500株
日本たばこ産業	842,800	2,344.00	1,975,523,200	貸付有価証券 24,900株
ケンコーマヨネーズ	8,800	1,453.00	12,786,400	
わらべや日洋ホールディングス	10,300	1,835.00	18,900,500	貸付有価証券 3,900株(1,000株)
なとり	8,800	2,084.00	18,339,200	貸付有価証券 4,000株

イフジ産業	2,700	952.00	2,570,400	
ピクルスコーポレーション	7,500	1,526.00	11,445,000	貸付有価証券 800株(100株)
ファーマフーズ	14,800	1,611.00	23,842,800	貸付有価証券 6,600株(1,900株)
ユーグレナ	80,000	776.00	62,080,000	貸付有価証券 37,600株(32,200株)
紀文食品	9,200	1,203.00	11,067,600	
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	1,749.00	28,508,700	
片倉工業	17,100	2,322.00	39,706,200	貸付有価証券 4,700株
グンゼ	10,300	3,880.00	39,964,000	
東洋紡	60,600	1,259.00	76,295,400	
ユニチカ	42,100	308.00	12,966,800	
富士紡ホールディングス	6,800	3,670.00	24,956,000	
倉敷紡績	13,100	1,928.00	25,256,800	
シキボウ	8,000	912.00	7,296,000	
日本毛織	46,300	892.00	41,299,600	貸付有価証券 2,100株
ダイトウボウ	24,800	90.00	2,232,000	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	412.00	2,348,400	
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	1,927.00	33,337,100	貸付有価証券 7,700株
帝人	144,400	1,417.00	204,614,800	
東レ	1,110,600	673.30	747,766,980	貸付有価証券 2,300株
住江織物	3,000	1,964.00	5,892,000	
日本フェルト	8,700	450.00	3,915,000	貸付有価証券 100株
イチカワ	2,000	1,419.00	2,838,000	
日東製網	1,600	1,455.00	2,328,000	
アツギ	11,800	606.00	7,150,800	
ダイニック	5,800	748.00	4,338,400	
セーレン	31,400	2,172.00	68,200,800	貸付有価証券

				4,300株(700株)
ソトー	5,600	841.00	4,709,600	
東海染工	1,800	1,167.00	2,100,600	
小松マテーレ	25,200	1,293.00	32,583,600	
ワコールホールディングス	38,300	2,031.00	77,787,300	
ホギメディカル	20,700	3,255.00	67,378,500	
クラウドシアホールディングス	3,800	238.00	904,400	
T S Iホールディングス	51,200	329.00	16,844,800	
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	1,245.00	25,024,500	
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	281.00	1,461,200	
オンワードホールディングス	92,100	290.00	26,709,000	貸付有価証券 8,400株
ルックホールディングス	4,900	1,559.00	7,639,100	
ゴールドウイン	27,700	6,080.00	168,416,000	
デザート	29,900	3,020.00	90,298,000	貸付有価証券 100株
キング	7,200	533.00	3,837,600	
ヤマトインターナショナル	13,500	293.00	3,955,500	貸付有価証券 2,800株
特種東海製紙	9,400	4,135.00	38,869,000	
王子ホールディングス	641,200	611.00	391,773,200	
日本製紙	73,500	1,153.00	84,745,500	貸付有価証券 500株
三菱製紙	21,800	320.00	6,976,000	
北越コーポレーション	100,600	747.00	75,148,200	貸付有価証券 31,900株
中越パルプ工業	5,800	1,010.00	5,858,000	
巴川製紙所	4,500	868.00	3,906,000	
大王製紙	74,000	1,773.00	131,202,000	
阿波製紙	4,000	328.00	1,312,000	
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	1,738.00	16,337,200	

ザ・パック	11,600	2,754.00	31,946,400	貸付有価証券 100株
北の達人コーポレーション	54,900	223.00	12,242,700	貸付有価証券 24,600株（14,500株）
クラレ	224,300	1,099.00	246,505,700	貸付有価証券 9,700株
旭化成	1,016,600	1,109.50	1,127,917,700	貸付有価証券 1,600株
共和レザー	9,500	676.00	6,422,000	
昭和電工	133,000	2,333.00	310,289,000	貸付有価証券 9,100株
住友化学	1,126,900	560.00	631,064,000	貸付有価証券 4,300株
住友精化	6,800	3,350.00	22,780,000	
日産化学	83,400	6,550.00	546,270,000	
ラサ工業	5,400	1,618.00	8,737,200	
クレハ	12,100	9,160.00	110,836,000	
多木化学	6,000	4,935.00	29,610,000	貸付有価証券 1,100株
テイカ	11,300	1,330.00	15,029,000	
石原産業	25,500	1,078.00	27,489,000	
片倉コープアグリ	3,500	1,182.00	4,137,000	
日本曹達	19,600	3,430.00	67,228,000	
東ソー	221,300	1,863.00	412,281,900	
トクヤマ	49,100	1,891.00	92,848,100	
セントラル硝子	25,100	2,079.00	52,182,900	
東亜合成	85,200	1,094.00	93,208,800	貸付有価証券 1,000株
大阪ソーダ	14,300	3,130.00	44,759,000	
関東電化工業	33,600	1,193.00	40,084,800	
デンカ	56,000	3,565.00	199,640,000	
信越化学工業	263,400	18,025.00	4,747,785,000	貸付有価証券 500株
日本カーバイド工業	5,500	1,463.00	8,046,500	
堺化学工業	10,700	2,041.00	21,838,700	貸付有価証券 3,500株
第一稀元素化学工業	14,200	1,006.00	14,285,200	
エア・ウォーター	145,200	1,687.00	244,952,400	
日本酸素ホールディング	147,400	2,280.00	336,072,000	貸付有価証券

ス				100株
日本化学工業	4,800	2,530.00	12,144,000	
東邦アセチレン	2,600	1,224.00	3,182,400	貸付有価証券 200株
日本パーカライジング	77,400	1,008.00	78,019,200	貸付有価証券 100株
高圧ガス工業	24,300	699.00	16,985,700	
チタン工業	1,800	1,685.00	3,033,000	
四国化成工業	20,000	1,434.00	28,680,000	
戸田工業	3,300	2,637.00	8,702,100	
ステラ ケミファ	7,700	2,422.00	18,649,400	
保土谷化学工業	4,900	4,300.00	21,070,000	
日本触媒	25,800	5,800.00	149,640,000	
大日精化工業	12,700	2,219.00	28,181,300	
カネカ	39,700	3,830.00	152,051,000	
三菱瓦斯化学	142,700	2,052.00	292,820,400	貸付有価証券 1,700株
三井化学	139,300	3,035.00	422,775,500	
J S R	142,900	3,480.00	497,292,000	
東京応化工業	24,900	7,230.00	180,027,000	
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	839.70	861,028,380	貸付有価証券 4,200株
K Hネオケム	25,300	2,767.00	70,005,100	
ダイセル	220,900	885.00	195,496,500	
住友ベークライト	24,100	4,945.00	119,174,500	
積水化学工業	321,000	1,969.00	632,049,000	貸付有価証券 400株
日本ゼオン	138,300	1,347.00	186,290,100	貸付有価証券 200株
アイカ工業	42,700	3,240.00	138,348,000	
宇部興産	72,300	2,192.00	158,481,600	
積水樹脂	23,200	1,958.00	45,425,600	
タキロンシーアイ	33,200	562.00	18,658,400	
旭有機材	8,700	2,087.00	18,156,900	
ニチバン	9,100	1,777.00	16,170,700	貸付有価証券 500株
リケンテクノス	37,400	466.00	17,428,400	

大倉工業	7,800	1,913.00	14,921,400	
積水化成工業	20,600	462.00	9,517,200	
群栄化学工業	3,500	3,505.00	12,267,500	
タイガースポリマー	8,100	451.00	3,653,100	
ミライアル	4,900	1,562.00	7,653,800	
ダイキアクシス	6,000	725.00	4,350,000	貸付有価証券 2,800株
ダイキョーニシカワ	32,300	584.00	18,863,200	
竹本容器	5,500	804.00	4,422,000	
森六ホールディングス	8,200	1,916.00	15,711,200	
恵和	4,200	4,520.00	18,984,000	
日本化薬	120,800	1,153.00	139,282,400	
カーリットホールディングス	15,200	702.00	10,670,400	
日本精化	12,300	1,957.00	24,071,100	
扶桑化学工業	13,800	4,630.00	63,894,000	
トリケミカル研究所	15,800	2,820.00	44,556,000	貸付有価証券 2,000株
A D E K A	70,600	2,654.00	187,372,400	
日油	52,400	5,110.00	267,764,000	
新日本理化	25,400	242.00	6,146,800	
ハリマ化成グループ	11,400	813.00	9,268,200	
花王	346,400	5,338.00	1,849,083,200	
第一工業製薬	5,700	2,756.00	15,709,200	
石原ケミカル	7,700	1,335.00	10,279,500	
日華化学	5,200	777.00	4,040,400	貸付有価証券 100株
ニイタカ	3,200	2,343.00	7,497,600	
三洋化成工業	9,200	5,110.00	47,012,000	
有機合成薬品工業	10,700	272.00	2,910,400	
大日本塗料	18,800	816.00	15,340,800	
日本ペイントホールディングス	576,300	1,027.00	591,860,100	貸付有価証券 12,300株
関西ペイント	159,100	2,429.00	386,453,900	
神東塗料	12,100	155.00	1,875,500	貸付有価証券 300株
中国塗料	36,200	899.00	32,543,800	
日本特殊塗料	11,500	883.00	10,154,500	

藤倉化成	19,100	459.00	8,766,900	
太陽ホールディングス	22,600	3,090.00	69,834,000	
D I C	64,800	2,745.00	177,876,000	貸付有価証券 3,600株
サカタインクス	30,400	946.00	28,758,400	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	1,912.00	61,948,800	
T & K T O K A	12,400	910.00	11,284,000	
富士フイルムホールディ ングス	275,200	7,589.00	2,088,492,800	
資生堂	291,700	6,780.00	1,977,726,000	
ライオン	189,100	1,509.00	285,351,900	貸付有価証券 1,500株
高砂香料工業	10,800	2,749.00	29,689,200	
マンダム	32,900	1,391.00	45,763,900	
ミルボン	19,300	6,090.00	117,537,000	
ファンケル	63,400	3,255.00	206,367,000	貸付有価証券 400株
コーセー	29,500	13,470.00	397,365,000	貸付有価証券 100株
コタ	9,900	1,603.00	15,869,700	
シーボン	2,000	1,833.00	3,666,000	
ポーラ・オルビスホール ディングス	66,800	1,840.00	122,912,000	貸付有価証券 2,200株
ノエビアホールディン グス	13,300	5,190.00	69,027,000	
アジュバンホールディ ングス	3,500	1,139.00	3,986,500	
新日本製薬	4,300	1,382.00	5,942,600	
エステー	10,100	1,537.00	15,523,700	貸付有価証券 200株
アグロ カネショウ	5,200	1,228.00	6,385,600	貸付有価証券 2,400株
コニシ	25,700	1,580.00	40,606,000	
長谷川香料	27,000	2,340.00	63,180,000	
星光 P M C	8,800	612.00	5,385,600	
小林製薬	43,900	9,760.00	428,464,000	貸付有価証券 200株
荒川化学工業	13,100	1,138.00	14,907,800	

メック	11,700	3,040.00	35,568,000	
日本高純度化学	4,300	2,548.00	10,956,400	
タカラバイオ	41,000	2,414.00	98,974,000	
J C U	17,600	4,700.00	82,720,000	
新田ゼラチン	9,800	666.00	6,526,800	
O A T アグリオ	3,200	1,900.00	6,080,000	
デクセリアルズ	40,700	3,025.00	123,117,500	貸付有価証券 2,200株
アース製薬	12,900	5,550.00	71,595,000	
北興化学工業	14,600	833.00	12,161,800	
大成ラミック	4,800	2,747.00	13,185,600	
クミアイ化学工業	58,300	808.00	47,106,400	
日本農薬	27,900	538.00	15,010,200	
アキレス	10,000	1,275.00	12,750,000	
有沢製作所	22,900	1,003.00	22,968,700	
日東電工	94,700	8,350.00	790,745,000	
レック	20,400	961.00	19,604,400	
三光合成	17,900	360.00	6,444,000	貸付有価証券 400株
きもと	24,000	212.00	5,088,000	貸付有価証券 200株
藤森工業	14,100	4,030.00	56,823,000	
前澤化成工業	9,900	1,273.00	12,602,700	貸付有価証券 3,300株（100株）
未来工業	5,600	1,519.00	8,506,400	
ウェーブロックホールディングス	5,900	712.00	4,200,800	
J S P	9,200	1,592.00	14,646,400	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	28,800	3,245.00	93,456,000	
天馬	12,300	2,580.00	31,734,000	
信越ポリマー	28,100	1,098.00	30,853,800	
東リ	39,000	227.00	8,853,000	
ニフコ	52,300	3,550.00	185,665,000	貸付有価証券 100株
バルカー	12,700	2,549.00	32,372,300	
ユニ・チャーム	301,900	4,287.00	1,294,245,300	貸付有価証券 2,500株

ショーエイコーポレーション	4,200	644.00	2,704,800	貸付有価証券 200株（200株）
協和キリン	183,800	3,070.00	564,266,000	貸付有価証券 16,700株
武田薬品工業	1,230,900	3,536.00	4,352,462,400	貸付有価証券 2,000株
アステラス製薬	1,357,900	1,991.50	2,704,257,850	貸付有価証券 900株
大日本住友製薬	96,700	1,292.00	124,936,400	
塩野義製薬	197,000	7,681.00	1,513,157,000	
わかもと製薬	18,600	295.00	5,487,000	貸付有価証券 900株
日本新薬	41,000	7,710.00	316,110,000	
中外製薬	489,800	3,908.00	1,914,138,400	
科研製薬	24,600	4,215.00	103,689,000	
エーザイ	187,500	5,906.00	1,107,375,000	
ロート製薬	80,400	3,750.00	301,500,000	
小野薬品工業	359,600	2,851.50	1,025,399,400	
久光製薬	41,400	3,750.00	155,250,000	
持田製薬	19,800	3,870.00	76,626,000	
参天製薬	292,000	1,305.00	381,060,000	
扶桑薬品工業	5,500	2,353.00	12,941,500	
日本ケミファ	1,900	2,178.00	4,138,200	
ツムラ	48,500	3,250.00	157,625,000	
日医工	48,600	858.00	41,698,800	貸付有価証券 300株
キッセイ薬品工業	27,700	2,436.00	67,477,200	
生化学工業	27,600	903.00	24,922,800	
栄研化学	27,500	1,756.00	48,290,000	
日水製薬	5,800	992.00	5,753,600	
鳥居薬品	8,400	2,984.00	25,065,600	
JCRファーマ	44,100	2,160.00	95,256,000	
東和薬品	22,500	3,120.00	70,200,000	
富士製薬工業	9,600	1,023.00	9,820,800	
ゼリア新薬工業	28,400	1,976.00	56,118,400	貸付有価証券 900株
第一三共	1,230,700	2,547.50	3,135,208,250	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	1,852.00	58,152,800	
大幸薬品	23,600	661.00	15,599,600	貸付有価証券 8,900株
ダイト	10,100	2,946.00	29,754,600	
大塚ホールディングス	325,500	4,053.00	1,319,251,500	貸付有価証券 200株
大正製薬ホールディングス	37,300	5,790.00	215,967,000	
ペプチドリーム	82,200	2,065.00	169,743,000	貸付有価証券 300株
あすか製薬ホールディングス	17,800	1,078.00	19,188,400	
サワイグループホールディングス	34,300	4,530.00	155,379,000	
日本コークス工業	132,300	137.00	18,125,100	
ニチレキ	20,000	1,314.00	26,280,000	
ユシロ化学工業	8,100	1,066.00	8,634,600	
ビーピー・カストロール	5,600	1,295.00	7,252,000	
富士石油	41,800	264.00	11,035,200	
MORESCO	5,200	1,154.00	6,000,800	貸付有価証券 400株(100株)
出光興産	173,800	3,050.00	530,090,000	
ENEOSホールディングス	2,356,000	452.20	1,065,383,200	
コスモエネルギーホールディングス	45,300	2,515.00	113,929,500	
横浜ゴム	90,700	1,773.00	160,811,100	
TOYO TIRE	82,400	1,617.00	133,240,800	
ブリヂストン	451,100	5,134.00	2,315,947,400	貸付有価証券 47,500株
住友ゴム工業	140,700	1,174.00	165,181,800	貸付有価証券 20,800株
藤倉コンポジット	12,500	699.00	8,737,500	
オカモト	9,300	4,085.00	37,990,500	
フコク	6,800	966.00	6,568,800	貸付有価証券 100株
ニッタ	16,200	2,752.00	44,582,400	
住友理工	30,400	602.00	18,300,800	
三ツ星ベルト	19,000	2,097.00	39,843,000	

バンドー化学	25,300	859.00	21,732,700	貸付有価証券 300株
日東紡績	23,300	3,230.00	75,259,000	
A G C	143,800	5,590.00	803,842,000	貸付有価証券 1,500株
日本板硝子	75,200	515.00	38,728,000	貸付有価証券 7,600株
石塚硝子	2,700	2,057.00	5,553,900	
日本山村硝子	6,000	818.00	4,908,000	
日本電気硝子	62,900	2,876.00	180,900,400	貸付有価証券 1,300株
オハラ	6,200	1,163.00	7,210,600	貸付有価証券 1,000株
住友大阪セメント	29,000	3,555.00	103,095,000	
太平洋セメント	89,000	2,336.00	207,904,000	貸付有価証券 300株
日本ヒューム	15,700	699.00	10,974,300	
日本コンクリート工業	30,900	300.00	9,270,000	
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	440.00	10,604,000	
東海カーボン	131,200	1,188.00	155,865,600	貸付有価証券 2,200株
日本カーボン	8,100	4,210.00	34,101,000	
東洋炭素	10,200	3,170.00	32,334,000	貸付有価証券 2,800株
ノリタケカンパニーリミ テド	8,700	4,510.00	39,237,000	
T O T O	111,900	5,030.00	562,857,000	貸付有価証券 600株
日本碍子	169,700	1,870.00	317,339,000	
日本特殊陶業	119,100	2,151.00	256,184,100	
ダントーホールディング ス	10,200	335.00	3,417,000	貸付有価証券 6,300株
M A R U W A	5,400	14,340.00	77,436,000	
品川リフラクトリーズ	3,700	3,890.00	14,393,000	
黒崎播磨	2,700	4,350.00	11,745,000	
ヨータイ	10,000	1,254.00	12,540,000	
イソライト工業	6,900	1,481.00	10,218,900	貸付有価証券

				1,100株(300株)
東京窯業	19,900	306.00	6,089,400	
ニッカトー	7,100	576.00	4,089,600	
フジインコーポレー テッド	12,600	6,650.00	83,790,000	
クニミネ工業	4,900	1,015.00	4,973,500	
エーアンドエーマテリア ル	2,600	915.00	2,379,000	
ニチアス	36,300	2,646.00	96,049,800	
ニチハ	21,800	2,627.00	57,268,600	
日本製鉄	693,100	2,041.00	1,414,617,100	貸付有価証券 6,000株
神戸製鋼所	289,100	614.00	177,507,400	貸付有価証券 200株
中山製鋼所	24,500	465.00	11,392,500	
合同製鐵	8,300	1,365.00	11,329,500	
ジェイ エフ イー ホールディングス	418,300	1,675.00	700,652,500	貸付有価証券 4,500株
東京製鐵	52,800	1,160.00	61,248,000	
共英製鋼	17,500	1,643.00	28,752,500	
大和工業	29,600	3,700.00	109,520,000	貸付有価証券 700株
東京鐵鋼	6,800	1,377.00	9,363,600	貸付有価証券 3,100株
大阪製鐵	8,200	1,215.00	9,963,000	貸付有価証券 200株
淀川製鋼所	20,300	2,780.00	56,434,000	貸付有価証券 100株
丸一鋼管	54,800	2,985.00	163,578,000	貸付有価証券 200株
モリ工業	4,600	2,524.00	11,610,400	
大同特殊鋼	25,400	4,270.00	108,458,000	
日本高周波鋼業	5,700	347.00	1,977,900	貸付有価証券 100株
日本冶金工業	11,300	2,881.00	32,555,300	貸付有価証券 200株
山陽特殊製鋼	15,900	2,158.00	34,312,200	
愛知製鋼	8,700	2,603.00	22,646,100	
日立金属	166,800	2,090.00	348,612,000	貸付有価証券 22,300株(9,000株)

日本金属	3,900	1,360.00	5,304,000	
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	347.00	34,700,000	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	963.00	2,022,300	
日本鑄鉄管	1,600	1,005.00	1,608,000	
三菱製鋼	9,900	1,247.00	12,345,300	
日亜鋼業	20,100	281.00	5,648,100	貸付有価証券 200株
日本精線	2,500	4,425.00	11,062,500	貸付有価証券 100株
エンビプロ・ホールディングス	5,100	1,311.00	6,686,100	貸付有価証券 200株
シンニッタン	18,700	230.00	4,301,000	
新家工業	3,800	1,766.00	6,710,800	
大紀アルミニウム工業所	23,300	1,665.00	38,794,500	貸付有価証券 600株
日本軽金属ホールディングス	39,200	1,850.00	72,520,000	
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	2,721.00	23,400,600	
三菱マテリアル	102,300	2,116.00	216,466,800	
住友金属鉱山	198,000	5,362.00	1,061,676,000	貸付有価証券 1,500株
DOWAホールディングス	42,200	4,945.00	208,679,000	
古河機械金属	25,600	1,302.00	33,331,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	17,900	883.00	15,805,700	
東邦チタニウム	27,700	913.00	25,290,100	
UACJ	23,500	2,361.00	55,483,500	
CKサンエツ	3,200	4,015.00	12,848,000	貸付有価証券 1,500株
古河電気工業	48,100	2,410.00	115,921,000	
住友電気工業	579,000	1,589.50	920,320,500	
フジクラ	172,600	666.00	114,951,600	貸付有価証券 3,000株

昭和電線ホールディングス	13,500	1,864.00	25,164,000	
東京特殊電線	2,300	2,842.00	6,536,600	
タツタ電線	27,300	454.00	12,394,200	
カナレ電気	2,300	1,507.00	3,466,100	貸付有価証券 1,000株
平河ヒューテック	8,600	1,165.00	10,019,000	貸付有価証券 3,900株
リョービ	19,000	1,131.00	21,489,000	
アーレスティ	16,500	387.00	6,385,500	
アサヒホールディングス	62,000	2,194.00	136,028,000	貸付有価証券 1,000株
稲葉製作所	8,700	1,304.00	11,344,800	
宮地エンジニアリンググループ	4,700	3,525.00	16,567,500	
トーカコ	39,900	1,329.00	53,027,100	
アルファC o	6,000	1,091.00	6,546,000	
SUMCO	238,400	2,066.00	492,534,400	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	
RS Technologies	5,000	5,500.00	27,500,000	
ジェイテックコーポレーション	2,000	1,554.00	3,108,000	貸付有価証券 400株(400株)
信和	9,600	824.00	7,910,400	
東洋製罐グループホールディングス	98,600	1,610.00	158,746,000	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	900.00	7,740,000	
横河ブリッジホールディングス	26,600	2,088.00	55,540,800	
駒井ハルテック	2,900	2,108.00	6,113,200	
高田機工	1,400	2,889.00	4,044,600	貸付有価証券 600株
三和ホールディングス	146,000	1,290.00	188,340,000	
文化シャッター	49,100	1,059.00	51,996,900	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
三協立山	19,900	627.00	12,477,300	
アルインコ	11,300	910.00	10,283,000	

東洋シャッター	3,400	568.00	1,931,200	
L I X I L	243,700	2,607.00	635,325,900	貸付有価証券 800株
日本フィルコン	10,800	518.00	5,594,400	
ノーリツ	29,600	1,608.00	47,596,800	貸付有価証券 1,700株
長府製作所	15,700	1,993.00	31,290,100	
リンナイ	29,200	9,850.00	287,620,000	
ダイニチ工業	7,400	702.00	5,194,800	
日東精工	19,400	516.00	10,010,400	
三洋工業	1,900	1,845.00	3,505,500	
岡部	29,600	732.00	21,667,200	貸付有価証券 100株
ジーテクト	19,200	1,452.00	27,878,400	
東ブレ	28,900	1,249.00	36,096,100	
高周波熱錬	27,700	605.00	16,758,500	
東京製綱	9,500	862.00	8,189,000	
サンコール	13,200	499.00	6,586,800	
モリテック スチール	12,100	315.00	3,811,500	
パイオラックス	22,200	1,759.00	39,049,800	
エイチワン	15,200	666.00	10,123,200	
日本発條	142,400	900.00	128,160,000	
中央発條	7,500	797.00	5,977,500	
アドバネクス	2,000	1,615.00	3,230,000	
立川ブラインド工業	6,800	1,082.00	7,357,600	
三益半導体工業	12,100	2,374.00	28,725,400	
日本ドライケミカル	3,800	1,794.00	6,817,200	貸付有価証券 1,600株
日本製鋼所	47,000	3,610.00	169,670,000	
三浦工業	67,000	3,220.00	215,740,000	貸付有価証券 100株
タクマ	52,500	1,468.00	77,070,000	
ツガミ	34,000	1,288.00	43,792,000	貸付有価証券 300株
オークマ	18,100	4,815.00	87,151,500	
芝浦機械	17,500	3,040.00	53,200,000	
アマダ	244,500	1,052.00	257,214,000	
アイダエンジニアリング	40,500	998.00	40,419,000	

滝澤鉄工所	4,500	1,206.00	5,427,000	
F U J I	71,300	2,360.00	168,268,000	
牧野フライス製作所	16,900	3,715.00	62,783,500	
オーエスジー	71,600	1,995.00	142,842,000	
ダイジェット工業	1,700	1,005.00	1,708,500	
旭ダイヤモンド工業	40,600	582.00	23,629,200	
D M G 森精機	91,900	1,745.00	160,365,500	貸付有価証券 700株
ソディック	34,000	774.00	26,316,000	貸付有価証券 200株
ディスコ	22,800	33,850.00	771,780,000	
日東工器	8,500	1,617.00	13,744,500	
日進工具	12,200	1,423.00	17,360,600	
パンチ工業	12,900	504.00	6,501,600	
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	758.00	4,169,000	貸付有価証券 1,300株
東洋機械金属	10,100	570.00	5,757,000	
津田駒工業	3,000	585.00	1,755,000	貸付有価証券 100株
エンシュウ	3,400	669.00	2,274,600	
島精機製作所	22,600	1,830.00	41,358,000	
オプトラン	19,400	1,985.00	38,509,000	貸付有価証券 1,000株
N C ホールディングス	4,400	1,862.00	8,192,800	
イワキポンプ	9,800	1,028.00	10,074,400	
フリー	13,800	1,034.00	14,269,200	貸付有価証券 6,300株
ヤマシンフィルタ	31,200	361.00	11,263,200	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	1,315.00	39,450,000	貸付有価証券 1,300株
野村マイクロ・サイエンス	4,100	3,720.00	15,252,000	貸付有価証券 1,900株
平田機工	7,300	5,400.00	39,420,000	
ペガサスミシン製造	15,700	523.00	8,211,100	
マルマエ	6,300	2,406.00	15,157,800	

タツモ	7,200	1,595.00	11,484,000	
ナブテスコ	88,300	3,265.00	288,299,500	貸付有価証券 2,000株
三井海洋開発	16,500	1,176.00	19,404,000	
レオン自動機	16,600	1,048.00	17,396,800	
S M C	45,900	67,630.00	3,104,217,000	
ホソカワミクロン	10,900	2,734.00	29,800,600	
ユニオンツール	5,800	3,620.00	20,996,000	
オイレス工業	21,700	1,569.00	34,047,300	貸付有価証券 10,100株
日精エー・エス・ビー機 械	5,200	2,907.00	15,116,400	
サトーホールディングス	20,400	1,999.00	40,779,600	
技研製作所	13,700	3,730.00	51,101,000	
日本エアテック	7,100	1,007.00	7,149,700	貸付有価証券 3,000株
カワタ	4,900	1,019.00	4,993,100	
日精樹脂工業	10,800	1,019.00	11,005,200	
オカダアイヨン	4,900	1,440.00	7,056,000	貸付有価証券 400株
ワイエイシイホールディ ングス	6,200	1,086.00	6,733,200	貸付有価証券 400株
小松製作所	709,700	2,737.50	1,942,803,750	
住友重機械工業	89,600	2,919.00	261,542,400	
日立建機	62,800	2,949.00	185,197,200	
日工	21,400	623.00	13,332,200	
巴工業	6,100	2,300.00	14,030,000	貸付有価証券 1,500株
井関農機	14,500	1,253.00	18,168,500	貸付有価証券 500株
T O W A	13,400	2,295.00	30,753,000	貸付有価証券 2,900株（2,700株）
丸山製作所	3,200	1,515.00	4,848,000	
北川鉄工所	7,000	1,363.00	9,541,000	
ローツェ	7,700	10,950.00	84,315,000	
タカキタ	5,400	616.00	3,326,400	貸付有価証券 2,300株
クボタ	758,700	2,102.50	1,595,166,750	貸付有価証券 21,200株

荏原実業	7,200	2,155.00	15,516,000	
三菱化工機	5,000	2,017.00	10,085,000	
月島機械	28,800	1,044.00	30,067,200	
帝国電機製作所	10,900	1,414.00	15,412,600	貸付有価証券 2,200株
東京機械製作所	6,400	736.00	4,710,400	
新東工業	34,500	702.00	24,219,000	貸付有価証券 100株
澁谷工業	13,700	2,523.00	34,565,100	
アイチ コーポレーショ ン	22,300	863.00	19,244,900	
小森コーポレーション	39,700	750.00	29,775,000	
鶴見製作所	12,000	1,773.00	21,276,000	
住友精密工業	2,300	1,934.00	4,448,200	
日本ギア工業	5,600	275.00	1,540,000	
酒井重工業	2,800	2,957.00	8,279,600	
荏原製作所	65,000	5,700.00	370,500,000	貸付有価証券 100株
石井鐵工所	2,200	3,015.00	6,633,000	
西島製作所	14,200	965.00	13,703,000	
北越工業	14,700	888.00	13,053,600	
ダイキン工業	199,500	21,745.00	4,338,127,500	貸付有価証券 600株
オルガノ	4,500	7,730.00	34,785,000	
トーヨーカネツ	5,900	2,406.00	14,195,400	
栗田工業	84,700	4,670.00	395,549,000	貸付有価証券 400株
椿本チエイン	20,500	3,315.00	67,957,500	
大同工業	6,900	924.00	6,375,600	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 700株
アネスト岩田	24,400	817.00	19,934,800	
ダイフク	86,200	8,550.00	737,010,000	貸付有価証券 100株
サムコ	3,900	2,314.00	9,024,600	貸付有価証券 700株(400株)
加藤製作所	7,400	828.00	6,127,200	
油研工業	2,600	1,767.00	4,594,200	

タダノ	81,900	1,003.00	82,145,700	
フジテック	58,100	2,658.00	154,429,800	貸付有価証券 100株
C K D	46,200	2,029.00	93,739,800	貸付有価証券 100株
キトー	13,300	1,690.00	22,477,000	
平和	43,700	1,942.00	84,865,400	
理想科学工業	13,100	2,213.00	28,990,300	
S A N K Y O	33,800	3,240.00	109,512,000	
日本金銭機械	15,900	655.00	10,414,500	
マースグループホール ディングス	9,900	1,634.00	16,176,600	貸付有価証券 100株
フクシマガリレイ	10,700	3,890.00	41,623,000	
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	2,610.00	62,118,000	貸付有価証券 1,000株
アマノ	41,000	2,261.00	92,701,000	
J U K I	21,800	696.00	15,172,800	
ジャノメ	13,300	722.00	9,602,600	貸付有価証券 600株
マックス	20,800	1,723.00	35,838,400	
グローリー	40,200	2,118.00	85,143,600	
新晃工業	14,600	1,739.00	25,389,400	
大和冷機工業	22,600	1,135.00	25,651,000	
セガサミーホールディン グス	155,300	2,162.00	335,758,600	
日本ピストンリング	5,700	1,380.00	7,866,000	
リケン	6,700	2,602.00	17,433,400	
T P R	21,100	1,433.00	30,236,300	
ツバキ・ナカシマ	34,400	1,026.00	35,294,400	貸付有価証券 5,300株
ホシザキ	45,800	8,010.00	366,858,000	貸付有価証券 300株
大豊工業	12,800	719.00	9,203,200	
日本精工	294,800	748.00	220,510,400	
N T N	336,600	231.00	77,754,600	貸付有価証券 2,700株

ジェイテクト	150,200	1,041.00	156,358,200	
不二越	13,300	4,200.00	55,860,000	貸付有価証券 200株
日本トムソン	42,900	552.00	23,680,800	
T H K	88,400	2,706.00	239,210,400	貸付有価証券 1,600株
ユーシン精機	12,100	694.00	8,397,400	
前澤給装工業	11,700	989.00	11,571,300	
イーグル工業	19,400	1,063.00	20,622,200	
前澤工業	10,400	636.00	6,614,400	
日本ピラー工業	15,800	2,862.00	45,219,600	貸付有価証券 400株
キッツ	52,700	678.00	35,730,600	貸付有価証券 700株
マキタ	190,600	4,162.00	793,277,200	貸付有価証券 400株
三井E & Sホールディング グス	56,600	365.00	20,659,000	貸付有価証券 19,100株
日立造船	132,400	787.00	104,198,800	
三菱重工業	246,100	3,318.00	816,559,800	
I H I	97,800	2,664.00	260,539,200	
サノヤスホールディング ス	19,300	130.00	2,509,000	貸付有価証券 500株（500株）
スター精密	23,600	1,501.00	35,423,600	貸付有価証券 100株
日清紡ホールディングス	95,800	1,040.00	99,632,000	貸付有価証券 11,500株
イビデン	82,200	5,700.00	468,540,000	
コニカミノルタ	342,200	503.00	172,126,600	
ブラザー工業	191,200	2,103.00	402,093,600	
ミネベアミツミ	270,000	2,545.00	687,150,000	
日立製作所	753,200	6,123.00	4,611,843,600	貸付有価証券 3,200株
東芝	273,700	4,579.00	1,253,272,300	貸付有価証券 1,300株
三菱電機	1,566,000	1,446.00	2,264,436,000	貸付有価証券 16,600株
富士電機	94,400	6,100.00	575,840,000	
東洋電機製造	5,700	971.00	5,534,700	貸付有価証券 100株

安川電機	168,600	4,740.00	799,164,000	貸付有価証券 7,400株
シンフォニアテクノロジー	18,800	1,313.00	24,684,400	
明電舎	26,600	2,390.00	63,574,000	貸付有価証券 100株
オリジン	3,900	1,239.00	4,832,100	
山洋電気	6,900	4,965.00	34,258,500	
デンヨー	13,300	1,744.00	23,195,200	
PHCホールディングス	18,000	1,553.00	27,954,000	
東芝テック	16,800	4,980.00	83,664,000	貸付有価証券 300株
芝浦メカトロニクス	2,800	7,880.00	22,064,000	
マブチモーター	36,300	4,105.00	149,011,500	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	397.00	2,739,300	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	2,546.00	20,113,400	貸付有価証券 400株(400株)
東光高岳	8,700	1,436.00	12,493,200	
ダブル・スコープ	45,000	1,090.00	49,050,000	貸付有価証券 8,200株(4,800株)
ダイヘン	17,100	4,120.00	70,452,000	
ヤーマン	25,500	923.00	23,536,500	貸付有価証券 9,800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	738.00	10,332,000	
I-PEX	7,300	1,508.00	11,008,400	貸付有価証券 500株
日新電機	36,700	1,452.00	53,288,400	
大崎電気工業	28,700	485.00	13,919,500	
オムロン	130,400	8,006.00	1,043,982,400	
日東工業	20,900	1,615.00	33,753,500	
I D E C	19,400	2,412.00	46,792,800	
正興電機製作所	4,900	1,094.00	5,360,600	貸付有価証券 2,200株(2,100株)
不二電機工業	2,900	1,076.00	3,120,400	
ジーエス・ユアサ コー	50,900	2,416.00	122,974,400	

ポレーション				
サクサホールディングス	3,600	1,397.00	5,029,200	
メルコホールディングス	3,500	3,845.00	13,457,500	
テクノメディカ	3,500	1,547.00	5,414,500	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	1,015.00	4,466,000	貸付有価証券 1,500株（1,500株）
日本電気	199,000	5,120.00	1,018,880,000	
富士通	140,900	16,380.00	2,307,942,000	
沖電気工業	63,600	913.00	58,066,800	
岩崎通信機	6,400	822.00	5,260,800	
電気興業	8,200	2,401.00	19,688,200	
サンケン電気	14,600	5,230.00	76,358,000	
ナカヨ	2,800	1,122.00	3,141,600	
アイホン	8,900	2,132.00	18,974,800	貸付有価証券 100株
ルネサスエレクトロニク ス	849,900	1,422.00	1,208,557,800	貸付有価証券 200株
セイコーエプソン	194,300	1,833.00	356,151,900	貸付有価証券 1,100株
ワコム	121,500	845.00	102,667,500	貸付有価証券 57,100株
アルバック	31,200	5,980.00	186,576,000	
アクセル	6,500	1,136.00	7,384,000	貸付有価証券 600株（600株）
E I Z O	12,200	3,680.00	44,896,000	
日本信号	39,900	885.00	35,311,500	
京三製作所	33,600	428.00	14,380,800	
能美防災	20,700	2,024.00	41,896,800	貸付有価証券 200株
ホーチキ	11,300	1,228.00	13,876,400	
星和電機	7,100	496.00	3,521,600	貸付有価証券 100株
エレコム	35,900	1,535.00	55,106,500	貸付有価証券 100株
パナソニック	1,670,400	1,233.00	2,059,603,200	
シャープ	178,500	1,314.00	234,549,000	貸付有価証券 4,200株
アンリツ	100,900	1,625.00	163,962,500	貸付有価証券 47,400株

富士通ゼネラル	42,500	2,581.00	109,692,500	
ソニーグループ	981,100	12,075.00	11,846,782,500	
T D K	226,800	4,735.00	1,073,898,000	
帝国通信工業	6,900	1,388.00	9,577,200	
タムラ製作所	60,400	611.00	36,904,400	貸付有価証券 19,100株(4,500株)
アルプスアルパイン	138,600	1,225.00	169,785,000	
池上通信機	4,600	663.00	3,049,800	
日本電波工業	14,100	1,176.00	16,581,600	
鈴木	7,700	814.00	6,267,800	
メイコー	12,700	3,920.00	49,784,000	
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	2,855.00	26,266,000	
フォスター電機	15,800	798.00	12,608,400	
S M K	3,600	2,173.00	7,822,800	
ヨコオ	11,600	2,763.00	32,050,800	
ティアック	25,300	123.00	3,111,900	貸付有価証券 1,800株(1,500株)
ホシデン	37,800	1,183.00	44,717,400	
ヒロセ電機	24,100	17,200.00	414,520,000	
日本航空電子工業	35,900	1,826.00	65,553,400	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	1,214.00	37,755,400	
古野電気	18,600	1,045.00	19,437,000	
ユニデンホールディング ス	3,400	3,420.00	11,628,000	
スミダコーポレーション	14,700	862.00	12,671,400	
アイコム	5,800	2,380.00	13,804,000	貸付有価証券 2,700株
リオン	6,000	2,111.00	12,666,000	
本多通信工業	12,200	494.00	6,026,800	貸付有価証券 5,300株
横河電機	156,700	1,850.00	289,895,000	貸付有価証券 200株
新電元工業	6,000	3,010.00	18,060,000	
アズビル	91,800	4,130.00	379,134,000	

東亜ディーケーケー	7,700	919.00	7,076,300	貸付有価証券 3,300株
日本光電工業	64,700	3,150.00	203,805,000	
チノー	5,000	1,500.00	7,500,000	貸付有価証券 1,100株（600株）
共和電業	15,000	381.00	5,715,000	
日本電子材料	8,000	2,049.00	16,392,000	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
堀場製作所	29,000	6,680.00	193,720,000	貸付有価証券 100株
アドバンテスト	116,400	9,560.00	1,112,784,000	貸付有価証券 500株
小野測器	6,500	498.00	3,237,000	
エスペック	12,700	2,043.00	25,946,100	
キーエンス	141,900	53,970.00	7,658,343,000	
日置電機	7,500	6,600.00	49,500,000	
シスメックス	132,500	8,619.00	1,142,017,500	
日本マイクロニクス	27,200	1,736.00	47,219,200	
メガチップス	14,600	3,850.00	56,210,000	
OBARA GROUP	7,100	3,160.00	22,436,000	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
澤藤電機	1,900	1,531.00	2,908,900	
原田工業	7,400	988.00	7,311,200	貸付有価証券 3,400株
コーセル	17,400	820.00	14,268,000	
イリソ電子工業	13,100	4,180.00	54,758,000	貸付有価証券 1,600株
オブテックスグループ	25,700	1,637.00	42,070,900	
千代田インテグレ	6,600	1,911.00	12,612,600	
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	21,455.00	1,476,104,000	貸付有価証券 2,600株
スタンレー電気	109,400	2,887.00	315,837,800	貸付有価証券 1,300株
岩崎電気	5,700	2,283.00	13,013,100	
ウシオ電機	80,300	1,874.00	150,482,200	
岡谷電機産業	11,100	309.00	3,429,900	
ヘリオス テクノ ホールディング	13,300	298.00	3,963,400	

エノモト	4,300	1,511.00	6,497,300	
日本セラミック	14,600	2,448.00	35,740,800	貸付有価証券 900株
遠藤照明	7,200	1,040.00	7,488,000	
古河電池	11,200	1,253.00	14,033,600	貸付有価証券 4,000株(2,200株)
双信電機	7,500	561.00	4,207,500	貸付有価証券 1,200株
山一電機	11,300	1,989.00	22,475,700	
図研	10,200	3,025.00	30,855,000	
日本電子	32,600	6,670.00	217,442,000	貸付有価証券 100株
カシオ計算機	113,300	1,329.00	150,575,700	貸付有価証券 200株
ファナック	137,400	21,460.00	2,948,604,000	
日本シイエムケイ	30,700	614.00	18,849,800	貸付有価証券 100株
エンプラス	3,900	2,615.00	10,198,500	
大真空	21,100	1,134.00	23,927,400	貸付有価証券 100株
ローム	70,100	9,430.00	661,043,000	
浜松ホトニクス	112,400	5,670.00	637,308,000	
三井ハイテック	15,400	8,100.00	124,740,000	貸付有価証券 6,900株
新光電気工業	46,000	4,890.00	224,940,000	
京セラ	220,300	6,857.00	1,510,597,100	
太陽誘電	76,000	5,190.00	394,440,000	
村田製作所	460,000	7,981.00	3,671,260,000	
双葉電子工業	26,800	678.00	18,170,400	
北陸電気工業	5,800	1,325.00	7,685,000	
ニチコン	49,300	1,250.00	61,625,000	貸付有価証券 900株
日本ケミコン	14,800	1,919.00	28,401,200	
K O A	23,600	1,451.00	34,243,600	
市光工業	18,700	522.00	9,761,400	貸付有価証券 200株
小糸製作所	86,000	6,410.00	551,260,000	
ミツバ	28,800	400.00	11,520,000	
S C R E E Nホールディ	27,200	11,780.00	320,416,000	

ングス				
キヤノン電子	14,400	1,604.00	23,097,600	貸付有価証券 500株
キヤノン	778,200	2,832.50	2,204,251,500	
リコー	434,600	1,042.00	452,853,200	
象印マホービン	42,400	1,437.00	60,928,800	
MUTOHホールディング グス	2,000	2,081.00	4,162,000	貸付有価証券 200株
東京エレクトロン	99,400	56,810.00	5,646,914,000	貸付有価証券 400株
トヨタ紡織	63,900	2,159.00	137,960,100	
芦森工業	2,900	908.00	2,633,200	
ユニプレス	23,300	813.00	18,942,900	
豊田自動織機	126,700	9,160.00	1,160,572,000	
モリタホールディングス	25,100	1,259.00	31,600,900	
三櫻工業	21,700	710.00	15,407,000	貸付有価証券 300株
デンソー	344,800	8,516.00	2,936,316,800	貸付有価証券 700株
東海理化電機製作所	41,200	1,576.00	64,931,200	
川崎重工業	114,300	2,116.00	241,858,800	
名村造船所	47,000	283.00	13,301,000	貸付有価証券 7,400株
日本車輛製造	5,700	2,080.00	11,856,000	
三菱ロジスネクスト	20,700	965.00	19,975,500	貸付有価証券 6,300株
近畿車輛	2,400	1,053.00	2,527,200	
日産自動車	1,847,000	615.00	1,135,905,000	
いすゞ自動車	491,400	1,598.00	785,257,200	
トヨタ自動車	7,932,700	2,184.00	17,325,016,800	貸付有価証券 16,400株
日野自動車	195,600	1,085.00	212,226,000	
三菱自動車工業	579,700	335.00	194,199,500	
エフテック	10,900	541.00	5,896,900	
レシップホールディング ス	6,200	533.00	3,304,600	
GMB	2,800	792.00	2,217,600	
ファルテック	2,700	699.00	1,887,300	
武蔵精密工業	34,900	1,915.00	66,833,500	貸付有価証券

				6,300株
日産車体	22,900	677.00	15,503,300	貸付有価証券 200株
新明和工業	44,200	934.00	41,282,800	
極東開発工業	29,100	1,498.00	43,591,800	
トピー工業	12,900	1,132.00	14,602,800	
ティラド	4,500	2,565.00	11,542,500	
タチエス	27,400	1,163.00	31,866,200	
N O K	75,800	1,251.00	94,825,800	
フタバ産業	39,200	405.00	15,876,000	
K Y B	16,300	3,075.00	50,122,500	
大同メタル工業	30,000	638.00	19,140,000	
プレス工業	77,600	386.00	29,953,600	
ミクニ	19,900	417.00	8,298,300	
太平洋工業	32,800	1,036.00	33,980,800	
河西工業	19,200	293.00	5,625,600	貸付有価証券 300株
アイシン	114,600	4,385.00	502,521,000	
マツダ	491,500	933.00	458,569,500	貸付有価証券 2,600株
今仙電機製作所	10,300	592.00	6,097,600	貸付有価証券 200株
本田技研工業	1,233,100	3,687.00	4,546,439,700	
スズキ	358,200	4,787.00	1,714,703,400	貸付有価証券 19,000株
S U B A R U	448,800	1,968.50	883,462,800	
安永	7,500	839.00	6,292,500	
ヤマハ発動機	204,300	2,718.00	555,287,400	貸付有価証券 1,600株
T B K	17,200	406.00	6,983,200	
エクセディ	23,600	1,701.00	40,143,600	貸付有価証券 600株
豊田合成	50,600	2,294.00	116,076,400	
愛三工業	24,500	745.00	18,252,500	
盟和産業	2,200	1,007.00	2,215,400	
日本プラスト	12,300	553.00	6,801,900	
ヨロズ	14,600	984.00	14,366,400	貸付有価証券 6,800株
エフ・シー・シー	25,600	1,453.00	37,196,800	貸付有価証券

				800株
シマノ	62,900	26,860.00	1,689,494,000	貸付有価証券 100株
テイ・エス テック	66,100	1,587.00	104,900,700	
ジャムコ	9,100	819.00	7,452,900	
テルモ	443,200	3,712.00	1,645,158,400	
クリエートメディック	4,700	975.00	4,582,500	
日機装	47,000	791.00	37,177,000	
日本エム・ディ・エム	9,000	1,593.00	14,337,000	
島津製作所	201,500	4,100.00	826,150,000	貸付有価証券 800株
J M S	13,200	622.00	8,210,400	
クボテック	3,400	273.00	928,200	貸付有価証券 300株(100株)
長野計器	11,300	1,302.00	14,712,600	貸付有価証券 100株
ブイ・テクノロジー	6,800	3,535.00	24,038,000	
東京計器	10,000	1,037.00	10,370,000	貸付有価証券 4,600株
愛知時計電機	6,700	1,954.00	13,091,800	
インターアクション	7,800	2,013.00	15,701,400	貸付有価証券 2,400株(900株)
オーバル	14,000	271.00	3,794,000	
東京精密	26,500	4,800.00	127,200,000	貸付有価証券 1,300株
マニー	62,400	1,617.00	100,900,800	
ニコン	239,100	1,307.00	312,503,700	
トプコン	73,600	1,507.00	110,915,200	
オリンパス	821,300	2,296.50	1,886,115,450	貸付有価証券 2,800株
理研計器	12,700	4,645.00	58,991,500	貸付有価証券 500株(200株)
タムロン	12,200	2,340.00	28,548,000	貸付有価証券 900株
H O Y A	305,600	15,155.00	4,631,368,000	
シード	7,300	516.00	3,766,800	
ノーリツ鋼機	14,100	1,848.00	26,056,800	
エー・アンド・デイ	14,300	928.00	13,270,400	貸付有価証券 200株
朝日インテック	171,700	2,348.00	403,151,600	

				貸付有価証券 2,000株
シチズン時計	183,400	506.00	92,800,400	
リズム	4,900	1,438.00	7,046,200	
大研医器	12,400	527.00	6,534,800	
メニコン	51,900	2,938.00	152,482,200	貸付有価証券 1,700株
シンシア	1,700	501.00	851,700	貸付有価証券 700株
松風	6,500	1,822.00	11,843,000	貸付有価証券 3,000株
セイコーホールディングス	22,100	2,334.00	51,581,400	貸付有価証券 300株
ニプロ	116,700	1,110.00	129,537,000	
中本パックス	4,400	1,703.00	7,493,200	貸付有価証券 2,000株
スノーピーク	20,400	2,521.00	51,428,400	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	1,980.00	59,400,000	
トランザクション	8,600	996.00	8,565,600	貸付有価証券 2,300株(200株)
粧美堂	4,600	420.00	1,932,000	貸付有価証券 2,000株
ニホンフラッシュ	13,400	1,055.00	14,137,000	
前田工織	17,300	3,205.00	55,446,500	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	730.00	9,782,000	
バンダイナムコホールディングス	140,300	7,848.00	1,101,074,400	
アイフィスジャパン	4,000	676.00	2,704,000	貸付有価証券 1,700株
共立印刷	26,200	154.00	4,034,800	
SHOEI	14,700	4,550.00	66,885,000	
フランスベッドホールディングス	20,100	918.00	18,451,800	
パイロットコーポレーション	26,400	4,615.00	121,836,000	貸付有価証券 11,600株
萩原工業	10,100	1,229.00	12,412,900	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	1,772.00	67,336,000	
タカラトミー	65,500	1,283.00	84,036,500	
広済堂ホールディングス	9,700	856.00	8,303,200	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	702.00	3,790,800	貸付有価証券 2,300株
プロネクサス	12,100	1,087.00	13,152,700	
ホクシン	11,000	153.00	1,683,000	貸付有価証券 4,900株
ウッドワン	4,800	1,021.00	4,900,800	
大建工業	9,200	2,302.00	21,178,400	
凸版印刷	238,000	2,282.00	543,116,000	
大日本印刷	185,100	2,944.00	544,934,400	
共同印刷	4,500	2,784.00	12,528,000	
N I S S H A	32,100	1,378.00	44,233,800	貸付有価証券 100株
光村印刷	1,400	1,515.00	2,121,000	
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	2,242.00	310,517,000	貸付有価証券 1,900株
ツツミ	3,900	1,854.00	7,230,600	貸付有価証券 700株
ローランド	10,900	4,155.00	45,289,500	
小松ウオール工業	4,800	1,879.00	9,019,200	
ヤマハ	91,100	5,470.00	498,317,000	
河合楽器製作所	4,400	2,991.00	13,160,400	
クリナップ	14,600	553.00	8,073,800	
ピジョン	94,600	2,303.00	217,863,800	貸付有価証券 44,200株(8,900株)
兼松サステック	1,000	1,719.00	1,719,000	
キングジム	13,800	888.00	12,254,400	貸付有価証券 200株
リンテック	33,500	2,626.00	87,971,000	
イトーキ	28,900	360.00	10,404,000	
任天堂	88,400	59,480.00	5,258,032,000	

三菱鉛筆	25,800	1,256.00	32,404,800	
タカラスタンダード	32,400	1,360.00	44,064,000	貸付有価証券 300株
コクヨ	75,100	1,598.00	120,009,800	
ナカバヤシ	14,000	508.00	7,112,000	
グローブライド	14,000	2,731.00	38,234,000	
オカムラ	53,800	1,168.00	62,838,400	
美津濃	15,500	2,287.00	35,448,500	
東京電力ホールディングス	1,172,100	371.00	434,849,100	貸付有価証券 4,500株
中部電力	479,100	1,131.00	541,862,100	
関西電力	593,400	1,164.00	690,717,600	
中国電力	244,700	901.00	220,474,700	
北陸電力	143,200	560.00	80,192,000	
東北電力	366,800	739.00	271,065,200	
四国電力	141,000	808.00	113,928,000	
九州電力	322,800	847.00	273,411,600	貸付有価証券 2,800株
北海道電力	136,100	507.00	69,002,700	貸付有価証券 1,500株
沖縄電力	33,200	1,409.00	46,778,800	貸付有価証券 2,400株
電源開発	133,500	1,880.00	250,980,000	
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	1,679.00	38,617,000	貸付有価証券 200株
レノバ	30,600	1,368.00	41,860,800	貸付有価証券 7,700株
東京瓦斯	300,200	2,303.00	691,360,600	貸付有価証券 200株
大阪瓦斯	283,600	2,100.00	595,560,000	
東邦瓦斯	71,900	3,010.00	216,419,000	
北海道瓦斯	7,800	1,516.00	11,824,800	
広島ガス	29,900	351.00	10,494,900	
西部ガスホールディングス	17,600	2,227.00	39,195,200	
静岡ガス	40,800	851.00	34,720,800	貸付有価証券 1,400株

メタウォーター	16,300	2,054.00	33,480,200	
SBSホールディングス	11,600	2,947.00	34,185,200	貸付有価証券 2,500株
東武鉄道	153,000	2,971.00	454,563,000	
相鉄ホールディングス	50,100	2,286.00	114,528,600	貸付有価証券 1,300株
東急	395,000	1,605.00	633,975,000	貸付有価証券 1,100株
京浜急行電鉄	201,100	1,284.00	258,212,400	貸付有価証券 400株
小田急電鉄	232,900	2,192.00	510,516,800	
京王電鉄	81,300	5,360.00	435,768,000	貸付有価証券 100株
京成電鉄	109,000	3,480.00	379,320,000	
富士急行	18,700	4,180.00	78,166,000	貸付有価証券 1,600株
新京成電鉄	3,600	2,021.00	7,275,600	
東日本旅客鉄道	275,600	7,269.00	2,003,336,400	
西日本旅客鉄道	189,800	5,185.00	984,113,000	
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	1,262.00	258,079,000	
鴻池運輸	24,900	1,180.00	29,382,000	
西日本鉄道	43,400	2,734.00	118,655,600	貸付有価証券 200株
ハマキョウレックス	11,100	2,906.00	32,256,600	
サカイ引越センター	7,200	4,530.00	32,616,000	
近鉄グループホールディングス	148,300	3,665.00	543,519,500	貸付有価証券 1,300株
阪急阪神ホールディングス	185,500	3,565.00	661,307,500	貸付有価証券 500株
南海電気鉄道	66,200	2,419.00	160,137,800	
京阪ホールディングス	66,000	3,125.00	206,250,000	
神戸電鉄	3,500	3,400.00	11,900,000	貸付有価証券 1,600株
名古屋鉄道	121,900	2,167.00	264,157,300	
山陽電気鉄道	11,400	1,996.00	22,754,400	貸付有価証券 5,300株
アルプス物流	10,300	1,048.00	10,794,400	
ヤマトホールディングス	207,800	2,193.00	455,705,400	貸付有価証券

				800株
山九	39,000	4,025.00	156,975,000	
丸運	8,500	245.00	2,082,500	
丸全昭和運輸	12,000	3,210.00	38,520,000	
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	3,790.00	13,644,000	
ニッコンホールディングス	49,800	2,167.00	107,916,600	
日本石油輸送	1,600	2,653.00	4,244,800	
福山通運	24,400	4,050.00	98,820,000	
セイノーホールディングス	101,000	1,215.00	122,715,000	貸付有価証券 300株
エスライン	4,500	924.00	4,158,000	
神奈川中央交通	3,700	3,555.00	13,153,500	貸付有価証券 1,700株
日立物流	28,600	5,840.00	167,024,000	
丸和運輸機関	31,300	1,071.00	33,522,300	貸付有価証券 6,400株
C & F ロジホールディングス	15,000	1,246.00	18,690,000	
九州旅客鉄道	114,700	2,626.00	301,202,200	貸付有価証券 1,000株
S Gホールディングス	280,200	2,532.00	709,466,400	
NIPPON EXPRESSホールディングス	51,300	7,350.00	377,055,000	
日本郵船	124,000	10,280.00	1,274,720,000	
商船三井	82,100	9,400.00	771,740,000	
川崎汽船	45,700	7,800.00	356,460,000	
NSユナイテッド海運	8,200	4,165.00	34,153,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
明治海運	17,500	953.00	16,677,500	貸付有価証券 5,800株(1,900株)
飯野海運	68,800	855.00	58,824,000	貸付有価証券 300株
共栄タンカー	2,600	1,053.00	2,737,800	貸付有価証券 300株(300株)
乾汽船	10,100	2,813.00	28,411,300	貸付有価証券 1,000株
日本航空	340,100	2,365.00	804,336,500	

ANAホールディングス	376,800	2,630.00	990,984,000	貸付有価証券 58,300株（11,900株）
パスコ	2,800	1,327.00	3,715,600	
トランコム	4,100	7,290.00	29,889,000	
日新	11,800	1,722.00	20,319,600	
三菱倉庫	47,000	2,800.00	131,600,000	
三井倉庫ホールディングス	15,700	2,328.00	36,549,600	
住友倉庫	52,400	2,138.00	112,031,200	
澁澤倉庫	8,900	2,217.00	19,731,300	
東陽倉庫	24,900	320.00	7,968,000	貸付有価証券 100株
日本トランスシティ	32,600	632.00	20,603,200	
ケイヒン	2,500	1,405.00	3,512,500	
中央倉庫	9,000	980.00	8,820,000	貸付有価証券 4,200株
川西倉庫	2,700	1,151.00	3,107,700	貸付有価証券 1,200株
安田倉庫	12,200	975.00	11,895,000	
ファイズホールディングス	3,200	605.00	1,936,000	貸付有価証券 200株（200株）
東洋埠頭	4,500	1,519.00	6,835,500	
上組	81,600	2,207.00	180,091,200	
サンリツ	4,100	845.00	3,464,500	
キムラユニティー	3,900	1,360.00	5,304,000	貸付有価証券 1,800株
キューソー流通システム	7,400	972.00	7,192,800	貸付有価証券 3,300株
近鉄エクスプレス	28,000	2,931.00	82,068,000	
東海運	8,400	309.00	2,595,600	
エーアイティー	9,300	1,416.00	13,168,800	
内外トランスライン	5,700	1,906.00	10,864,200	貸付有価証券 2,500株
日本コンセプト	4,700	1,501.00	7,054,700	貸付有価証券 100株（100株）
NEC ネットエスアイ	50,800	1,722.00	87,477,600	
クロスキャット	4,000	1,773.00	7,092,000	貸付有価証券 200株
システナ	219,200	387.00	84,830,400	

デジタルアーツ	8,200	6,220.00	51,004,000	
日鉄ソリューションズ	22,200	3,570.00	79,254,000	
キューブシステム	7,800	918.00	7,160,400	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	1,540.00	10,010,000	
ラクーンホールディングス	13,000	1,134.00	14,742,000	貸付有価証券 3,700株(800株)
ソリトンシステムズ	7,700	1,523.00	11,727,100	貸付有価証券 200株(200株)
ソフトクリエイイトホールディングス	6,700	4,115.00	27,570,500	
T I S	146,500	2,620.00	383,830,000	
J N Sホールディングス	7,100	418.00	2,967,800	貸付有価証券 300株
グリー	69,900	815.00	56,968,500	貸付有価証券 43,700株(5,400株)
GMOベパボ	1,600	2,340.00	3,744,000	
コーエーテックモホールディングス	49,000	4,010.00	196,490,000	貸付有価証券 3,600株(3,300株)
三菱総合研究所	6,600	3,700.00	24,420,000	貸付有価証券 100株
ボルテージ	4,100	350.00	1,435,000	貸付有価証券 400株(100株)
電算	1,700	2,290.00	3,893,000	
A G S	7,800	795.00	6,201,000	
ファインデックス	12,900	704.00	9,081,600	貸付有価証券 400株
ブレインパッド	13,000	1,097.00	14,261,000	貸付有価証券 600株(600株)
K L a b	28,200	406.00	11,449,200	貸付有価証券 700株
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	22,300	1,020.00	22,746,000	
ネクソン	346,700	2,445.00	847,681,500	貸付有価証券 500株
アイスタイル	39,700	190.00	7,543,000	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	878.00	15,540,600	貸付有価証券 5,000株(4,000株)

エイチーム	10,600	726.00	7,695,600	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 3,400株
テクノスジャパン	11,900	447.00	5,319,300	
e n i s h	9,400	339.00	3,186,600	貸付有価証券 900株
コロプラ	50,500	636.00	32,118,000	貸付有価証券 1,000株
オルトプラス	11,800	313.00	3,693,400	貸付有価証券 600株
ブロードリーフ	76,200	333.00	25,374,600	貸付有価証券 43,600株
クロス・マーケティング グループ	5,800	925.00	5,365,000	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	1,518.00	10,626,000	
システム情報	11,500	1,012.00	11,638,000	
メディアドゥ	5,400	2,504.00	13,521,600	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
じげん	43,400	298.00	12,933,200	
ブイキューブ	15,600	753.00	11,746,800	貸付有価証券 6,200株(5,400株)
エンカレッジ・テクノロ ジ	3,400	527.00	1,791,800	
サイバーリンクス	5,100	905.00	4,615,500	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	703.00	11,529,200	貸付有価証券 700株
C A R T A H O L D I N G S	6,200	2,368.00	14,681,600	貸付有価証券 200株(200株)
オブティム	10,700	880.00	9,416,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
セレス	5,700	1,375.00	7,837,500	貸付有価証券 2,600株(2,500株)
S H I F T	7,800	19,830.00	154,674,000	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
ティーガイア	13,600	1,728.00	23,500,800	
セック	2,200	2,111.00	4,644,200	

テクマトリックス	26,000	1,568.00	40,768,000	
プロシップ	5,100	1,412.00	7,201,200	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	2,804.00	111,879,600	
GMOペイメントゲート ウェイ	29,800	10,200.00	303,960,000	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	1,811.00	8,149,500	
インターネットイニシア ティブ	40,900	3,395.00	138,855,500	
さくらインターネット	16,500	524.00	8,646,000	貸付有価証券 6,700株
ヴィンクス	4,300	976.00	4,196,800	
GMOグローバルサイ ン・ホールディングス	3,400	3,990.00	13,566,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
SRAホールディングス	7,400	2,884.00	21,341,600	
システムインテグレータ	4,800	535.00	2,568,000	貸付有価証券 100株
朝日ネット	14,000	598.00	8,372,000	貸付有価証券 100株
eBASE	18,300	612.00	11,199,600	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	1,608.00	8,844,000	貸付有価証券 100株(100株)
ODKソリューションズ	3,200	655.00	2,096,000	
フリービット	8,000	897.00	7,176,000	貸付有価証券 300株
コムチュア	17,200	2,794.00	48,056,800	
サイバーコム	2,300	968.00	2,226,400	
アステリア	11,100	727.00	8,069,700	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
アイル	8,500	1,303.00	11,075,500	
マークライnz	7,700	2,643.00	20,351,100	
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)
gumi	21,300	560.00	11,928,000	貸付有価証券 100株
ショーケース	3,300	444.00	1,465,200	

モバイルファクトリー	3,500	929.00	3,251,500	貸付有価証券 1,600株(900株)
テラスカイ	5,600	1,428.00	7,996,800	貸付有価証券 2,800株(1,000株)
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,800	1,266.00	8,608,800	
P C Iホールディングス	6,900	945.00	6,520,500	
パイプドHD	2,800	2,609.00	7,305,200	貸付有価証券 900株(900株)
アイビーシー	2,500	575.00	1,437,500	
ネオジャパン	4,300	1,067.00	4,588,100	貸付有価証券 900株(700株)
P R T I M E S	3,300	2,942.00	9,708,600	貸付有価証券 1,500株(1,200株)
ラクス	52,900	1,736.00	91,834,400	
ランドコンピュータ	3,500	851.00	2,978,500	
ダブルスタンダード	4,600	1,848.00	8,500,800	貸付有価証券 100株
オープンドア	9,100	2,049.00	18,645,900	貸付有価証券 3,300株(1,800株)
マイネット	5,500	498.00	2,739,000	
アカツキ	6,900	2,820.00	19,458,000	
ベネフィットジャパン	1,200	1,922.00	2,306,400	
U b i c o mホールディングス	4,000	1,995.00	7,980,000	貸付有価証券 1,400株(100株)
カナミックネットワーク	16,400	446.00	7,314,400	
ノムラシステムコーポレーション	7,900	220.00	1,738,000	貸付有価証券 600株(600株)
チェンジ	28,400	1,688.00	47,939,200	貸付有価証券 6,300株(200株)
シンクロ・フード	7,800	252.00	1,965,600	貸付有価証券 700株(700株)
オークネット	8,200	1,512.00	12,398,400	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	777.00	2,408,700	
セグエグループ	4,000	536.00	2,144,000	
エイトレッド	2,200	1,936.00	4,259,200	貸付有価証券 1,300株
マクロミル	33,400	1,210.00	40,414,000	
ピーグリー	3,600	1,248.00	4,492,800	貸付有価証券

				700株
オロ	4,800	2,381.00	11,428,800	貸付有価証券 200株(200株)
ユーザーローカル	4,700	1,545.00	7,261,500	
テモナ	3,300	398.00	1,313,400	貸付有価証券 700株(700株)
ニーズウェル	3,500	608.00	2,128,000	
マネーフォワード	23,400	4,575.00	107,055,000	貸付有価証券 1,100株
サインポスト	5,000	878.00	4,390,000	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	2,753.00	17,343,900	
ソルクシーズ	13,000	409.00	5,317,000	
フェイス	4,000	672.00	2,688,000	貸付有価証券 1,800株
プロトコーポレーション	16,300	1,264.00	20,603,200	
ハイマックス	4,100	1,206.00	4,944,600	
野村総合研究所	296,900	3,840.00	1,140,096,000	
サイバネットシステム	10,900	629.00	6,856,100	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	2,129.00	6,387,000	
イメージホールディングス	17,700	1,750.00	30,975,000	貸付有価証券 600株(500株)
東邦システムサイエンス	4,000	928.00	3,712,000	貸付有価証券 1,700株
ソースネクスト	66,300	153.00	10,143,900	貸付有価証券 24,100株(10,800株)
インフォコム	16,800	2,024.00	34,003,200	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	1,594.00	28,532,600	
HEROZ	4,400	905.00	3,982,000	貸付有価証券 1,000株(900株)
ラクスル	16,800	3,130.00	52,584,000	貸付有価証券 4,000株(2,400株)
I P S	4,200	1,957.00	8,219,400	貸付有価証券 1,900株(500株)
F I G	16,700	286.00	4,776,200	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	492.00	4,624,800	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	1,310.00	25,414,000	
東海ソフト	2,400	918.00	2,203,200	
ウイングアーク1st	8,800	1,247.00	10,973,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	3,500	1,727.00	6,044,500	貸付有価証券 800株(200株)
サーバーワークス	2,600	2,335.00	6,071,000	貸付有価証券 200株(200株)
東名	1,400	952.00	1,332,800	
ヴィッツ	1,400	1,238.00	1,733,200	貸付有価証券 100株
トピラシステムズ	3,100	805.00	2,495,500	貸付有価証券 600株(600株)
Sansan	54,600	1,024.00	55,910,400	
Link-U	2,700	742.00	2,003,400	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
ギフトィ	14,000	885.00	12,390,000	
ベース	2,600	4,875.00	12,675,000	
JMDC	14,400	5,720.00	82,368,000	貸付有価証券 3,400株(2,000株)
フォーカスシステムズ	10,300	915.00	9,424,500	貸付有価証券 4,800株
クレスコ	11,200	1,762.00	19,734,400	
フジ・メディア・ホールディングス	148,000	1,272.00	188,256,000	
オービック	48,400	18,110.00	876,524,000	貸付有価証券 100株
ジャストシステム	21,900	5,350.00	117,165,000	貸付有価証券 100株
TDCソフト	13,400	1,118.00	14,981,200	
Zホールディングス	2,233,600	560.60	1,252,156,160	貸付有価証券 400株
トレンドマイクロ	82,100	5,780.00	474,538,000	貸付有価証券 7,700株
IDホールディングス	9,700	855.00	8,293,500	
日本オラクル	24,900	8,140.00	202,686,000	

アルファシステムズ	4,100	3,710.00	15,211,000	
フューチャー	32,400	1,319.00	42,735,600	
C A C H o l d i n g S	9,000	1,300.00	11,700,000	
S B テクノロジー	6,600	2,531.00	16,704,600	
トーセ	4,200	722.00	3,032,400	
オービックビジネスコン サルタント	14,700	4,215.00	61,960,500	
伊藤忠テクノソリュー ションズ	70,000	2,942.00	205,940,000	
アイティフォー	18,600	774.00	14,396,400	
東計電算	1,800	4,880.00	8,784,000	
エクスネット	2,400	987.00	2,368,800	
大塚商会	83,100	4,310.00	358,161,000	貸付有価証券 9,600株
サイボウズ	20,500	1,311.00	26,875,500	
電通国際情報サービス	22,200	3,600.00	79,920,000	
A C C E S S	17,300	589.00	10,189,700	
デジタルガレージ	25,400	3,975.00	100,965,000	
E M 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
C I J	9,900	811.00	8,028,900	
ビジネスエンジニアリン グ	1,800	3,570.00	6,426,000	貸付有価証券 100株
日本エンタープライズ	15,600	171.00	2,667,600	
WOWOW	7,400	1,773.00	13,120,200	貸付有価証券 3,200株
スカラ	12,900	670.00	8,643,000	貸付有価証券 100株
インテリジェント ウェ イブ	7,700	554.00	4,265,800	
I M A G I C A G R O U P	13,100	627.00	8,213,700	貸付有価証券 300株
ネットワンシステムズ	58,500	2,778.00	162,513,000	
システムソフト	33,000	94.00	3,102,000	貸付有価証券 7,100株
アルゴグラフィックス	12,000	3,135.00	37,620,000	
マーベラス	24,200	728.00	17,617,600	

エイベックス	26,500	1,346.00	35,669,000	
日本ユニシス	48,000	3,085.00	148,080,000	
兼松エレクトロニクス	8,400	3,855.00	32,382,000	
都築電気	7,800	1,383.00	10,787,400	貸付有価証券 3,400株
TBSホールディングス	93,400	1,914.00	178,767,600	貸付有価証券 200株
日本テレビホールディングス	128,300	1,344.00	172,435,200	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	758.00	11,597,400	貸付有価証券 1,200株
テレビ朝日ホールディングス	36,900	1,630.00	60,147,000	
スカパーJSATホールディングス	130,100	443.00	57,634,300	
テレビ東京ホールディングス	11,000	2,149.00	23,639,000	
日本BS放送	5,200	1,063.00	5,527,600	貸付有価証券 2,400株
ビジョン	26,300	1,178.00	30,981,400	
スマートバリュー	3,500	451.00	1,578,500	
USEN-NEXT HOLDINGS	14,600	2,351.00	34,324,600	貸付有価証券 6,800株
ワイヤレスゲート	6,300	301.00	1,896,300	
コネクシオ	10,900	1,408.00	15,347,200	
日本通信	127,800	177.00	22,620,600	貸付有価証券 60,000株（51,000株）
クロップス	2,800	905.00	2,534,000	
日本電信電話	1,607,700	3,296.00	5,298,979,200	貸付有価証券 5,700株
KDDI	1,120,300	3,779.00	4,233,613,700	貸付有価証券 500株
ソフトバンク	2,327,600	1,444.50	3,362,218,200	
光通信	17,700	14,360.00	254,172,000	
エムティーアイ	14,900	480.00	7,152,000	
GMOインターネット	54,400	2,505.00	136,272,000	
ファイバーゲート	7,000	1,283.00	8,981,000	貸付有価証券 1,600株（500株）
アイドママーケティングコミュニケーション	3,300	294.00	970,200	

KADOKAWA	83,900	2,475.00	207,652,500	貸付有価証券 500株
学研ホールディングス	21,700	998.00	21,656,600	
ゼンリン	25,100	1,071.00	26,882,100	
昭文社ホールディングス	6,200	447.00	2,771,400	
インプレスホールディングス	12,700	204.00	2,590,800	貸付有価証券 200株
アイネット	7,900	1,280.00	10,112,000	
松竹	10,200	11,990.00	122,298,000	
東宝	90,700	4,775.00	433,092,500	
東映	5,000	17,280.00	86,400,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	409,200	2,098.00	858,501,600	
ピー・シー・エー	9,000	1,446.00	13,014,000	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	1,521.00	8,061,300	
D T S	29,400	2,701.00	79,409,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	71,500	5,570.00	398,255,000	貸付有価証券 100株
シーイーシー	16,500	1,092.00	18,018,000	貸付有価証券 300株
カブコン	144,900	2,791.00	404,415,900	
アイ・エス・ビー	7,200	975.00	7,020,000	貸付有価証券 700株
ジャステック	8,900	1,048.00	9,327,200	貸付有価証券 1,300株
S C S K	106,400	1,917.00	203,968,800	
日本システムウエア	5,800	2,089.00	12,116,200	
アイネス	13,900	1,529.00	21,253,100	
T K C	26,000	3,085.00	80,210,000	
富士ソフト	16,400	5,510.00	90,364,000	貸付有価証券 300株(300株)
N S D	49,400	2,121.00	104,777,400	
コナミホールディングス	55,800	6,760.00	377,208,000	
福井コンピュータホールディングス	7,000	3,050.00	21,350,000	
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	1,394.00	18,819,000	

ソフトバンクグループ	921,500	5,184.00	4,777,056,000	貸付有価証券 1,500株
ハウスイ	1,200	820.00	984,000	
高千穂交易	5,900	1,523.00	8,985,700	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	1,517.00	3,792,500	
伊藤忠食品	3,700	5,020.00	18,574,000	
エレマテック	12,300	1,077.00	13,247,100	
JALUX	4,300	2,557.00	10,995,100	
あらた	12,300	3,915.00	48,154,500	
トーメンデバイス	2,300	6,240.00	14,352,000	貸付有価証券 400株
東京エレクトロン デバイス	4,600	5,330.00	24,518,000	
フィールズ	13,500	635.00	8,572,500	
双日	170,400	1,974.00	336,369,600	
アルフレッサ ホールディングス	171,400	1,775.00	304,235,000	
横浜冷凍	43,200	872.00	37,670,400	
神栄	2,100	850.00	1,785,000	
ラサ商事	8,200	1,019.00	8,355,800	
アルコニックス	19,200	1,343.00	25,785,600	貸付有価証券 100株
神戸物産	119,700	3,810.00	456,057,000	貸付有価証券 15,400株
ハイパー	3,800	477.00	1,812,600	貸付有価証券 100株
あい ホールディングス	22,000	1,770.00	38,940,000	
ディービーエックス	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	1,786.00	133,950,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	36,800	2,627.00	96,673,600	
ラクト・ジャパン	5,300	2,035.00	10,785,500	貸付有価証券 100株(100株)
グリムス	6,900	2,093.00	14,441,700	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
バイタルケーエスケー・	26,800	811.00	21,734,800	

ホールディングス				
八洲電機	11,100	967.00	10,733,700	貸付有価証券 5,200株
メディアスホールディングス	8,800	909.00	7,999,200	
レスターホールディングス	14,600	1,975.00	28,835,000	
ジューテックホールディングス	3,500	1,228.00	4,298,000	
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	1,345.00	6,052,500	貸付有価証券 100株
TOKAIホールディングス	74,700	906.00	67,678,200	
黒谷	4,200	673.00	2,826,600	貸付有価証券 1,600株（400株）
Cominix	2,700	743.00	2,006,100	
三洋貿易	15,500	1,020.00	15,810,000	
ビューティガレージ	2,500	3,255.00	8,137,500	
ウイン・パートナーズ	11,100	1,057.00	11,732,700	貸付有価証券 5,200株
ミタチ産業	3,900	878.00	3,424,200	
シップヘルスケアホールディングス	49,400	2,365.00	116,831,000	貸付有価証券 6,700株
明治電機工業	4,800	1,251.00	6,004,800	
デリカフーズホールディングス	6,000	553.00	3,318,000	貸付有価証券 2,600株
スターティアホールディングス	3,500	625.00	2,187,500	貸付有価証券 400株
コメダホールディングス	33,700	2,137.00	72,016,900	貸付有価証券 100株
ピーバンドットコム	2,100	605.00	1,270,500	
アセンテック	5,300	697.00	3,694,100	貸付有価証券 200株
富士興産	3,800	946.00	3,594,800	
協栄産業	1,600	1,526.00	2,441,600	
フルサト・マルカホールディングス	14,800	2,296.00	33,980,800	
ヤマエグループホールディングス	10,400	1,056.00	10,982,400	

小野建	14,900	1,621.00	24,152,900	
南陽	3,100	1,945.00	6,029,500	
佐鳥電機	9,600	918.00	8,812,800	
エコートレーディング	3,200	603.00	1,929,600	貸付有価証券 1,500株
伯東	9,400	2,343.00	22,024,200	
コンドーテック	11,900	1,027.00	12,221,300	
中山福	8,100	408.00	3,304,800	
ナガイレーベン	20,500	2,127.00	43,603,500	
三菱食品	14,800	3,145.00	46,546,000	
松田産業	11,200	2,244.00	25,132,800	貸付有価証券 200株
第一興商	29,300	3,620.00	106,066,000	
メディパルホールディングス	166,500	2,102.00	349,983,000	貸付有価証券 300株
S P K	6,100	1,319.00	8,045,900	
萩原電気ホールディングス	5,700	2,077.00	11,838,900	
アズワン	22,100	6,500.00	143,650,000	貸付有価証券 600株
スズデン	5,300	2,105.00	11,156,500	
尾家産業	4,100	1,011.00	4,145,100	
シモジマ	9,400	1,015.00	9,541,000	貸付有価証券 4,400株
ドウシシャ	14,500	1,527.00	22,141,500	
小津産業	3,400	2,011.00	6,837,400	
高速	9,200	1,571.00	14,453,200	
たけびし	5,800	1,441.00	8,357,800	貸付有価証券 2,700株
リックス	3,500	1,616.00	5,656,000	
丸文	13,600	718.00	9,764,800	
ハピネット	12,900	1,590.00	20,511,000	貸付有価証券 100株
橋本総業ホールディングス	3,100	2,012.00	6,237,200	
日本ライフライン	45,700	1,041.00	47,573,700	
タカショー	11,700	669.00	7,827,300	貸付有価証券 5,200株(500株)
I D O M	46,800	659.00	30,841,200	

進和	9,100	2,042.00	18,582,200	
エスケイジャパン	3,700	426.00	1,576,200	貸付有価証券 700株(500株)
ダイترون	6,500	1,809.00	11,758,500	
シークス	22,100	1,193.00	26,365,300	
田中商事	4,700	649.00	3,050,300	
オーハシテクニカ	8,300	1,360.00	11,288,000	
白銅	5,000	2,596.00	12,980,000	
ダイコー通産	1,800	1,184.00	2,131,200	
伊藤忠商事	1,078,900	3,844.00	4,147,291,600	
丸紅	1,521,500	1,237.00	1,882,095,500	
高島	2,200	2,372.00	5,218,400	
長瀬産業	84,700	1,869.00	158,304,300	貸付有価証券 100株
蝶理	8,600	1,807.00	15,540,200	
豊田通商	154,900	5,110.00	791,539,000	
三共生興	20,400	570.00	11,628,000	
兼松	57,500	1,394.00	80,155,000	
ツカモトコーポレーショ ン	2,600	1,350.00	3,510,000	
三井物産	1,197,800	3,100.00	3,713,180,000	
日本紙パルプ商事	8,000	4,125.00	33,000,000	
カメイ	18,300	1,051.00	19,233,300	
東都水産	800	3,900.00	3,120,000	貸付有価証券 400株
OUGホールディングス	2,200	2,751.00	6,052,200	貸付有価証券 1,000株
スターゼン	11,400	2,124.00	24,213,600	
山善	64,900	1,024.00	66,457,600	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
椿本興業	3,200	4,105.00	13,136,000	
住友商事	973,500	1,904.00	1,853,544,000	
内田洋行	6,600	4,665.00	30,789,000	
三菱商事	1,155,800	4,090.00	4,727,222,000	
第一実業	7,000	4,375.00	30,625,000	
キャノンマーケティング ジャパン	38,200	2,465.00	94,163,000	
西華産業	8,100	1,619.00	13,113,900	

佐藤商事	12,700	1,203.00	15,278,100	
菱洋エレクトロ	9,100	2,155.00	19,610,500	貸付有価証券 4,200株(1,400株)
東京産業	13,900	702.00	9,757,800	
ユアサ商事	14,600	2,994.00	43,712,400	
神鋼商事	3,400	3,830.00	13,022,000	
トルク	8,200	220.00	1,804,000	
阪和興業	30,900	3,310.00	102,279,000	貸付有価証券 100株
正栄食品工業	10,000	4,195.00	41,950,000	貸付有価証券 4,700株
カナデン	12,500	1,012.00	12,650,000	
菱電商事	12,200	1,785.00	21,777,000	貸付有価証券 5,600株
岩谷産業	37,000	5,360.00	198,320,000	
ナイス	5,300	1,854.00	9,826,200	
ニチモウ	2,200	2,817.00	6,197,400	
極東貿易	4,400	2,311.00	10,168,400	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	944.00	35,872,000	貸付有価証券 1,700株
稲畑産業	34,000	2,437.00	82,858,000	
G S Iクレオス	7,400	1,138.00	8,421,200	貸付有価証券 3,300株
明和産業	14,200	1,116.00	15,847,200	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	609.00	3,714,900	貸付有価証券 2,800株
ワキタ	32,900	1,012.00	33,294,800	
東邦ホールディングス	49,500	1,881.00	93,109,500	
サンゲツ	40,800	1,576.00	64,300,800	
ミツウロコグループホールディングス	22,700	1,056.00	23,971,200	
シナネンホールディングス	5,700	3,330.00	18,981,000	
伊藤忠エネクス	34,100	1,025.00	34,952,500	
サンリオ	47,600	2,500.00	119,000,000	
サンワテクノス	9,400	1,364.00	12,821,600	

リョーサン	17,000	2,344.00	39,848,000	
新光商事	23,100	908.00	20,974,800	
トーホー	7,000	1,101.00	7,707,000	貸付有価証券 500株（500株）
三信電気	7,100	1,679.00	11,920,900	
東陽テクニカ	15,200	1,085.00	16,492,000	
モスフードサービス	20,200	3,020.00	61,004,000	
加賀電子	14,000	3,225.00	45,150,000	
ソーダニッカ	15,100	813.00	12,276,300	貸付有価証券 100株
立花エレテック	12,300	1,576.00	19,384,800	貸付有価証券 5,700株
フォーバル	6,700	858.00	5,748,600	
PALTAC	21,600	4,520.00	97,632,000	
三谷産業	18,000	317.00	5,706,000	
太平洋興発	5,700	651.00	3,710,700	
西本Wismettac ホールディングス	3,500	2,851.00	9,978,500	
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,400	1,988.00	2,783,200	貸付有価証券 200株
コア商事ホールディン グス	9,600	696.00	6,681,600	貸付有価証券 1,000株（600株）
国際紙パルプ商事	32,100	365.00	11,716,500	
ヤマタネ	7,200	1,636.00	11,779,200	
丸紅建材リース	1,300	1,784.00	2,319,200	
日鉄物産	11,000	5,330.00	58,630,000	
泉州電業	4,200	6,270.00	26,334,000	貸付有価証券 1,200株
トラスコ中山	32,100	2,527.00	81,116,700	
オートバックスセブン	51,900	1,432.00	74,320,800	貸付有価証券 200株
モリト	11,200	747.00	8,366,400	貸付有価証券 100株
加藤産業	22,300	3,185.00	71,025,500	
北恵	3,900	927.00	3,615,300	貸付有価証券 1,800株
イノテック	9,300	1,426.00	13,261,800	
イエローハット	26,700	1,623.00	43,334,100	
J Kホールディングス	12,400	1,073.00	13,305,200	貸付有価証券

				7,700株
日伝	12,800	2,320.00	29,696,000	
北沢産業	10,400	232.00	2,412,800	貸付有価証券 100株
杉本商事	7,200	2,186.00	15,739,200	
因幡電機産業	41,100	2,619.00	107,640,900	
東テク	5,100	2,469.00	12,591,900	
ミスミグループ本社	193,600	3,635.00	703,736,000	貸付有価証券 300株
アルテック	10,400	296.00	3,078,400	
タキヒヨー	4,600	1,327.00	6,104,200	貸付有価証券 2,100株
蔵王産業	3,000	1,896.00	5,688,000	
スズケン	60,300	3,615.00	217,984,500	
ジェコス	10,600	828.00	8,776,800	
グローセル	18,000	439.00	7,902,000	
ローソン	34,100	4,880.00	166,408,000	貸付有価証券 1,300株
サンエー	11,700	4,080.00	47,736,000	貸付有価証券 2,500株
カワチ薬品	12,000	2,387.00	28,644,000	
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	798.00	5,426,400	
アスクル	34,900	1,671.00	58,317,900	
ゲオホールディングス	20,600	1,553.00	31,991,800	
アダストリア	16,600	1,739.00	28,867,400	貸付有価証券 7,800株
ジーフット	9,300	334.00	3,106,200	貸付有価証券 4,300株(100株)
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,200	384.00	844,800	
くら寿司	16,100	3,840.00	61,824,000	貸付有価証券 5,600株(1,400株)
キャンドゥ	5,700	2,057.00	11,724,900	貸付有価証券 3,300株(1,000株)
アイケイ	4,800	420.00	2,016,000	
パルグループホールディングス	13,500	1,627.00	21,964,500	
エディオン	70,800	1,184.00	83,827,200	貸付有価証券

				23,700株(300株)
サーラコーポレーション	31,300	645.00	20,188,500	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
ワッツ	7,500	708.00	5,310,000	貸付有価証券 3,300株(100株)
ハローズ	7,000	2,803.00	19,621,000	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	1,325.00	17,225,000	貸付有価証券 5,800株
あみやき亭	3,700	3,025.00	11,192,500	貸付有価証券 1,700株
ひらまつ	32,700	208.00	6,801,600	
大黒天物産	4,900	4,750.00	23,275,000	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	1,022.00	13,899,200	
ファーマライズホールディングス	3,800	713.00	2,709,400	貸付有価証券 1,600株
アルペン	11,500	2,132.00	24,518,000	貸付有価証券 5,200株
ハブ	5,000	617.00	3,085,000	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	1,329.00	25,118,100	
ジンズホールディングス	10,500	6,580.00	69,090,000	貸付有価証券 3,300株(3,000株)
ビックカメラ	91,500	1,023.00	93,604,500	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	2,181.00	425,295,000	貸付有価証券 4,800株(3,300株)
東京一番フーズ	3,900	595.00	2,320,500	貸付有価証券 300株
DDホールディングス	8,100	564.00	4,568,400	貸付有価証券 3,800株(100株)
きちりホールディングス	4,100	422.00	1,730,200	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	2,260.00	25,538,000	貸付有価証券 4,900株
J・フロントリテイリング	184,200	1,055.00	194,331,000	
ドトール・日レスホール	26,600	1,627.00	43,278,200	貸付有価証券

ディングス				12,500株
マツキヨココカラ & カンパニー	94,900	4,435.00	420,881,500	
ブロンコピリー	8,800	2,261.00	19,896,800	貸付有価証券 4,000株
Z O Z O	106,100	3,225.00	342,172,500	
トレジャー・ファクトリー	4,500	979.00	4,405,500	貸付有価証券 2,100株
物語コーポレーション	7,600	6,660.00	50,616,000	貸付有価証券 3,600株
三越伊勢丹ホールディングス	270,000	971.00	262,170,000	貸付有価証券 700株
H a m e e	5,500	1,105.00	6,077,500	貸付有価証券 1,800株
マーケットエンタープライズ	1,200	674.00	808,800	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	3,095.00	252,242,500	貸付有価証券 1,200株
クリエイイトSDホールディングス	22,700	3,125.00	70,937,500	
丸善CHIホールディングス	18,000	372.00	6,696,000	貸付有価証券 8,100株
ミサワ	3,100	646.00	2,002,600	貸付有価証券 1,400株
ティーライフ	2,100	1,350.00	2,835,000	
エー・ピーホールディングス	3,000	456.00	1,368,000	
チムニー	4,700	1,157.00	5,437,900	貸付有価証券 2,200株
シュッピン	12,800	1,158.00	14,822,400	貸付有価証券 1,700株(800株)
オイシックス・ラ・大地	22,200	2,626.00	58,297,200	貸付有価証券 400株
ネクステージ	31,200	2,559.00	79,840,800	貸付有価証券 3,500株(2,100株)
ジョイフル本田	46,400	1,549.00	71,873,600	貸付有価証券 19,800株
鳥貴族ホールディングス	5,700	1,854.00	10,567,800	貸付有価証券 1,000株
ホットランド	11,500	1,317.00	15,145,500	貸付有価証券 5,300株(900株)
すかいらーくホールディ	199,100	1,498.00	298,251,800	貸付有価証券

ングス				93,500株(2,600株)
SFPホールディングス	7,500	1,434.00	10,755,000	貸付有価証券 3,500株(100株)
綿半ホールディングス	11,600	1,317.00	15,277,200	
ヨシックスホールディングス	3,000	2,296.00	6,888,000	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	1,062.00	47,577,600	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	1,050.00	8,400,000	貸付有価証券 3,700株(100株)
B E E N O S	7,800	1,509.00	11,770,200	貸付有価証券 400株
あさひ	12,800	1,324.00	16,947,200	貸付有価証券 6,000株
日本調剤	9,300	1,399.00	13,010,700	
コスモス薬品	15,600	15,190.00	236,964,000	貸付有価証券 6,900株
トーエル	7,500	892.00	6,690,000	貸付有価証券 3,200株
セブン & アイ・ホールディングス	603,400	5,698.00	3,438,173,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	82,100	746.00	61,246,600	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	9,140.00	308,018,000	
サンマルクホールディングス	12,200	1,646.00	20,081,200	
フェリシモ	3,400	1,201.00	4,083,400	
トリドールホールディングス	38,300	2,622.00	100,422,600	貸付有価証券 800株
T O K Y O B A S E	14,100	438.00	6,175,800	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	897.00	2,601,300	
J Mホールディングス	10,400	1,758.00	18,283,200	
サツドラホールディングス	6,900	637.00	4,395,300	
アレンザホールディングス	11,700	1,076.00	12,589,200	貸付有価証券 5,500株
串カツ田中ホールディングス	4,100	2,077.00	8,515,700	貸付有価証券 100株
パロックジャパンリミ	10,700	858.00	9,180,600	貸付有価証券

テッド				5,000株
クスリのアオキホールディングス	15,300	6,970.00	106,641,000	貸付有価証券 100株
力の源ホールディングス	7,900	565.00	4,463,500	貸付有価証券 3,700株
FOOD & LIFE COMPANIE	90,300	3,745.00	338,173,500	
メディカルシステムネットワーク	14,900	512.00	7,628,800	
一家ホールディングス	3,200	524.00	1,676,800	
藤久ホールディングス	4,800	645.00	3,096,000	
はるやまホールディングス	7,200	556.00	4,003,200	貸付有価証券 3,300株
ノジマ	24,900	2,574.00	64,092,600	
カップ・クリエイト	21,600	1,384.00	29,894,400	貸付有価証券 10,100株(200株)
ライトオン	11,500	721.00	8,291,500	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
良品計画	177,500	1,743.00	309,382,500	
三城ホールディングス	19,100	251.00	4,794,100	
アドヴァングループ	15,700	940.00	14,758,000	
アルピス	5,000	2,227.00	11,135,000	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	1,704.00	3,237,600	
G-7ホールディングス	17,100	1,655.00	28,300,500	
イオン北海道	27,100	1,178.00	31,923,800	貸付有価証券 12,700株
コジマ	26,500	546.00	14,469,000	貸付有価証券 12,200株
ヒマラヤ	5,400	998.00	5,389,200	貸付有価証券 2,500株
コーナン商事	21,900	3,605.00	78,949,500	貸付有価証券 10,200株
エコス	5,700	2,018.00	11,502,600	貸付有価証券 1,500株
ワタミ	18,700	985.00	18,419,500	貸付有価証券 8,500株
マルシェ	3,700	461.00	1,705,700	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	1,867.00	575,782,800	
西松屋チェーン	33,800	1,393.00	47,083,400	貸付有価証券 15,700株(600株)
ゼンショーホールディングス	75,300	2,730.00	205,569,000	貸付有価証券 35,400株
幸楽苑ホールディングス	9,800	1,412.00	13,837,600	貸付有価証券 4,500株(700株)
ハークスレイ	6,400	473.00	3,027,200	
サイゼリヤ	22,900	2,939.00	67,303,100	
V Tホールディングス	58,000	493.00	28,594,000	貸付有価証券 900株
魚力	4,300	2,089.00	8,982,700	貸付有価証券 2,100株
ポブラ	4,000	144.00	576,000	貸付有価証券 1,800株
フジ・コーポレーション	8,200	1,167.00	9,569,400	
ユナイテッドアローズ	16,200	1,794.00	29,062,800	
ハイデイ日高	22,300	1,759.00	39,225,700	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	201.00	1,809,000	
コロワイド	63,400	1,749.00	110,886,600	貸付有価証券 29,700株(1,700株)
ピーシーデポコーポレーション	17,900	282.00	5,047,800	貸付有価証券 6,000株
壱番屋	10,900	4,670.00	50,903,000	貸付有価証券 1,500株
トップカルチャー	5,600	293.00	1,640,800	
P L A N T	3,900	653.00	2,546,700	
スギホールディングス	30,800	6,380.00	196,504,000	貸付有価証券 800株
薬王堂ホールディングス	7,700	2,403.00	18,503,100	貸付有価証券 2,100株(600株)
スクロール	23,700	927.00	21,969,900	貸付有価証券 300株
ヨンドシーホールディングス	14,200	1,715.00	24,353,000	貸付有価証券 4,100株(600株)
木曽路	20,700	2,230.00	46,161,000	貸付有価証券 8,900株
S R Sホールディングス	21,300	827.00	17,615,100	貸付有価証券

				10,000株(900株)
千趣会	27,800	371.00	10,313,800	貸付有価証券 12,600株
タカキュー	11,900	112.00	1,332,800	貸付有価証券 5,500株(100株)
リテールパートナーズ	18,700	1,185.00	22,159,500	貸付有価証券 8,200株
ケーヨー	28,500	872.00	24,852,000	貸付有価証券 100株
上新電機	17,700	2,069.00	36,621,300	
日本瓦斯	75,000	1,745.00	130,875,000	貸付有価証券 300株
ロイヤルホールディングス	26,500	2,016.00	53,424,000	貸付有価証券 11,800株
東天紅	1,100	952.00	1,047,200	
いなげや	19,100	1,390.00	26,549,000	
チヨダ	15,000	747.00	11,205,000	貸付有価証券 6,700株(100株)
ライフコーポレーション	14,400	2,989.00	43,041,600	
リンガーハット	19,000	2,240.00	42,560,000	貸付有価証券 8,900株
MrMaxHD	19,300	610.00	11,773,000	
テンアライド	15,000	319.00	4,785,000	貸付有価証券 6,200株
AOKIホールディングス	29,800	619.00	18,446,200	
オークワ	24,200	944.00	22,844,800	貸付有価証券 11,300株
コメリ	23,800	2,741.00	65,235,800	
青山商事	31,900	773.00	24,658,700	貸付有価証券 3,500株
しまむら	17,900	10,000.00	179,000,000	貸付有価証券 200株
はせがわ	8,200	302.00	2,476,400	
高島屋	112,400	1,174.00	131,957,600	
松屋	31,100	737.00	22,920,700	
エイチ・ツー・オー テイリング	73,100	879.00	64,254,900	貸付有価証券 200株
近鉄百貨店	5,900	2,632.00	15,528,800	貸付有価証券 2,700株
丸井グループ	121,700	2,325.00	282,952,500	

アクシアル リテイリング	11,900	3,250.00	38,675,000	
井筒屋	7,300	392.00	2,861,600	貸付有価証券 3,400株（1,400株）
イオン	593,500	2,655.50	1,576,039,250	
イズミ	27,900	3,210.00	89,559,000	貸付有価証券 200株
平和堂	28,500	1,975.00	56,287,500	貸付有価証券 13,300株
フジ	18,600	2,084.00	38,762,400	貸付有価証券 8,700株
ヤオコー	17,500	6,550.00	114,625,000	貸付有価証券 800株
ゼビオホールディングス	21,000	963.00	20,223,000	
ケースホールディングス	142,200	1,254.00	178,318,800	貸付有価証券 1,800株
Olympicグループ	7,900	713.00	5,632,700	
日産東京販売ホールディングス	22,700	234.00	5,311,800	
シルバーライフ	3,100	1,131.00	3,506,100	貸付有価証券 1,400株（1,100株）
Genky Drug Stores	6,800	3,620.00	24,616,000	貸付有価証券 400株
ナルミヤ・インターナショナル	3,400	1,015.00	3,451,000	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	1,044.00	9,396,000	貸付有価証券 800株
ギフト	2,400	2,327.00	5,584,800	
アインホールディングス	20,700	6,590.00	136,413,000	貸付有価証券 200株（100株）
元気寿司	4,300	2,582.00	11,102,600	貸付有価証券 2,000株
ヤマダホールディングス	564,000	403.00	227,292,000	
アークランドサカモト	24,100	1,531.00	36,897,100	
ニトリホールディングス	61,200	16,350.00	1,000,620,000	
グルメ杵屋	12,300	1,044.00	12,841,200	貸付有価証券 5,700株
愛眼	11,300	185.00	2,090,500	
ケーユーホールディングス	8,000	1,068.00	8,544,000	
吉野家ホールディングス	53,800	2,406.00	129,442,800	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	1,213.00	28,626,800	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	6,020.00	61,404,000	
プレナス	17,300	2,020.00	34,946,000	
ミニストップ	11,400	1,456.00	16,598,400	貸付有価証券 4,800株(200株)
アークス	29,400	2,177.00	64,003,800	貸付有価証券 13,800株
パローホールディングス	34,100	2,211.00	75,395,100	
ベルク	6,800	5,260.00	35,768,000	
大庄	8,200	1,013.00	8,306,600	貸付有価証券 3,800株
ファーストリテイリング	20,600	64,340.00	1,325,404,000	貸付有価証券 400株
サンドラッグ	58,000	3,145.00	182,410,000	貸付有価証券 200株
サックスパーホールディングス	14,500	520.00	7,540,000	貸付有価証券 400株
ヤマザワ	3,600	1,649.00	5,936,400	
やまや	3,200	2,549.00	8,156,800	貸付有価証券 1,000株
ベルーナ	33,100	736.00	24,361,600	貸付有価証券 600株
島根銀行	4,900	550.00	2,695,000	
じもとホールディングス	11,000	702.00	7,722,000	
めぶきフィナンシャルグループ	802,600	281.00	225,530,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,400	2,088.00	40,507,200	
九州フィナンシャルグループ	315,400	416.00	131,206,400	貸付有価証券 5,800株
ゆうちょ銀行	364,600	1,016.00	370,433,600	貸付有価証券 47,500株
富山第一銀行	36,800	318.00	11,702,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	882,200	491.00	433,160,200	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	842.00	84,957,800	
三十三フィナンシャルグ ループ	14,300	1,533.00	21,921,900	
第四北越フィナンシャル グループ	25,100	2,732.00	68,573,200	
ひろぎんホールディング ス	227,800	691.00	157,409,800	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	2,382.00	33,109,800	
十六フィナンシャルグ ループ	20,700	2,437.00	50,445,900	
北國フィナンシャルホー ルディングス	14,400	3,335.00	48,024,000	貸付有価証券 200株
新生銀行	100,800	2,188.00	220,550,400	貸付有価証券 8,500株
あおぞら銀行	86,300	2,686.00	231,801,800	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	726.30	7,035,668,100	
りそなホールディングス	1,767,900	537.90	950,953,410	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	4,164.00	1,215,888,000	
三井住友フィナンシャル グループ	1,069,200	4,266.00	4,561,207,200	
千葉銀行	515,500	774.00	398,997,000	貸付有価証券 1,300株
群馬銀行	296,700	400.00	118,680,000	貸付有価証券 1,100株
武蔵野銀行	23,000	1,925.00	44,275,000	貸付有価証券 500株
千葉興業銀行	36,300	279.00	10,127,700	貸付有価証券 100株
筑波銀行	60,200	220.00	13,244,000	貸付有価証券 200株
七十七銀行	48,500	1,561.00	75,708,500	
青森銀行	12,000	1,940.00	23,280,000	貸付有価証券 200株
秋田銀行	9,900	1,741.00	17,235,900	
山形銀行	17,400	1,013.00	17,626,200	
岩手銀行	10,100	1,947.00	19,664,700	

東邦銀行	128,900	223.00	28,744,700	
東北銀行	7,400	1,023.00	7,570,200	
みちのく銀行	9,900	892.00	8,830,800	
ふくおかフィナンシャル グループ	130,100	2,399.00	312,109,900	貸付有価証券 2,700株
静岡銀行	376,200	897.00	337,451,400	貸付有価証券 600株
スルガ銀行	135,400	453.00	61,336,200	貸付有価証券 300株
八十二銀行	347,900	441.00	153,423,900	貸付有価証券 800株
山梨中央銀行	16,700	967.00	16,148,900	
大垣共立銀行	30,500	2,052.00	62,586,000	
福井銀行	13,200	1,493.00	19,707,600	
清水銀行	6,400	1,646.00	10,534,400	
富山銀行	2,800	2,251.00	6,302,800	
滋賀銀行	29,000	2,261.00	65,569,000	
南都銀行	24,100	2,121.00	51,116,100	貸付有価証券 100株
百五銀行	148,300	360.00	53,388,000	貸付有価証券 500株
京都銀行	55,300	5,640.00	311,892,000	
紀陽銀行	52,400	1,571.00	82,320,400	
ほくほくフィナンシャル グループ	96,400	977.00	94,182,800	貸付有価証券 600株
山陰合同銀行	91,600	690.00	63,204,000	
中国銀行	123,400	920.00	113,528,000	
鳥取銀行	4,900	1,314.00	6,438,600	
伊予銀行	204,700	640.00	131,008,000	貸付有価証券 100株
百十四銀行	16,400	1,782.00	29,224,800	
四国銀行	23,500	808.00	18,988,000	貸付有価証券 100株
阿波銀行	23,700	2,346.00	55,600,200	
大分銀行	8,900	2,044.00	18,191,600	
宮崎銀行	9,600	2,244.00	21,542,400	
佐賀銀行	8,700	1,552.00	13,502,400	
琉球銀行	33,500	857.00	28,709,500	
セブン銀行	458,700	248.00	113,757,600	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	1,593.50	3,147,799,900	
高知銀行	5,600	762.00	4,267,200	
山口フィナンシャルグループ	179,900	737.00	132,586,300	貸付有価証券 100株
長野銀行	5,100	1,255.00	6,400,500	
名古屋銀行	11,500	3,200.00	36,800,000	貸付有価証券 1,800株
北洋銀行	232,800	269.00	62,623,200	
愛知銀行	5,600	4,835.00	27,076,000	
中京銀行	5,600	1,664.00	9,318,400	
大光銀行	5,300	1,471.00	7,796,300	
愛媛銀行	21,600	984.00	21,254,400	
トマト銀行	5,500	1,069.00	5,879,500	
京葉銀行	65,900	524.00	34,531,600	
栃木銀行	74,600	234.00	17,456,400	
北日本銀行	4,800	1,711.00	8,212,800	
東和銀行	27,100	582.00	15,772,200	
福島銀行	17,700	249.00	4,407,300	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	359.00	42,864,600	貸付有価証券 100株
フィデアホールディングス	14,100	1,413.00	19,923,300	貸付有価証券 100株
池田泉州ホールディングス	177,600	191.00	33,921,600	貸付有価証券 1,300株
F P G	52,000	858.00	44,616,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	12,000	1,170.00	14,040,000	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	532.00	3,245,200	
S B Iホールディングス	190,600	3,075.00	586,095,000	貸付有価証券 8,100株
日本アジア投資	12,200	178.00	2,171,600	
ジャフコ グループ	59,000	1,713.00	101,067,000	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	696.90	806,173,920	貸付有価証券 2,200株

野村ホールディングス	2,358,400	544.00	1,282,969,600	貸付有価証券 1,000株
岡三証券グループ	121,500	391.00	47,506,500	
丸三証券	45,900	545.00	25,015,500	貸付有価証券 7,300株
東洋証券	51,000	157.00	8,007,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	177,400	414.00	73,443,600	
光世証券	3,200	478.00	1,529,600	
水戸証券	41,200	282.00	11,618,400	
いちよし証券	28,900	663.00	19,160,700	
松井証券	75,600	820.00	61,992,000	
マネックスグループ	125,900	538.00	67,734,200	貸付有価証券 500株
極東証券	20,700	774.00	16,021,800	
岩井コスモホールディングス	14,600	1,413.00	20,629,800	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	234.00	3,837,600	
スパークス・グループ	71,300	260.00	18,538,000	貸付有価証券 400株
小林洋行	5,500	234.00	1,287,000	
かんぽ生命保険	155,500	2,090.00	324,995,000	
SOMPOホールディングス	253,600	5,390.00	1,366,904,000	
アニコムホールディングス	47,400	781.00	37,019,400	
MS&ADインシュアランスグループホール	346,400	3,993.00	1,383,175,200	貸付有価証券 1,300株
第一生命ホールディングス	760,300	2,652.00	2,016,315,600	貸付有価証券 4,400株
東京海上ホールディングス	508,700	7,038.00	3,580,230,600	貸付有価証券 400株
T&Dホールディングス	400,900	1,781.00	714,002,900	
アドバンスクリエイト	7,400	1,008.00	7,459,200	貸付有価証券 3,200株
全国保証	36,800	4,780.00	175,904,000	貸付有価証券 600株
あんしん保証	4,600	294.00	1,352,400	

ジェイリース	5,200	1,870.00	9,724,000	貸付有価証券 2,400株（200株）
イントラスト	6,500	588.00	3,822,000	
日本モーゲージサービス	8,600	1,024.00	8,806,400	
C a s a	5,400	846.00	4,568,400	貸付有価証券 1,900株
アルヒ	22,800	1,009.00	23,005,200	貸付有価証券 5,300株（5,300株）
プレミアグループ	7,800	4,310.00	33,618,000	
ネットプロテクションズ ホールディングス	35,200	608.00	21,401,600	貸付有価証券 15,300株（2,300株）
クレディセゾン	99,200	1,370.00	135,904,000	貸付有価証券 2,800株
芙蓉総合リース	16,200	7,800.00	126,360,000	
みずほリース	23,800	3,260.00	77,588,000	貸付有価証券 10,800株
東京センチュリー	29,900	5,630.00	168,337,000	
日本証券金融	60,700	906.00	54,994,200	
アイフル	259,200	364.00	94,348,800	貸付有価証券 1,600株
リコーリース	13,700	3,800.00	52,060,000	
イオンフィナンシャル サービス	84,000	1,245.00	104,580,000	
アコム	304,700	325.00	99,027,500	
ジャックス	17,100	3,245.00	55,489,500	
オリエントコーポレー ション	417,800	126.00	52,642,800	貸付有価証券 5,200株
オリックス	937,700	2,371.00	2,223,286,700	
三菱H C キャピタル	570,600	610.00	348,066,000	
九州リースサービス	7,600	603.00	4,582,800	貸付有価証券 2,900株
日本取引所グループ	391,200	2,247.50	879,222,000	
イー・ギャランティ	22,700	2,050.00	46,535,000	
アサックス	8,000	682.00	5,456,000	貸付有価証券 4,500株
NEC キャピタルソ リューション	6,300	2,147.00	13,526,100	
いちご	172,000	286.00	49,192,000	
日本駐車場開発	169,400	138.00	23,377,200	
スター・マイカ・ホール	8,300	1,230.00	10,209,000	

ディングス				
SREホールディングス	3,800	3,665.00	13,927,000	
AD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	1,073.00	395,829,700	貸付有価証券 57,800株
三栄建築設計	6,200	1,628.00	10,093,600	
野村不動産ホールディングス	79,900	2,846.00	227,395,400	
三重交通グループホールディングス	31,300	476.00	14,898,800	貸付有価証券 14,700株
サムティ	24,800	2,124.00	52,675,200	貸付有価証券 9,600株
ディア・ライフ	19,900	515.00	10,248,500	貸付有価証券 600株
コーセーアールイー	4,500	588.00	2,646,000	貸付有価証券 1,500株（300株）
地主	9,800	1,795.00	17,591,000	貸付有価証券 4,400株
プレサンスコーポレーション	20,100	1,814.00	36,461,400	貸付有価証券 900株
ハウスコム	2,700	1,259.00	3,399,300	
日本管理センター	7,400	1,023.00	7,570,200	
サンセイランディック	4,500	811.00	3,649,500	貸付有価証券 700株（700株）
エストラスト	1,800	583.00	1,049,400	貸付有価証券 800株
フージャースホールディングス	19,700	690.00	13,593,000	
オープンハウスグループ	49,100	5,050.00	247,955,000	貸付有価証券 100株
東急不動産ホールディングス	455,000	672.00	305,760,000	
飯田グループホールディングス	128,800	2,188.00	281,814,400	
イーランド	2,500	1,376.00	3,440,000	
ムゲンエステート	9,500	480.00	4,560,000	貸付有価証券 600株（600株）
ビーロット	10,500	502.00	5,271,000	
ファーストブラザーズ	3,500	817.00	2,859,500	貸付有価証券 1,600株

And Doホールディングス	7,600	890.00	6,764,000	貸付有価証券 600株(600株)
シーアールイー	4,300	1,674.00	7,198,200	貸付有価証券 1,400株
プロパティエージェント	1,800	1,522.00	2,739,600	貸付有価証券 1,100株
ケイアイスター不動産	6,900	5,240.00	36,156,000	
アグレ都市デザイン	2,500	1,280.00	3,200,000	
グッドコムアセット	6,700	1,139.00	7,631,300	
ジェイ・エス・ビー	3,100	3,175.00	9,842,500	
テンポイノベーション	4,300	838.00	3,603,400	
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	1,321.00	1,981,500	
パーク24	82,900	1,799.00	149,137,100	貸付有価証券 200株
パラカ	4,000	1,691.00	6,764,000	貸付有価証券 1,700株
三井不動産	704,200	2,602.00	1,832,328,400	貸付有価証券 2,100株
三菱地所	1,014,900	1,807.50	1,834,431,750	貸付有価証券 1,100株
平和不動産	26,500	4,010.00	106,265,000	
東京建物	152,600	1,814.00	276,816,400	
ダイビル	39,200	2,196.00	86,083,200	貸付有価証券 200株
京阪神ビルディング	23,900	1,478.00	35,324,200	
住友不動産	324,100	3,644.00	1,181,020,400	貸付有価証券 900株
テーオーシー	27,800	710.00	19,738,000	貸付有価証券 400株
東京楽天地	2,500	3,930.00	9,825,000	
レオパレス21	160,200	224.00	35,884,800	
スターツコーポレーション	21,000	2,538.00	53,298,000	
フジ住宅	17,900	658.00	11,778,200	
空港施設	15,500	568.00	8,804,000	
明和地所	7,300	602.00	4,394,600	
ゴールドクレスト	12,200	1,866.00	22,765,200	貸付有価証券 400株

エスリード	6,000	1,757.00	10,542,000	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	497.00	12,474,700	貸付有価証券 10,400株
日本エスコン	28,800	756.00	21,772,800	
タカラレーベン	64,700	320.00	20,704,000	
A V A N T I A	8,000	840.00	6,720,000	貸付有価証券 300株
イオンモール	77,400	1,654.00	128,019,600	貸付有価証券 36,300株
毎日コムネット	5,300	699.00	3,704,700	
ファースト住建	5,800	1,188.00	6,890,400	
カチタス	38,200	3,295.00	125,869,000	
トーセイ	21,300	1,076.00	22,918,800	
穴吹興産	3,400	1,986.00	6,752,400	
サンフロンティア不動産	21,300	1,080.00	23,004,000	
F J 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	636.00	2,226,000	
ランドビジネス	6,500	240.00	1,560,000	
サンネクスタグループ	4,900	1,048.00	5,135,200	
グランディハウス	10,500	578.00	6,069,000	
日本空港ビルデング	58,900	5,540.00	326,306,000	
明豊ファシリティワークス	6,800	712.00	4,841,600	
日本工営	9,500	3,025.00	28,737,500	
L I F U L L	45,700	237.00	10,830,900	貸付有価証券 1,700株
ミクシィ	34,200	2,260.00	77,292,000	
ジェイエイシーリクルートメント	12,100	1,779.00	21,525,900	
日本M&Aセンターホールディングス	245,500	1,735.00	425,942,500	
メンバーズ	4,500	2,859.00	12,865,500	貸付有価証券 600株
中広	2,400	389.00	933,600	
U T グループ	21,600	3,455.00	74,628,000	貸付有価証券 1,000株（800株）
アイティメディア	7,100	1,586.00	11,260,600	

E・Jホールディングス	8,600	1,155.00	9,933,000	貸付有価証券 3,400株
夢真ビーネックスグループ	48,700	1,553.00	75,631,100	貸付有価証券 200株
コシダカホールディングス	40,000	654.00	26,160,000	貸付有価証券 9,400株
アルトナー	3,600	878.00	3,160,800	
パソナグループ	16,200	2,465.00	39,933,000	
CDS	3,700	1,615.00	5,975,500	
リンクアンドモチベーション	33,000	433.00	14,289,000	貸付有価証券 15,500株（5,500株）
エス・エム・エス	50,800	3,120.00	158,496,000	
サニーサイドアップグループ	5,200	733.00	3,811,600	貸付有価証券 300株（300株）
パーソルホールディングス	149,600	2,517.00	376,543,200	
リニカル	8,400	675.00	5,670,000	
クックパッド	47,000	261.00	12,267,000	貸付有価証券 1,200株
エスクリ	6,700	428.00	2,867,600	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	585.00	4,270,500	
学情	6,100	1,018.00	6,209,800	貸付有価証券 2,600株
スタジオアリス	6,700	2,221.00	14,880,700	貸付有価証券 4,100株
シミックホールディングス	8,300	1,525.00	12,657,500	貸付有価証券 3,900株
エプコ	3,200	697.00	2,230,400	貸付有価証券 200株
NJS	3,300	2,001.00	6,603,300	
総合警備保障	59,500	4,230.00	251,685,000	貸付有価証券 200株
カカクコム	109,800	2,594.00	284,821,200	貸付有価証券 700株
セントケア・ホールディング	9,700	811.00	7,866,700	
サイネックス	2,500	606.00	1,515,000	
ルネサンス	10,400	1,109.00	11,533,600	貸付有価証券 2,200株

ディップ	26,300	3,560.00	93,628,000	貸付有価証券 2,300株
デジタルホールディングス	10,400	1,538.00	15,995,200	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
新日本科学	18,200	1,583.00	28,810,600	
キャリアデザインセンター	3,800	1,245.00	4,731,000	
ベネフィット・ワン	54,400	2,477.00	134,748,800	貸付有価証券 4,200株
エムスリー	264,000	4,074.00	1,075,536,000	
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	681.00	1,293,900	
アウトソーシング	85,700	1,355.00	116,123,500	貸付有価証券 25,200株(25,200株)
ウェルネット	15,100	445.00	6,719,500	貸付有価証券 800株
ワールドホールディングス	6,000	2,025.00	12,150,000	貸付有価証券 100株
ディー・エヌ・エー	57,000	1,750.00	99,750,000	
博報堂DYホールディングス	208,400	1,573.00	327,813,200	
ぐるなび	24,600	427.00	10,504,200	貸付有価証券 5,200株
タカミヤ	18,100	385.00	6,968,500	
ジャパンベストレスキューシステム	10,100	992.00	10,019,200	
ファンコミュニケーションズ	37,400	391.00	14,623,400	貸付有価証券 3,700株
ライク	5,000	1,891.00	9,455,000	貸付有価証券 800株(800株)
ビジネス・ブレークスルー	5,500	438.00	2,409,000	貸付有価証券 1,500株
エスプール	42,300	958.00	40,523,400	
WDBホールディングス	6,800	2,654.00	18,047,200	
手間いらず	2,200	5,050.00	11,110,000	貸付有価証券 400株(400株)
ティア	8,700	435.00	3,784,500	
CDG	1,600	1,332.00	2,131,200	
アドウェイズ	22,300	661.00	14,740,300	貸付有価証券 100株

バリューコマース	11,700	3,320.00	38,844,000	
インフォマート	164,000	630.00	103,320,000	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	1,095.00	3,504,000	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	698.00	39,157,800	
アミューズ	8,100	2,101.00	17,018,100	
ドリームインキュベータ	4,100	2,505.00	10,270,500	貸付有価証券 1,900株（100株）
クイック	10,200	1,542.00	15,728,400	
T A C	8,100	228.00	1,846,800	
電通グループ	154,300	4,860.00	749,898,000	貸付有価証券 5,500株
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,000	1,321.00	9,247,000	
ぴあ	5,200	3,395.00	17,654,000	
イオンファンタジー	5,800	2,121.00	12,301,800	貸付有価証券 2,700株（200株）
シーティーエス	16,900	821.00	13,874,900	
ネクシィーズグループ	5,200	640.00	3,328,000	貸付有価証券 200株（200株）
H . U . グループホール ディングス	39,100	3,015.00	117,886,500	
アルプス技研	13,200	1,990.00	26,268,000	
ダイオーズ	2,900	1,006.00	2,917,400	貸付有価証券 1,300株
日本空調サービス	15,700	788.00	12,371,600	
オリエンタルランド	176,800	21,380.00	3,779,984,000	貸付有価証券 2,800株
ダスキン	34,700	2,787.00	96,708,900	
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	2,001.00	14,207,100	
秀英予備校	3,300	429.00	1,415,700	貸付有価証券 1,500株
ラウンドワン	41,800	1,370.00	57,266,000	貸付有価証券 500株

リゾートトラスト	68,600	1,978.00	135,690,800	貸付有価証券 200株
ビー・エム・エル	19,300	3,345.00	64,558,500	
りらいあコミュニケーションズ	22,100	1,062.00	23,470,200	
リソー教育	68,400	389.00	26,607,600	
早稲田アカデミー	8,300	1,008.00	8,366,400	貸付有価証券 2,900株
ユー・エス・エス	167,500	1,957.00	327,797,500	貸付有価証券 1,200株
東京個別指導学院	13,200	617.00	8,144,400	貸付有価証券 6,200株(700株)
サイバーエージェント	368,800	1,514.00	558,363,200	
楽天グループ	769,100	983.00	756,025,300	貸付有価証券 2,700株
クリーク・アンド・リパー社	7,800	1,684.00	13,135,200	
モーニングスター	26,200	575.00	15,065,000	
テー・オー・ダブリュー	28,600	298.00	8,522,800	
山田コンサルティンググループ	7,700	1,156.00	8,901,200	
セントラルスポーツ	5,600	2,445.00	13,692,000	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	2,214.00	28,339,200	貸付有価証券 300株
エン・ジャパン	24,200	2,940.00	71,148,000	
リソルホールディングス	1,600	4,375.00	7,000,000	貸付有価証券 700株
テクノプロ・ホールディングス	89,600	3,315.00	297,024,000	貸付有価証券 500株
アトラグループ	3,300	263.00	867,900	
インターワークス	4,300	370.00	1,591,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	6,900	3,755.00	25,909,500	
Keepers 技研	9,600	2,086.00	20,025,600	
ファーストロジック	2,900	809.00	2,346,100	
三機サービス	2,600	1,012.00	2,631,200	
Gunosy	8,200	796.00	6,527,200	
デザインワン・ジャパン	3,700	187.00	691,900	
イー・ガーディアン	6,100	2,582.00	15,750,200	

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	1,752.00	80,592,000	
ベクトル	21,000	1,064.00	22,344,000	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	330.00	2,442,000	貸付有価証券 100株
チャーム・ケア・コーポレーション	11,100	1,059.00	11,754,900	
キャリアリンク	5,500	1,438.00	7,909,000	貸付有価証券 1,000株
I B J	12,300	802.00	9,864,600	貸付有価証券 900株
アサンテ	6,600	1,594.00	10,520,400	貸付有価証券 2,300株
バリューHR	6,000	2,487.00	14,922,000	貸付有価証券 2,600株
M & Aキャピタルパートナーズ	12,300	5,040.00	61,992,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,800	1,346.00	7,806,800	貸付有価証券 700株(600株)
E R Iホールディングス	4,200	1,137.00	4,775,400	貸付有価証券 400株(400株)
アビスト	2,300	2,918.00	6,711,400	
シグマクス・ホールディングス	9,000	2,066.00	18,594,000	
ウィルグループ	11,000	1,239.00	13,629,000	
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	20,000	188.00	3,760,000	
メドピア	11,500	2,728.00	31,372,000	貸付有価証券 2,700株
レアジョブ	2,800	807.00	2,259,600	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	4,722.00	5,451,549,000	
エラン	20,600	950.00	19,570,000	
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	406.00	2,963,800	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
日本郵政	1,954,200	976.50	1,908,276,300	
ベルシステム24ホール	21,500	1,376.00	29,584,000	貸付有価証券

ディングス				200株
鎌倉新書	17,000	503.00	8,551,000	貸付有価証券 6,700株(2,600株)
S M N	3,300	591.00	1,950,300	
一蔵	1,900	379.00	720,100	
グローバルキッズC O M P A N Y	2,700	795.00	2,146,500	
エアトリ	9,700	3,490.00	33,853,000	貸付有価証券 3,500株(300株)
アトラエ	10,400	2,001.00	20,810,400	
ストライク	5,600	4,435.00	24,836,000	
ソラスト	36,800	994.00	36,579,200	
セラク	4,700	1,174.00	5,517,800	
インソース	14,500	1,908.00	27,666,000	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	41,500.00	439,900,000	
O r c h e s t r a H o l d i n g s	2,900	2,703.00	7,838,700	貸付有価証券 200株(200株)
アイモバイル	4,200	1,214.00	5,098,800	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
キャリアインデックス	5,100	686.00	3,498,600	
M S - J a p a n	6,100	843.00	5,142,300	
船場	3,000	736.00	2,208,000	
ジャパンエレベーター サービスホールディン	47,500	1,514.00	71,915,000	
フルテック	2,100	1,310.00	2,751,000	
グリーンズ	5,600	522.00	2,923,200	
ツナググループ・ホール ディングス	3,300	271.00	894,300	
G a m e W i t h	4,500	445.00	2,002,500	
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)
M S & C o n s u l t i n g	2,200	698.00	1,535,600	
ウェルビー	9,800	1,178.00	11,544,400	
エル・ティー・エス	1,900	2,008.00	3,815,200	貸付有価証券 800株(800株)
ミダックホールディング ス	6,800	2,368.00	16,102,400	貸付有価証券 2,800株

日総工産	11,700	850.00	9,945,000	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	1,737.00	11,985,300	
R P Aホールディングス	21,100	338.00	7,131,800	貸付有価証券 7,900株(7,900株)
スプリックス	4,300	1,482.00	6,372,600	
マネジメントソリューションズ	7,300	3,130.00	22,849,000	
プロレド・パートナーズ	3,300	800.00	2,640,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
and factory	3,400	395.00	1,343,000	貸付有価証券 500株(100株)
テノ・ホールディングス	1,800	600.00	1,080,000	
フロンティア・マネジメント	3,900	798.00	3,112,200	
ピアラ	2,400	525.00	1,260,000	貸付有価証券 200株(200株)
コプロ・ホールディングス	2,900	1,065.00	3,088,500	
ギークス	2,600	1,109.00	2,883,400	貸付有価証券 100株(100株)
カーブスホールディングス	41,100	709.00	29,139,900	
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	1,832.00	3,664,000	
ダイレクトマーケティングミックス	17,300	1,460.00	25,258,000	貸付有価証券 200株(200株)
ポピンズホールディングス	3,500	2,298.00	8,043,000	
LITALICO	12,100	2,961.00	35,828,100	
アドバンテッジリスクマネジメント	7,600	655.00	4,978,000	
リログループ	81,800	1,713.00	140,123,400	貸付有価証券 600株
東祥	11,200	1,738.00	19,465,600	貸付有価証券 4,200株
TREホールディングス	20,500	1,551.00	31,795,500	
人・夢・技術グループ	6,000	1,888.00	11,328,000	
エイチ・アイ・エス	33,200	2,072.00	68,790,400	貸付有価証券

				10,900株
ラックランド	4,300	2,834.00	12,186,200	貸付有価証券 1,000株
共立メンテナンス	26,700	4,480.00	119,616,000	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	1,309.00	20,027,700	
建設技術研究所	8,900	2,328.00	20,719,200	
スペース	10,700	954.00	10,207,800	
燦ホールディングス	6,500	1,529.00	9,938,500	
スバル興業	900	8,090.00	7,281,000	貸付有価証券 400株
東京テアトル	5,800	1,254.00	7,273,200	貸付有価証券 2,700株
タナベ経営	5,700	644.00	3,670,800	
ナガワ	4,800	9,690.00	46,512,000	貸付有価証券 2,200株
東京都競馬	11,200	4,085.00	45,752,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
常磐興産	6,000	1,373.00	8,238,000	貸付有価証券 2,600株
カナモト	26,400	2,308.00	60,931,200	貸付有価証券 11,700株
西尾レントオール	13,800	2,858.00	39,440,400	
トランス・コスモス	19,000	3,205.00	60,895,000	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	2,381.00	15,476,500	貸付有価証券 3,000株
KNT-CTホールディングス	9,300	1,559.00	14,498,700	貸付有価証券 4,500株
日本管財	16,000	2,799.00	44,784,000	
トーカイ	13,100	1,862.00	24,392,200	
白洋舎	1,700	1,180.00	2,006,000	貸付有価証券 700株
セコム	147,500	8,678.00	1,280,005,000	
セントラル警備保障	7,200	2,377.00	17,114,400	貸付有価証券 300株(300株)
丹青社	30,600	736.00	22,521,600	
メイテック	18,100	6,940.00	125,614,000	

応用地質	16,900	2,078.00	35,118,200	
船井総研ホールディングス	30,600	2,217.00	67,840,200	
進学会ホールディングス	4,900	367.00	1,798,300	貸付有価証券 1,400株（200株）
オオバ	10,500	713.00	7,486,500	貸付有価証券 4,600株
いであ	4,000	1,757.00	7,028,000	貸付有価証券 200株（100株）
学究社	4,800	1,652.00	7,929,600	
ベネッセホールディングス	49,900	2,336.00	116,566,400	
イオンディライト	18,400	2,987.00	54,960,800	貸付有価証券 2,800株
ナック	7,100	979.00	6,950,900	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	1,851.00	10,180,500	
小計 銘柄数：2,161			411,855,217,650	
組入時価比率：98.7%			100.0%	
合計			411,855,217,650	

(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18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18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	5,465,896,908	-	5,570,900,000	104,859,542
合計	5,465,896,908	-	5,570,900,000	104,859,542

（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NOMURA - B P I 総合 マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2022年 2月18日現在）

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,870,651,566
国債証券	661,156,619,350
地方債証券	57,802,717,135
特殊債券	64,811,300,561
社債券	40,110,710,500
未収利息	1,697,185,055
前払費用	41,505,988
流動資産合計	830,490,690,155
資産合計	830,490,690,155
負債の部	
流動負債	
未払金	499,673,000
未払解約金	372,283,555
未払利息	3,089
流動負債合計	871,959,644
負債合計	871,959,644
純資産の部	
元本等	
元本	634,585,492,278
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	195,033,238,233
元本等合計	829,618,730,511
純資産合計	829,618,730,511
負債純資産合計	830,490,690,155

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券、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18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	1.3073円
(10,000口当たり純資産額)	(13,073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19日 至 2022年 2月18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18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、地方債証券、特殊債券、社債券</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>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18日現在		2021年 2月19日
期首		2021年 2月19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		548,901,914,574円
同期中における追加設定元本額		144,466,276,171円
同期中における一部解約元本額		58,782,698,467円
期末元本額		634,585,492,278円
期末元本額の内訳*		
野村国内債券インデックスファンド		399,133,710円
野村世界6資産分散投信（安定コース）		41,705,701,900円
野村世界6資産分散投信（分配コース）		17,905,703,252円
野村世界6資産分散投信（成長コース）		3,505,512,360円
野村資産設計ファンド2015		345,018,410円
野村資産設計ファンド2020		345,718,809円
野村資産設計ファンド2025		356,250,848円
野村資産設計ファンド2030		297,192,146円
野村資産設計ファンド2035		159,165,469円
野村資産設計ファンド2040		210,323,808円
野村日本債券インデックスファンド		790,449,453円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）		159,733,827,499円
のむらっぴ・ファンド（保守型）		15,573,954,338円
のむらっぴ・ファンド（普通型）		18,977,066,981円
のむらっぴ・ファンド（積極型）		2,548,685,504円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）		10,240,999,862円
野村資産設計ファンド2045		25,560,040円
野村円債投資インデックスファンド		724,730,216円
野村インデックスファンド・国内債券		2,009,726,675円
マイ・ロード		34,794,951,702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		1,473,342,356円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）		21,616,189,857円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）		1,990,830,699円
野村資産設計ファンド2050		24,591,110円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		30,490,236円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		8,501,142円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		4,378,274円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		2,827,169円
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）		1,357,681,601円
のむらっぴ・ファンド（やや積極型）		526,142,281円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		67,368,378円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		29,989,704円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		129,801,824円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		19,087,042円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		18,215,281円
野村6資産均等バランス		4,083,757,058円
世界6資産分散ファンド		124,286,699円

野村資産設計ファンド2060	12,196,467円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合連動型上場投信	33,975,462,670円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	32,488,613,701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)	533,137,432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)	86,605,120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)	1,687,304,946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)	790,907,495円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	18,728,770円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	10,220,926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)	632,297円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,530,160,922円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	7,103,041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)	56,490,690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)	40,864,831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)	373,384,500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)	289,075,127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)	922,620,402円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	142,905,601円
ノムラ日本債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,655,295,401円
ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券(適格機関投資家専用)	334,188,487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)	16,111,922円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	38,396,757,137円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	51,950,470,130円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	20,066,648,011円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合(確定拠出年金向け)	51,599,235,248円
マイバランスDC30	14,220,875,341円
マイバランスDC50	11,839,193,326円
マイバランスDC70	4,191,821,652円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合	13,322,454,554円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	1,341,903,466円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	3,584,193,277円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,630,807,649円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	221,402,761円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	33,619,516円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	38,968,704円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	81,586,145円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	31,730,308円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	12,060,060円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	1,121,642,892円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	571,037,799円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	210,331,841円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	276,916,324円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	5,917,534円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	64,684,637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)	552,360,856円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	89,708,669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18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18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422回	1,400,000,000	1,402,352,000	
		国庫債券 利付(2年)第423回	5,200,000,000	5,203,692,000	
		国庫債券 利付(2年)第424回	2,600,000,000	2,602,002,000	
		国庫債券 利付(2年)第426回	1,500,000,000	1,501,110,000	
		国庫債券 利付(2年)第427回	6,800,000,000	6,804,896,000	
		国庫債券 利付(2年)第428回	2,400,000,000	2,401,632,000	
		国庫債券 利付(2年)第429回	1,500,000,000	1,501,080,000	
		国庫債券 利付(2年)第431回	3,000,000,000	3,001,860,000	
		国庫債券 利付(5年)第135回	8,500,000,000	8,514,535,000	
		国庫債券 利付(5年)第136回	4,300,000,000	4,308,815,000	
		国庫債券 利付(5年)第137回	6,600,000,000	6,615,048,000	
		国庫債券 利付(5年)第138回	7,100,000,000	7,116,827,000	
		国庫債券 利付(5年)第139回	6,700,000,000	6,716,616,000	
		国庫債券 利付(5年)第140回	5,100,000,000	5,113,005,000	
		国庫債券 利付(5年)第141回	9,600,000,000	9,624,672,000	
		国庫債券 利付(5年)第142回	1,200,000,000	1,203,216,000	
		国庫債券 利付(5年)第143回	6,070,000,000	6,086,753,200	
		国庫債券 利付(5年)第144回	4,400,000,000	4,412,408,000	
		国庫債券 利付(5年)第145回	3,900,000,000	3,911,154,000	
		国庫債券 利付(5年)第146回	2,100,000,000	2,106,006,000	
		国庫債券 利付(5年)第147回	5,600,000,000	5,594,288,000	
		国庫債券 利付(5年)第148回	7,300,000,000	7,290,510,000	
		国庫債券 利付(5年)第149回	7,100,000,000	7,087,007,000	
		国庫債券 利付(40年)第1回	2,860,000,000	3,893,403,800	
		国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,184,346,000	
		国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,188,855,000	
		国庫債券 利付(40年)第4回	1,630,000,000	2,165,715,800	
国庫債券 利付(40年)第5回	1,200,000,000	1,541,604,000			
国庫債券 利付(40年)第6回	1,300,000,000	1,643,603,000			

国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,702,050,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	1,500,000,000	1,704,180,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	2,550,000,000	2,161,150,500	
国庫債券 利付(40年)第10回	2,010,000,000	1,996,673,700	
国庫債券 利付(40年)第11回	1,750,000,000	1,683,990,000	
国庫債券 利付(40年)第12回	2,070,000,000	1,792,475,100	
国庫債券 利付(40年)第13回	7,020,000,000	6,052,082,400	
国庫債券 利付(40年)第14回	4,460,000,000	4,112,922,800	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,250,000,000	5,287,222,500	
国庫債券 利付(10年)第329回	6,000,000,000	6,068,040,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	3,850,388,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,919,190,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	5,900,000,000	5,967,378,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	3,600,000,000	3,645,900,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	6,600,000,000	6,693,654,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	4,600,000,000	4,659,294,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	2,750,000,000	2,788,472,500	
国庫債券 利付(10年)第337回	3,000,000,000	3,024,990,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	5,000,000,000	5,059,900,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	5,000,000,000	5,063,950,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	2,700,000,000	2,736,666,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	7,300,000,000	7,376,723,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	6,550,000,000	6,568,602,000	
国庫債券 利付(10年)第343回	9,500,000,000	9,526,600,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	6,400,000,000	6,416,064,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	7,000,000,000	7,018,480,000	
国庫債券 利付(10年)第346回	5,100,000,000	5,111,577,000	
国庫債券 利付(10年)第347回	5,400,000,000	5,411,448,000	
国庫債券 利付(10年)第348回	5,800,000,000	5,812,876,000	
	2,800,000,000	2,805,684,000	

国庫債券 利付(10年)第349回			
国庫債券 利付(10年)第350回	7,150,000,000	7,162,941,500	
国庫債券 利付(10年)第351回	6,000,000,000	6,009,420,000	
国庫債券 利付(10年)第352回	6,400,000,000	6,408,320,000	
国庫債券 利付(10年)第353回	1,200,000,000	1,201,212,000	
国庫債券 利付(10年)第354回	1,850,000,000	1,851,295,000	
国庫債券 利付(10年)第355回	2,600,000,000	2,599,038,000	
国庫債券 利付(10年)第356回	4,800,000,000	4,796,352,000	
国庫債券 利付(10年)第357回	1,900,000,000	1,897,036,000	
国庫債券 利付(10年)第358回	5,470,000,000	5,456,872,000	
国庫債券 利付(10年)第359回	10,600,000,000	10,565,020,000	
国庫債券 利付(10年)第360回	10,900,000,000	10,853,784,000	
国庫債券 利付(10年)第361回	7,400,000,000	7,358,116,000	
国庫債券 利付(10年)第362回	9,800,000,000	9,729,930,000	
国庫債券 利付(10年)第363回	10,450,000,000	10,363,787,500	
国庫債券 利付(10年)第364回	8,650,000,000	8,564,624,500	
国庫債券 利付(10年)第365回	500,000,000	494,465,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	500,000,000	601,080,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	500,000,000	590,535,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	188,385,600	
国庫債券 利付(30年)第4回	1,400,000,000	1,733,074,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	177,703,500	
国庫債券 利付(30年)第6回	600,000,000	726,870,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	724,992,000	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	116,166,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	265,000,000	296,656,900	
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	272,017,500	
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	184,840,000	
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	264,457,600	
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	346,112,100	
国庫債券 利付(30年)第14回	800,000,000	994,592,000	
国庫債券 利付(30年)第15回	900,000,000	1,132,659,000	

国庫債券	利付(30年)第16回	915,000,000	1,154,784,900
国庫債券	利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,502,916,000
国庫債券	利付(30年)第18回	2,200,000,000	2,734,622,000
国庫債券	利付(30年)第19回	2,050,000,000	2,554,074,500
国庫債券	利付(30年)第20回	1,270,000,000	1,618,678,500
国庫債券	利付(30年)第21回	300,000,000	375,174,000
国庫債券	利付(30年)第22回	600,000,000	767,880,000
国庫債券	利付(30年)第23回	840,000,000	1,077,552,000
国庫債券	利付(30年)第24回	700,000,000	899,388,000
国庫債券	利付(30年)第25回	500,000,000	629,445,000
国庫債券	利付(30年)第26回	850,000,000	1,083,979,500
国庫債券	利付(30年)第27回	1,550,000,000	2,006,723,000
国庫債券	利付(30年)第28回	1,200,000,000	1,558,236,000
国庫債券	利付(30年)第29回	1,500,000,000	1,931,865,000
国庫債券	利付(30年)第30回	1,700,000,000	2,169,421,000
国庫債券	利付(30年)第31回	1,200,000,000	1,517,352,000
国庫債券	利付(30年)第32回	1,200,000,000	1,541,424,000
国庫債券	利付(30年)第33回	2,400,000,000	2,966,568,000
国庫債券	利付(30年)第34回	3,300,000,000	4,203,672,000
国庫債券	利付(30年)第35回	2,300,000,000	2,854,139,000
国庫債券	利付(30年)第36回	2,000,000,000	2,488,260,000
国庫債券	利付(30年)第37回	2,300,000,000	2,824,377,000
国庫債券	利付(30年)第38回	1,600,000,000	1,935,648,000
国庫債券	利付(30年)第39回	1,400,000,000	1,722,924,000
国庫債券	利付(30年)第40回	1,300,000,000	1,575,457,000
国庫債券	利付(30年)第41回	1,500,000,000	1,789,095,000
国庫債券	利付(30年)第42回	1,600,000,000	1,909,552,000
国庫債券	利付(30年)第43回	1,300,000,000	1,552,499,000
国庫債券	利付(30年)第44回	1,400,000,000	1,672,944,000
国庫債券	利付(30年)第45回	1,700,000,000	1,959,964,000
国庫債券	利付(30年)第46回	1,800,000,000	2,075,742,000
国庫債券	利付(30年)第47回	1,700,000,000	1,996,769,000
国庫債券	利付(30年)第48回	1,900,000,000	2,149,584,000
国庫債券	利付(30年)第49回	2,900,000,000	3,281,031,000
国庫債券	利付(30年)第50回	1,900,000,000	1,900,000,000
国庫債券	利付(30年)第51回	2,650,000,000	2,353,809,500
国庫債券	利付(30年)第52回	1,900,000,000	1,768,387,000
国庫債券	利付(30年)第53回	1,700,000,000	1,617,839,000
国庫債券	利付(30年)第54回	1,700,000,000	1,691,160,000
国庫債券	利付(30年)第55回	1,500,000,000	1,490,580,000
国庫債券	利付(30年)第56回	1,900,000,000	1,883,983,000
国庫債券	利付(30年)第57回	1,600,000,000	1,583,056,000
国庫債券	利付(30年)第58回	2,100,000,000	2,073,162,000

国庫債券	利付(30年)第59回	1,600,000,000	1,540,080,000
国庫債券	利付(30年)第60回	1,150,000,000	1,158,694,000
国庫債券	利付(30年)第61回	1,500,000,000	1,436,715,000
国庫債券	利付(30年)第62回	1,500,000,000	1,360,485,000
国庫債券	利付(30年)第63回	1,400,000,000	1,231,608,000
国庫債券	利付(30年)第64回	1,500,000,000	1,316,835,000
国庫債券	利付(30年)第65回	1,200,000,000	1,051,260,000
国庫債券	利付(30年)第66回	2,600,000,000	2,275,494,000
国庫債券	利付(30年)第67回	1,300,000,000	1,199,783,000
国庫債券	利付(30年)第68回	1,950,000,000	1,798,621,500
国庫債券	利付(30年)第69回	2,200,000,000	2,082,586,000
国庫債券	利付(30年)第70回	1,610,000,000	1,523,494,700
国庫債券	利付(30年)第71回	2,400,000,000	2,270,184,000
国庫債券	利付(30年)第72回	1,300,000,000	1,229,202,000
国庫債券	利付(20年)第61回	300,000,000	303,417,000
国庫債券	利付(20年)第62回	440,000,000	444,958,800
国庫債券	利付(20年)第63回	300,000,000	307,362,000
国庫債券	利付(20年)第64回	400,000,000	412,252,000
国庫債券	利付(20年)第65回	455,000,000	471,011,450
国庫債券	利付(20年)第66回	300,000,000	310,008,000
国庫債券	利付(20年)第67回	310,000,000	322,313,200
国庫債券	利付(20年)第68回	290,000,000	303,325,500
国庫債券	利付(20年)第69回	560,000,000	584,567,200
国庫債券	利付(20年)第70回	540,000,000	570,207,600
国庫債券	利付(20年)第71回	200,000,000	210,258,000
国庫債券	利付(20年)第72回	1,470,000,000	1,549,571,100
国庫債券	利付(20年)第73回	1,200,000,000	1,267,488,000
国庫債券	利付(20年)第74回	800,000,000	847,256,000
国庫債券	利付(20年)第75回	600,000,000	638,436,000
国庫債券	利付(20年)第76回	910,000,000	962,698,100
国庫債券	利付(20年)第77回	700,000,000	742,693,000
国庫債券	利付(20年)第78回	800,000,000	849,848,000
国庫債券	利付(20年)第79回	860,000,000	916,441,800
国庫債券	利付(20年)第80回	1,400,000,000	1,496,530,000
国庫債券	利付(20年)第81回	360,000,000	385,416,000
国庫債券	利付(20年)第82回	820,000,000	880,819,400
国庫債券	利付(20年)第83回	1,370,000,000	1,478,408,100
国庫債券	利付(20年)第84回	1,200,000,000	1,290,372,000
国庫債券	利付(20年)第85回	400,000,000	433,688,000
国庫債券	利付(20年)第86回	1,700,000,000	1,857,012,000
国庫債券	利付(20年)第87回	500,000,000	544,145,000
国庫債券	利付(20年)第88回	1,100,000,000	1,207,613,000

国庫債券 利付(20年)第89回	470,000,000	513,949,700
国庫債券 利付(20年)第90回	1,500,000,000	1,647,675,000
国庫債券 利付(20年)第91回	250,000,000	275,755,000
国庫債券 利付(20年)第92回	650,000,000	714,168,000
国庫債券 利付(20年)第93回	300,000,000	329,523,000
国庫債券 利付(20年)第94回	200,000,000	220,694,000
国庫債券 利付(20年)第95回	100,000,000	111,892,000
国庫債券 利付(20年)第96回	400,000,000	443,320,000
国庫債券 利付(20年)第97回	300,000,000	335,691,000
国庫債券 利付(20年)第98回	300,000,000	334,023,000
国庫債券 利付(20年)第99回	1,100,000,000	1,229,954,000
国庫債券 利付(20年)第100回	820,000,000	925,911,200
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	285,315,000
国庫債券 利付(20年)第102回	1,500,000,000	1,720,110,000
国庫債券 利付(20年)第103回	600,000,000	684,264,000
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	451,140,000
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,151,845,000
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	455,636,000
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	341,148,000
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,797,728,000
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,014,858,000
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,255,848,000
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	922,176,000
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,061,810,000
国庫債券 利付(20年)第113回	2,000,000,000	2,299,960,000
国庫債券 利付(20年)第114回	1,700,000,000	1,962,531,000
国庫債券 利付(20年)第115回	1,000,000,000	1,162,190,000
国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,282,952,000
国庫債券 利付(20年)第117回	1,400,000,000	1,621,662,000
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	577,010,000
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	910,040,000

国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	896,864,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	1,200,000,000	1,379,016,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	900,000,000	1,026,630,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	500,000,000	584,940,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,161,170,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	1,400,000,000	1,654,702,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	1,200,000,000	1,396,860,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	500,000,000	577,555,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	800,000,000	926,632,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	1,300,000,000	1,493,843,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	1,700,000,000	1,957,465,000	
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	913,632,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,487,928,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	2,400,000,000	2,770,080,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	1,400,000,000	1,618,792,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	700,000,000	802,494,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	795,592,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,148,270,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	902,472,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	1,000,000,000	1,138,180,000	
国庫債券 利付(20年)第140回	2,300,000,000	2,645,046,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	2,600,000,000	2,994,264,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	950,000,000	1,104,061,500	
国庫債券 利付(20年)第143回	1,300,000,000	1,485,107,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,300,000,000	1,471,132,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,300,000,000	2,657,075,000	
	2,400,000,000	2,775,960,000	

国庫債券 利付(20年)第146回			
国庫債券 利付(20年)第147回	4,000,000,000	4,588,680,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	2,100,000,000	2,386,671,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	3,850,000,000	4,380,915,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	3,330,000,000	3,751,245,000	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,500,000,000	2,755,775,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	2,650,000,000	2,922,446,500	
国庫債券 利付(20年)第153回	1,600,000,000	1,785,568,000	
国庫債券 利付(20年)第154回	2,120,000,000	2,338,402,400	
国庫債券 利付(20年)第155回	5,350,000,000	5,755,476,500	
国庫債券 利付(20年)第156回	4,650,000,000	4,619,217,000	
国庫債券 利付(20年)第157回	5,540,000,000	5,339,175,000	
国庫債券 利付(20年)第158回	3,470,000,000	3,481,798,000	
国庫債券 利付(20年)第159回	4,810,000,000	4,886,479,000	
国庫債券 利付(20年)第160回	2,300,000,000	2,366,125,000	
国庫債券 利付(20年)第161回	2,100,000,000	2,126,859,000	
国庫債券 利付(20年)第162回	1,700,000,000	1,718,360,000	
国庫債券 利付(20年)第163回	2,600,000,000	2,624,648,000	
国庫債券 利付(20年)第164回	2,600,000,000	2,578,888,000	
国庫債券 利付(20年)第165回	2,200,000,000	2,178,616,000	
国庫債券 利付(20年)第166回	2,300,000,000	2,345,287,000	
国庫債券 利付(20年)第167回	2,600,000,000	2,564,172,000	
国庫債券 利付(20年)第168回	2,700,000,000	2,614,329,000	
国庫債券 利付(20年)第169回	3,030,000,000	2,878,287,900	
国庫債券 利付(20年)第170回	2,800,000,000	2,653,756,000	
国庫債券 利付(20年)第171回	2,500,000,000	2,363,975,000	
	3,840,000,000	3,687,705,600	

		国庫債券 利付(20年)第172回			
		国庫債券 利付(20年)第173回	3,250,000,000	3,114,377,500	
		国庫債券 利付(20年)第174回	3,970,000,000	3,796,034,600	
		国庫債券 利付(20年)第175回	5,500,000,000	5,343,635,000	
		国庫債券 利付(20年)第176回	6,020,000,000	5,836,992,000	
		国庫債券 利付(20年)第177回	5,070,000,000	4,815,131,100	
		国庫債券 利付(20年)第178回	3,750,000,000	3,623,962,500	
		メキシコ合衆国 第19回円貨社債(2014)	100,000,000	101,939,000	
		メキシコ合衆国 第25回円貨社債(2018)	100,000,000	100,284,000	
	小計	銘柄数:267 組入時価比率:79.7%	636,645,000,000	661,156,619,350 80.2%	
	合計			661,156,619,350	
地方債証券	日本円	東京都 公募第731回	100,000,000	101,246,000	
		東京都 公募第736回	100,000,000	101,149,000	
		東京都 公募第745回	300,000,000	304,668,000	
		東京都 公募第760回	100,000,000	99,726,000	
		東京都 公募第761回	100,000,000	99,863,000	
		東京都 公募第769回	500,000,000	501,850,000	
		東京都 公募第778回	100,000,000	100,000,000	
		東京都 公募第784回	200,000,000	201,094,000	
		東京都 公募第813回	200,000,000	198,602,000	
		東京都 公募(30年)第7回	100,000,000	129,234,000	
		東京都 公募第10回	200,000,000	254,042,000	
		東京都 公募第1回	300,000,000	306,102,000	
		東京都 公募(20年)第3回	200,000,000	209,246,000	
		東京都 公募第7回	100,000,000	107,451,000	
		東京都 公募(20年)第13回	100,000,000	111,535,000	
		東京都 公募(20年)第16回	200,000,000	224,706,000	
		東京都 公募(20年)第17回	200,000,000	225,786,000	
		東京都 公募(20年)第20回	180,000,000	205,414,200	
		東京都 公募第23回	100,000,000	116,160,000	
		東京都 公募(20年)第26回	100,000,000	114,427,000	
		東京都 公募(20年)第29回	200,000,000	226,678,000	
		東京都 公募(5年)第31回	300,000,000	299,718,000	
		東京都 公募(5年)第32回	300,000,000	299,499,000	
		北海道 公募平成25年度第1回	300,000,000	302,004,000	
		北海道 公募平成26年度第13回	100,000,000	101,141,000	

北海道	公募平成27年度第7回	100,000,000	101,599,000
北海道	公募平成29年度第5回	200,000,000	200,378,000
北海道	公募平成29年度第7回	100,000,000	100,268,000
北海道	公募平成29年度第9回	100,000,000	100,253,000
北海道	公募平成30年度第15回	261,600,000	261,817,128
北海道	公募平成30年度第18回	200,000,000	199,320,000
北海道	公募令和2年度第4回	300,000,000	298,038,000
宮城県	公募第31回1号	300,000,000	304,698,000
宮城県	公募第32回2号	100,000,000	100,002,000
神奈川県	公募第196回	100,000,000	100,717,000
神奈川県	公募第200回	100,000,000	101,276,000
神奈川県	公募第205回	100,000,000	101,306,000
神奈川県	公募第206回	100,000,000	101,419,000
神奈川県	公募第210回	200,000,000	202,184,000
神奈川県	公募第212回	100,000,000	101,106,000
神奈川県	公募第231回	200,000,000	200,694,000
神奈川県	公募第243回	200,000,000	197,828,000
神奈川県	公募第247回	200,000,000	198,122,000
神奈川県	公募(30年)第3回	100,000,000	129,426,000
神奈川県	公募第7回	300,000,000	331,803,000
神奈川県	公募(20年)第14回	100,000,000	114,348,000
神奈川県	公募(20年)第17回	200,000,000	231,516,000
神奈川県	公募(20年)第26回	100,000,000	112,599,000
大阪府	公募第378回	104,000,000	105,245,920
大阪府	公募第381回	100,000,000	101,308,000
大阪府	公募第382回	100,000,000	101,332,000
大阪府	公募第383回	100,000,000	101,428,000
大阪府	公募第384回	100,000,000	101,431,000
大阪府	公募第387回	300,000,000	303,522,000
大阪府	公募第389回	100,000,000	101,264,000
大阪府	公募第396回	200,000,000	203,192,000
大阪府	公募第417回	102,000,000	102,574,260
大阪府	公募第423回	100,000,000	100,130,000
大阪府	公募第429回	179,000,000	179,234,490
大阪府	公募第452回	100,000,000	98,647,000
大阪府	公募第467回	140,000,000	138,546,800
大阪府	公募第469回	150,000,000	147,850,500
大阪府	公募第5回	100,000,000	115,660,000
大阪府	公募第8回	100,000,000	114,787,000
大阪府	公募(5年)第173回	200,000,000	199,510,000
大阪府	公募(5年)第174回	200,000,000	199,488,000
大阪府	公募(5年)第178回	400,000,000	398,708,000

大阪府 公募(5年)第184回	400,000,000	398,364,000
大阪府 公募(5年)第190回	200,000,000	198,996,000
京都府 公募平成25年度第15回	200,000,000	202,596,000
京都府 公募平成26年度第5回	100,000,000	112,341,000
京都府 公募平成26年度第7回	200,000,000	202,626,000
京都府 公募(20年)平成27年度第5回	200,000,000	219,574,000
京都府 公募(15年)平成27年度第8回	100,000,000	104,483,000
京都府 公募(15年)平成28年度第2回	200,000,000	199,016,000
京都府 公募(20年)平成28年度第5回	100,000,000	97,081,000
京都府 公募平成29年度第4回	100,000,000	100,265,000
兵庫県 公募平成26年度第17回	100,000,000	101,191,000
兵庫県 公募平成29年度第22回	100,000,000	100,176,000
兵庫県 公募(30年)第2回	200,000,000	256,824,000
兵庫県 公募(15年)第1回	300,000,000	320,763,000
兵庫県 公募(15年)第3回	200,000,000	212,882,000
兵庫県 公募(12年)第3回	300,000,000	304,677,000
兵庫県 公募(15年)第8回	100,000,000	106,339,000
兵庫県 公募(15年)第11回	100,000,000	103,978,000
兵庫県 公募第2回	100,000,000	112,245,000
兵庫県 公募第9回	100,000,000	115,591,000
兵庫県 公募(20年)第11回	200,000,000	226,712,000
兵庫県 公募(20年)第14回	100,000,000	114,136,000
兵庫県 公募(20年)第22回	100,000,000	111,693,000
静岡県 公募平成24年度第10回	100,000,000	100,721,000
静岡県 公募平成25年度第5回	101,000,000	102,315,020
静岡県 公募平成26年度第3回	165,000,000	167,389,200
静岡県 公募平成26年度第8回	100,000,000	101,308,000
静岡県 公募平成26年度第9回	200,000,000	202,642,000
静岡県 公募平成27年度第11回	115,400,000	115,493,474
静岡県 公募平成28年度第2回	300,000,000	299,877,000
静岡県 公募平成29年度第3回	100,000,000	100,227,000
静岡県 公募(31年)第1回	174,000,000	172,905,540
静岡県 公募(5年)令和3年度第2回	100,000,000	99,674,000
静岡県 公募(5年)令和3年度第5回	300,000,000	298,833,000
静岡県 公募(15年)第2回	200,000,000	213,498,000
静岡県 公募(15年)第5回	200,000,000	212,100,000
静岡県 公募(15年)第9回	100,000,000	104,109,000
静岡県 公募(20年)第11回	100,000,000	113,582,000
静岡県 公募(20年)第14回	200,000,000	228,660,000

静岡県	公募(20年)第18回	100,000,000	112,539,000
静岡県	公募(20年)第30回	200,000,000	191,746,000
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	112,556,000
愛知県	公募(20年)平成22年度第8回	200,000,000	227,804,000
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	113,871,000
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	426,716,000
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	115,747,000
愛知県	公募(30年)平成25年度第8回	120,000,000	148,926,000
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	120,227,000
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	111,274,000
愛知県	公募平成26年度第17回	300,000,000	303,600,000
愛知県	公募(15年)平成27年度第2回	300,000,000	312,537,000
愛知県	公募平成27年度第15回	100,000,000	101,470,000
愛知県	公募平成29年度第8回	100,000,000	100,213,000
愛知県	公募平成29年度第9回	100,000,000	99,943,000
愛知県	公募平成30年度第7回	200,000,000	200,128,000
愛知県	公募令和3年度第10回	200,000,000	199,048,000
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	202,494,000
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	110,501,980
広島県	公募平成26年度第7回	200,000,000	202,440,000
広島県	公募平成29年度第3回	100,000,000	99,944,000
広島県	公募平成29年度第4回	211,300,000	212,022,646
広島県	公募平成30年度第6回	300,000,000	299,898,000
広島県	公募令和2年度第2回	100,000,000	99,422,000
広島県	公募令和2年度第7回	300,000,000	298,779,000
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	101,293,000
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	149,866,280
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	101,280,000
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	101,289,000
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	101,415,000
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	202,566,000
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	404,672,000
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	101,096,000
埼玉県	公募平成27年度第9回	100,000,000	100,600,000
埼玉県	公募平成28年度第5回	100,000,000	99,801,000
埼玉県	公募平成30年度第4回	200,000,000	200,440,000
埼玉県	公募平成30年度第7回	200,000,000	200,000,000
埼玉県	公募令和2年度第4回	300,000,000	297,798,000
埼玉県	公募(15年)第1回	100,000,000	105,511,000
埼玉県	公募(15年)第2回	200,000,000	210,434,000

埼玉県 公募（15年）第3回	100,000,000	101,405,000	
埼玉県 公募（25年）第2回	200,000,000	200,354,000	
埼玉県 公募（30年）第9回	200,000,000	196,238,000	
埼玉県 公募（20年）第6回	100,000,000	113,614,000	
埼玉県 公募（20年）第16回	100,000,000	109,603,000	
埼玉県 公募（20年）第20回	100,000,000	100,786,000	
福岡県 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,429,000	
福岡県 公募平成27年度第1回	300,000,000	305,088,000	
福岡県 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,319,000	
福岡県 公募平成23年度第1回	100,000,000	106,600,000	
福岡県 公募（15年）平成27年度第1回	200,000,000	208,980,000	
福岡県 公募（15年）令和元年度第1回	100,000,000	97,901,000	
福岡県 公募（30年）平成19年度第1回	100,000,000	129,957,000	
福岡県 公募（30年）平成26年度第1回	100,000,000	120,475,000	
福岡県 公募（30年・定時償還）平成29年度第2回	100,000,000	100,473,000	
福岡県 公募（20年）平成20年度第1回	300,000,000	340,272,000	
福岡県 公募（20年）平成20年度第2回	100,000,000	112,623,000	
福岡県 公募（20年）平成22年度第1回	300,000,000	338,355,000	
福岡県 公募（20年）平成22年度第2回	300,000,000	349,299,000	
福岡県 公募（20年）平成24年度第2回	100,000,000	113,403,000	
千葉県 公募平成25年度第3回	100,000,000	101,174,000	
千葉県 公募平成25年度第4回	100,000,000	101,294,000	
千葉県 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,392,000	
千葉県 公募平成26年度第3回	200,000,000	202,722,000	
千葉県 公募平成27年度第6回	200,000,000	202,946,000	
千葉県 公募平成28年度第4回	200,000,000	199,818,000	
千葉県 公募平成29年度第4回	100,000,000	99,944,000	
千葉県 公募平成29年度第8回	100,000,000	100,211,000	
千葉県 公募令和元年度第6回	300,000,000	298,116,000	
千葉県 公募（20年）第1回	400,000,000	430,264,000	
千葉県 公募（20年）第8回	100,000,000	115,714,000	
千葉県 公募（20年）第13回	200,000,000	228,334,000	
千葉県 公募（20年）第16回	200,000,000	226,910,000	
千葉県 公募（20年）第17回	100,000,000	111,747,000	
新潟県 公募平成30年度第2回	200,000,000	201,192,000	
長野県 公募令和3年度第1回	300,000,000	297,990,000	

茨城県 公募令和3年度第3回	200,000,000	199,144,000
群馬県 公募第12回	100,000,000	101,551,000
群馬県 公募(5年)第13回	300,000,000	298,722,000
群馬県 公募(20年)第3回	100,000,000	113,864,000
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	189,076,176
共同発行市場地方債 公募第120回	300,000,000	302,178,000
共同発行市場地方債 公募第121回	100,000,000	100,655,000
共同発行市場地方債 公募第122回	400,000,000	403,056,000
共同発行市場地方債 公募第124回	300,000,000	303,840,000
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	101,263,000
共同発行市場地方債 公募第128回	700,000,000	707,833,000
共同発行市場地方債 公募第129回	100,000,000	101,257,000
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	101,405,000
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	101,298,000
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	202,722,000
共同発行市場地方債 公募第137回	500,000,000	506,400,000
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	157,008,800
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	546,231,600
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,010,820,000
共同発行市場地方債 公募第152回	400,000,000	406,248,000
共同発行市場地方債 公募第154回	300,000,000	303,759,000
共同発行市場地方債 公募第156回	200,000,000	200,080,000
共同発行市場地方債 公募第157回	300,000,000	299,874,000
共同発行市場地方債 公募第161回	300,000,000	299,460,000
共同発行市場地方債 公募第172回	600,000,000	602,154,000
共同発行市場地方債 公募第184回	100,000,000	100,032,000
共同発行市場地方債 公募第186回	400,000,000	401,956,000
共同発行市場地方債 公募第188回	300,000,000	301,785,000
	610,000,000	609,164,300

共同発行市場地方債 公募第190回			
共同発行市場地方債 公募第191回	100,000,000	99,723,000	
共同発行市場地方債 公募第194回	200,000,000	198,792,000	
共同発行市場地方債 公募第196回	400,000,000	395,936,000	
共同発行市場地方債 公募第197回	300,000,000	296,853,000	
共同発行市場地方債 公募第200回	100,000,000	98,926,000	
共同発行市場地方債 公募第206回	300,000,000	297,594,000	
共同発行市場地方債 公募第213回	300,000,000	296,499,000	
共同発行市場地方債 公募第215回	400,000,000	395,948,000	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	114,724,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	117,111,000	
長崎県 公募令和元年度第3回	100,000,000	98,908,000	
島根県 公募(30年)平成29年度第1回	100,000,000	100,300,000	
佐賀県 公募平成28年度第1回	100,000,000	99,899,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	202,410,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	101,110,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	143,711,100	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	101,110,000	
熊本県 公募平成28年度第2回	132,000,000	131,734,680	
熊本市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,172,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	236,177,964	
新潟市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,289,000	
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	100,789,000	
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	101,176,000	
大阪市 公募平成26年度第5回	100,000,000	101,386,000	
大阪市 公募平成27年度第6回	100,000,000	101,468,000	
大阪市 公募令和2年度第2回	300,000,000	297,594,000	
大阪市 公募令和3年度第2回	300,000,000	297,024,000	
大阪市 公募(15年)第1回	100,000,000	107,302,000	
大阪市 公募(20年)第1回	300,000,000	336,600,000	
大阪市 公募(20年)第5回	100,000,000	114,982,000	
大阪市 公募(20年)第6回	100,000,000	113,742,000	
大阪市 公募(20年)第17回	100,000,000	114,493,000	
大阪市 公募(20年)第26回	100,000,000	100,607,000	
名古屋市 公募第488回	300,000,000	304,167,000	
名古屋市 公募第489回	100,000,000	101,120,000	
名古屋市 公募第501回	200,000,000	200,166,000	

名古屋市 公募第503回	100,000,000	100,241,000	
名古屋市 公募第504回	200,000,000	200,438,000	
名古屋市 公募第511回	200,000,000	197,614,000	
名古屋市 公募第512回	300,000,000	297,918,000	
名古屋市 公募(12年)第1回	200,000,000	206,440,000	
名古屋市 公募(15年)第2回	100,000,000	105,248,000	
京都市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,265,000	
京都市 公募平成29年度第4回	101,280,000	101,727,657	
京都市 公募(20年)第2回	100,000,000	107,289,000	
京都市 公募(20年)第5回	200,000,000	221,724,000	
京都市 公募(20年)第6回	100,000,000	112,301,000	
京都市 公募(20年)第13回	100,000,000	111,249,000	
京都市 公募(20年)第15回	200,000,000	198,300,000	
神戸市 公募平成26年度第17回	300,000,000	301,890,000	
神戸市 公募平成28年度第1回	200,000,000	199,916,000	
神戸市 公募平成30年度第2回	200,000,000	196,238,000	
横浜市 公募公債平成25年度1回	200,000,000	201,618,000	
横浜市 公募公債平成25年度5回	200,000,000	202,198,000	
横浜市 公募公債平成26年度5回	200,000,000	202,310,000	
横浜市 公募平成28年度第5回	300,000,000	301,716,000	
横浜市 公募平成29年度第3回	100,000,000	100,314,000	
横浜市 公募2019年度第3回	200,000,000	197,660,000	
横浜市 公募(30年)第2回	200,000,000	251,138,000	
横浜市 公募(20年)第11回	100,000,000	110,092,000	
横浜市 公募(20年)第18回	100,000,000	114,433,000	
横浜市 公募(20年)第26回	100,000,000	115,147,000	
横浜市 公募(20年)第30回	100,000,000	111,440,000	
札幌市 公募(15年)平成23年度第9回	200,000,000	213,654,000	
札幌市 公募(20年)平成24年度第1回	100,000,000	114,772,000	
札幌市 公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	115,390,000	
札幌市 公募平成26年度第4回	100,000,000	101,154,000	
札幌市 公募平成26年度第9回	200,000,000	202,066,000	
川崎市 公募(20年)第17回	100,000,000	112,681,000	
川崎市 公募(20年)第19回	100,000,000	111,269,000	
川崎市 公募(30年)第11回	100,000,000	97,433,000	
北九州市 公募(10年)令和2年度第2回	200,000,000	197,496,000	
北九州市 公募(20年)第3回	200,000,000	224,098,000	
北九州市 公募(20年)第14回	100,000,000	114,469,000	
福岡市 公募(20年)平成21年度第3回	200,000,000	228,962,000	

	福岡市 公募(20年)平成23年度第4回	100,000,000	115,017,000
	福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	112,752,000
	福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	101,286,000
	福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	161,976,000
	福岡市 公募(5年)2020年度第9回	300,000,000	299,136,000
	広島市 公募平成26年度第2回	100,000,000	101,111,000
	広島市 公募平成27年度第2回	500,000,000	507,270,000
	広島市 公募(10年)平成30年度第6回	241,000,000	240,433,650
	千葉市 公募平成26年度第2回	200,000,000	202,462,000
	三重県 公募平成28年度第1回	155,000,000	155,447,950
	福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	100,526,000
	福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	199,958,000
	福井県 公募令和元年度第3回	200,000,000	197,572,000
	徳島県 公募平成29年度第2回	200,000,000	200,344,000
	徳島県 公募平成30年度第2回	300,000,000	301,788,000
	山梨県 公募令和元年度第1回	100,000,000	98,785,000
	岡山県 公募平成28年度第2回	168,900,000	169,541,820
	岡山県 公募令和2年度第3回	300,000,000	298,908,000
	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第96回	100,000,000	113,244,000
	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回	300,000,000	344,400,000
	福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	112,747,000
	福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	103,672,000
小計	銘柄数:308 組入時価比率:7.0%	55,886,000,000	57,802,717,135 7.0%
合計			57,802,717,135
特殊債券	日本円		
	フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014)	100,000,000	101,196,000
	新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	193,316,830
	新関西国際空港債券 政府保証第5回	117,000,000	117,147,420
	新関西国際空港社債 財投機関債第6回	300,000,000	324,327,000
	新関西国際空港社債 財投機関債第9回	100,000,000	106,914,000
	新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	106,160,000
	新関西国際空港社債 財投機関債第22回	200,000,000	200,036,000
	原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券 政府保証第16回	700,000,000	699,944,000

日本政策投資銀行債券 政府保証第 2 2 回	100,000,000	102,949,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第 4 7 回	100,000,000	105,901,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第 6 6 回	400,000,000	400,000,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第 7 8 回	200,000,000	200,970,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第 8 2 回	100,000,000	100,730,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第 8 6 回	300,000,000	301,344,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第 9 6 回	200,000,000	200,000,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第 1 0 1 回	300,000,000	302,145,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第 1 3 7 回	400,000,000	399,024,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第 1 3 8 回	400,000,000	395,140,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 1 9 回	159,000,000	160,159,110	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 3 7 回	400,000,000	400,088,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 4 2 回	300,000,000	300,519,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 5 2 回	300,000,000	299,613,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 5 5 回	300,000,000	298,950,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 4 回	100,000,000	127,103,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 8 回	200,000,000	219,228,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 7 回	100,000,000	110,260,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 2 3 回	300,000,000	336,399,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 3 3 回	200,000,000	288,380,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 3 9 回	300,000,000	342,528,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 4 7 回	100,000,000	115,513,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 8 9 回	100,000,000	113,625,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 2 回	100,000,000	100,698,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 3 回	350,000,000	398,303,500	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 5 回	100,000,000	115,531,000	
	100,000,000	101,220,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第107回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第116回	400,000,000	404,388,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第122回	100,000,000	101,379,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第123回	100,000,000	101,350,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第130回	200,000,000	202,424,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第134回	200,000,000	202,280,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第136回	200,000,000	202,726,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第145回	300,000,000	338,673,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第149回	100,000,000	114,452,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第157回	100,000,000	104,869,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第164回	100,000,000	108,063,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第173回	100,000,000	87,877,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第188回	100,000,000	99,856,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第260回	200,000,000	182,874,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第90回	100,000,000	114,491,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	200,000,000	229,316,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回	200,000,000	229,816,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回	200,000,000	231,648,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回	200,000,000	230,812,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	200,000,000	228,230,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	100,000,000	124,500,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回	100,000,000	120,185,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回	100,000,000	113,508,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	100,000,000	112,746,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回	300,000,000	365,631,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回	100,000,000	114,751,000	
	196,000,000	197,293,600	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回	400,000,000	403,172,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回	1,000,000,000	1,012,210,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回	272,000,000	275,538,720	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	300,000,000	303,807,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第211回	137,000,000	138,787,850	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	145,000,000	146,908,200	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第216回	100,000,000	112,789,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第217回	100,000,000	118,291,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第219回	100,000,000	112,755,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	300,000,000	304,371,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第224回	100,000,000	118,367,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回	190,000,000	192,500,400	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第229回	630,000,000	638,473,500	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回	100,000,000	101,200,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第239回	500,000,000	544,615,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第241回	200,000,000	202,516,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第245回	300,000,000	323,883,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第258回	400,000,000	404,812,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第261回	401,000,000	405,848,090	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第271回	151,000,000	150,688,940	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第296回	200,000,000	199,528,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第297回	100,000,000	99,999,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第306回	403,000,000	403,511,810	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第315回	100,000,000	100,029,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第321回	600,000,000	601,116,000	
	100,000,000	99,805,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 2 4回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 3 5回	100,000,000	98,352,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 3 9回	500,000,000	501,940,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 4 2回	131,000,000	131,078,600	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 5 1回	100,000,000	100,031,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 5 4回	200,000,000	199,872,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 5 7回	100,000,000	100,446,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第2 8回	400,000,000	509,768,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第3 3回	100,000,000	129,118,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第3 8回	1,000,000,000	1,056,940,000	
公営企業債券 3 0年第4回財投機関債	100,000,000	129,483,000	
地方公営企業等金融機構債券(2 0年) 第1回	100,000,000	112,682,000	
地方公共団体金融機構債券(2 0年) 第1回	300,000,000	344,415,000	
地方公共団体金融機構債券 2 0年第4回	100,000,000	114,575,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 6回	100,000,000	109,439,000	
地方公共団体金融機構債券 2 0年第6回	300,000,000	347,727,000	
地方公共団体金融機構債券 2 0年第7回	300,000,000	347,223,000	
地方公共団体金融機構債券 F 2 4回	100,000,000	101,783,000	
地方公共団体金融機構債券(2 0年) 第1 0回	300,000,000	337,593,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 0 4回	100,000,000	103,813,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 0 6回	100,000,000	102,543,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 2 2回	100,000,000	106,727,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 2 4回	100,000,000	106,710,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 3 2回	500,000,000	517,480,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 2回	100,000,000	102,648,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 5回	200,000,000	206,140,000	
	100,000,000	105,831,000	

地方公共団体金融機構債券 F 1 4 7 回			
地方公共団体金融機構債券 F 1 6 0 回	100,000,000	105,369,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 8 回	500,000,000	503,835,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 9 回	13,000,000	13,154,180	
地方公共団体金融機構債券(20 年) 第 2 9 回	100,000,000	114,649,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 0 回	100,000,000	101,296,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 1 回	600,000,000	607,404,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 2 回	300,000,000	303,825,000	
地方公共団体金融機構債券(15 年) 第 2 回	200,000,000	213,070,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 6 回	591,000,000	599,368,560	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 9 回	116,000,000	117,613,560	
地方公共団体金融機構債券(20 年) 第 3 8 回	100,000,000	112,354,000	
地方公共団体金融機構債券 F 2 4 0 回	300,000,000	319,449,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	101,305,000	
地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	101,337,000	
地方公共団体金融機構債券(20 年) 第 3 9 回	100,000,000	111,641,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 5 回	400,000,000	405,296,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 9 回	320,000,000	323,580,800	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 2 回	189,000,000	191,852,010	
地方公共団体金融機構債券 第 7 4 回	300,000,000	304,596,000	
地方公共団体金融機構債券 第 7 7 回	100,000,000	101,512,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 8 回	509,000,000	515,108,000	
地方公共団体金融機構債券 第 7 9 回	400,000,000	406,204,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (8年) 第 5 回	500,000,000	501,555,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 8 3 回	116,000,000	115,758,720	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 9 1 回	300,000,000	300,066,000	
	200,000,000	200,618,000	

地方公共団体金融機構債券 第95回			
地方公共団体金融機構債券 第101回	400,000,000	401,804,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第108回	157,000,000	157,097,340	
政保 地方公共団体金融機構債券 第110回	100,000,000	99,936,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第113回	110,000,000	110,536,800	
公営企業債券(20年) 第5回財投機関債	200,000,000	206,596,000	
公営企業債券(20年) 第19回財投機関債	100,000,000	110,910,000	
公営企業債券(20年) 第20回財投機関債	100,000,000	110,725,000	
公営企業債券(20年) 第23回財投機関債	200,000,000	223,812,000	
公営企業債券(20年) 第24回財投機関債	100,000,000	112,894,000	
公営企業債券(20年) 第25回財投機関債	100,000,000	114,526,000	
首都高速道路 第28回	200,000,000	199,134,000	
日本政策金融公庫債券 政府保証第63回	110,000,000	108,738,300	
都市再生債券 財投機関債第96回	200,000,000	202,808,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	105,827,000	
都市再生債券 財投機関債第101回	100,000,000	105,283,000	
都市再生債券 財投機関債第109回	100,000,000	105,366,000	
都市再生債券 財投機関債第113回	300,000,000	314,754,000	
都市再生債券 財投機関債第121回	200,000,000	203,458,000	
都市再生債券 財投機関債第127回	100,000,000	99,863,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	107,195,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第16回	360,000,000	364,222,800	
民間都市開発推進機構 政府保証第17回	400,000,000	401,280,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	163,041,360	
関西国際空港債券 政府保証第54回	300,000,000	342,717,000	
中部国際空港債券 政府保証第18回	368,000,000	370,730,560	
中部国際空港債券 政府保証第22回	300,000,000	299,907,000	
預金保険機構債券 政府保証第230回	600,000,000	601,032,000	

預金保険機構債券 政府保証第23 1回	300,000,000	300,471,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第3回	400,000,000	442,988,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第6回	200,000,000	224,598,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第18回	100,000,000	103,361,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第42回	100,000,000	105,778,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第49回	100,000,000	115,170,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第59回	100,000,000	114,379,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第75回	100,000,000	116,155,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第77回	300,000,000	321,498,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	116,076,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第81回	100,000,000	115,012,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第85回	200,000,000	228,606,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	214,370,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第115回	100,000,000	114,772,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第120回	100,000,000	115,129,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第123回	200,000,000	229,362,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	126,915,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第132回	200,000,000	210,830,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第137回	100,000,000	107,008,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第143回	100,000,000	106,526,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回	450,000,000	456,943,500	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第188回	300,000,000	300,000,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第198回	300,000,000	300,717,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第208回	200,000,000	200,886,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第223回	100,000,000	100,135,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第244回	130,000,000	130,657,800	
	300,000,000	299,484,000	

住宅金融支援機構債券 財投機関債 第301回			
成田国際空港 第17回	400,000,000	404,780,000	
成田国際空港 第19回	100,000,000	100,637,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第6回	200,000,000	213,140,000	
商工債券 利付第815回い号	100,000,000	100,118,000	
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	100,143,000	
商工債券 利付第819回い号	300,000,000	300,474,000	
商工債券 利付第829回い号	200,000,000	200,116,000	
商工債券 利付第831回い号	200,000,000	199,874,000	
商工債券 利付第833回い号	100,000,000	99,839,000	
商工債券 利付第845回い号	300,000,000	299,724,000	
商工債券 利付第852回い号	100,000,000	99,724,000	
商工債券 利付第854回い号	400,000,000	398,676,000	
商工債券 利付第856回い号	200,000,000	199,272,000	
しんきん中金債券 利付第374回	300,000,000	299,469,000	
しんきん中金債券 利付第377回	100,000,000	99,729,000	
しんきん中金債券 利付第379回	400,000,000	398,784,000	
しんきん中金債券 利付第380回	100,000,000	99,624,000	
商工債券 利付(3年)第258回	100,000,000	99,842,000	
商工債券 利付(10年)第15回	200,000,000	202,388,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関 債	200,000,000	231,572,000	
国際協力機構債券 第23回財投機 関債	100,000,000	101,299,000	
東日本高速道路 第61回	200,000,000	198,634,000	
東日本高速道路 第83回	200,000,000	199,352,000	
東日本高速道路 第86回	400,000,000	398,172,000	
中日本高速道路 第63回	100,000,000	101,733,000	
中日本高速道路 第79回	300,000,000	299,661,000	
中日本高速道路 第86回	100,000,000	99,784,000	
中日本高速道路 第89回	100,000,000	99,701,000	
中日本高速道路 第90回	300,000,000	299,007,000	
中日本高速道路 第91回	200,000,000	199,134,000	
西日本高速道路 第20回	200,000,000	202,278,000	
西日本高速道路 第22回	400,000,000	405,636,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	101,239,000	
西日本高速道路 第30回	300,000,000	300,633,000	
西日本高速道路 第50回	200,000,000	199,836,000	
西日本高速道路 第64回	200,000,000	199,134,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第57回	300,000,000	303,261,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第62回	100,000,000	101,255,000	

鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第68回	200,000,000	202,634,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第69回	100,000,000	111,566,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第71回	500,000,000	506,435,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第90回	300,000,000	297,294,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第135回	300,000,000	296,574,000
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	48,275,000	48,354,653
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	31,824,000	32,203,978
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	9,941,000	9,965,057
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	21,996,000	22,300,424
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	25,048,000	25,719,787
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	44,888,000	45,453,139
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	48,865,000	48,967,127
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	43,036,000	43,857,987
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	68,706,000	69,983,244
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	12,075,000	12,358,762
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	18,496,000	19,610,568
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	60,852,000	64,191,557
貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券	8,790,000	8,804,239
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	56,080,000	58,637,248
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券	17,618,000	17,648,655
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	66,681,000	70,095,734
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	50,214,000	52,471,621
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	33,312,000	35,099,521
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	62,349,000	65,478,919
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	71,337,000	74,103,448
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	112,941,000	117,612,239
	107,292,000	112,180,223

貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	69,858,000	72,819,280	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	23,256,000	24,319,729	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	55,160,000	58,071,344	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	36,556,000	37,866,532	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	80,008,000	82,919,491	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	35,451,000	36,724,399	
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	19,848,000	19,885,909	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	108,354,000	113,061,981	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	22,832,000	24,112,190	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	24,075,000	25,454,738	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	22,420,000	23,689,420	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	21,974,000	23,138,402	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	62,778,000	65,712,871	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	91,416,000	95,628,449	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	31,190,000	32,661,544	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	69,906,000	72,793,117	
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	65,304,000	68,603,158	
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	65,910,000	69,393,343	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	117,480,000	122,640,896	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	71,708,000	75,160,023	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	120,828,000	125,702,201	
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	103,902,000	107,566,623	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	82,160,000	86,108,609	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	68,542,000	71,535,229	
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	169,772,000	175,763,253	
	292,285,000	302,181,770	

貸付債権担保第 8 4 回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第 8 8 回住宅金融支援機構債券	44,856,000	46,203,025	
貸付債権担保第 8 9 回住宅金融支援機構債券	46,169,000	47,605,317	
貸付債権担保第 9 0 回住宅金融支援機構債券	47,705,000	48,993,035	
貸付債権担保第 9 2 回住宅金融支援機構債券	99,690,000	101,687,787	
貸付債権担保第 9 3 回住宅金融支援機構債券	105,828,000	107,101,110	
貸付債権担保第 9 4 回住宅金融支援機構債券	55,634,000	56,915,807	
貸付債権担保第 9 6 回住宅金融支援機構債券	59,393,000	60,574,326	
貸付債権担保第 9 7 回住宅金融支援機構債券	177,183,000	181,593,084	
貸付債権担保第 9 8 回住宅金融支援機構債券	182,721,000	187,966,919	
貸付債権担保第 9 9 回住宅金融支援機構債券	123,242,000	126,622,528	
貸付債権担保第 1 0 0 回住宅金融支援機構債券	59,512,000	61,027,175	
貸付債権担保第 1 0 1 回住宅金融支援機構債券	60,752,000	62,467,636	
貸付債権担保第 1 1 5 回住宅金融支援機構債券	228,876,000	228,523,530	
貸付債権担保第 1 1 6 回住宅金融支援機構債券	153,542,000	153,967,311	
貸付債権担保第 1 1 7 回住宅金融支援機構債券	154,946,000	155,111,792	
貸付債権担保第 1 1 8 回住宅金融支援機構債券	77,103,000	77,278,794	
貸付債権担保第 1 1 9 回住宅金融支援機構債券	154,382,000	154,616,660	
貸付債権担保第 1 2 0 回住宅金融支援機構債券	77,816,000	77,673,596	
貸付債権担保第 1 2 1 回住宅金融支援機構債券	78,434,000	78,423,019	
貸付債権担保第 1 2 3 回住宅金融支援機構債券	79,597,000	79,710,823	
貸付債権担保第 1 2 5 回住宅金融支援機構債券	318,816,000	318,369,657	
貸付債権担保第 1 2 6 回住宅金融支援機構債券	241,122,000	240,883,289	
貸付債権担保第 1 2 8 回住宅金融支援機構債券	160,668,000	160,404,504	
貸付債権担保第 1 2 9 回住宅金融支援機構債券	164,082,000	164,175,526	
貸付債権担保第 1 3 4 回住宅金融支援機構債券	166,576,000	165,974,660	
	83,633,000	83,316,030	

		貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券	84,355,000	84,318,727	
		貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券	84,713,000	84,294,517	
		貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券	261,006,000	258,562,983	
		貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券	260,352,000	257,993,210	
		貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券	451,915,000	443,586,206	
		貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券	182,436,000	180,684,614	
		貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券	184,106,000	181,898,569	
		貸付債権担保第164回住宅金融支援機構債券	288,234,000	285,069,190	
		貸付債権担保第165回住宅金融支援機構債券	192,286,000	190,655,414	
		貸付債権担保第166回住宅金融支援機構債券	289,185,000	287,898,126	
		貸付債権担保第167回住宅金融支援機構債券	193,846,000	192,927,169	
		貸付債権担保第168回住宅金融支援機構債券	193,938,000	192,838,371	
		貸付債権担保第169回住宅金融支援機構債券	292,329,000	290,361,625	
		貸付債権担保第170回住宅金融支援機構債券	489,450,000	484,883,431	
		貸付債権担保第174回住宅金融支援機構債券	297,384,000	294,963,294	
		貸付債権担保第175回住宅金融支援機構債券	298,431,000	295,428,784	
		貸付債権担保第176回住宅金融支援機構債券	299,577,000	295,397,900	
		貸付債権担保第177回住宅金融支援機構債券	200,000,000	198,550,000	
		貸付債権担保第178回住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,793,000	
	小計	銘柄数：329 組入時価比率：7.8%	62,568,410,000	64,811,300,561 7.9%	
	合計			64,811,300,561	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行(BFCM)第29回円貨社債	200,000,000	199,240,000	
		フランス相互信用連合銀行(BFCM)第31回円貨社債	100,000,000	98,710,000	
		ピー・ピー・シー・イー・エス・エー第14回円貨社債	100,000,000	99,612,000	
		ピー・ピー・シー・イー・エス・エー第25回非上位円貨社債	200,000,000	198,732,000	

クレディ・アグリコル・エス・ エー 第6回円貨社債(2014)	100,000,000	101,298,000	
クレディ・アグリコル・エス・ エー 第15回円貨社債(2018)	100,000,000	99,854,000	
クレディ・アグリコル・エス・ エー 第16回円貨社債(2018)	100,000,000	99,079,000	
スタンダード・チャータード 第3 回円貨社債(2015)	100,000,000	100,405,000	
エイチエスピーシー・ホールディン グス・ピーエルシー 第2回円	100,000,000	100,691,000	
エイチエスピーシー・ホールディン グス・ピーエルシー 第3回円	100,000,000	101,864,000	
ロイズ・バンキング・グループ・ ピーエルシー 第6回円貨社債	100,000,000	100,326,000	
ロイズ・バンキング・グループ・ ピーエルシー 第7回円貨社債	100,000,000	99,756,000	
フランス電力 第4回円貨社債(2 017)	100,000,000	101,860,000	
現代キャピタル・サービス・イン ク 第15回円貨社債	200,000,000	198,806,000	
ビー・エヌ・ピー・パリバ 第1回 円貨社債(2017)	100,000,000	100,679,000	
ウエストバック・バンキング・コー ポレーション 第12回円貨社	200,000,000	200,060,000	
オーストラリア・ニュージーランド 銀行 第10回円貨社債	200,000,000	200,042,000	
I N P E X 第1回社債間限定同順 位特約付	500,000,000	497,660,000	
長谷工コーポレーション 第14回 社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,894,000	
五洋建設 第7回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	99,359,000	
大和ハウス工業 第9回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	98,482,000	
大和ハウス工業 第25回特定社債 間限定同順位特約付	300,000,000	296,415,000	
日揮ホールディングス 第6回特定 社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,642,000	
明治ホールディングス 第10回社 債間限定同順位特約付	200,000,000	198,422,000	
アサヒグループホールディングス 第16回特定社債間限定同順位	300,000,000	297,999,000	
味の素 第24回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,110,000	
日本たばこ産業 第13回	100,000,000	99,745,000	
三越伊勢丹ホールディングス 第6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,208,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,785,000	
森ヒルズリート投資法人 第17回 特定投資法人債間限定同順位特	200,000,000	199,104,000	
森ビル 第23回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	97,702,000	

セブン&アイ・ホールディングス 第13回社債間限定同順位特約	100,000,000	99,842,000	
セブン&アイ・ホールディングス 第14回社債間限定同順位特約	600,000,000	598,956,000	
セブン&アイ・ホールディングス 第15回社債間限定同順位特約	200,000,000	199,390,000	
東レ 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,901,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,626,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付	200,000,000	197,738,000	
王子ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,124,000	
王子ホールディングス 第42回社債間限定同順位特約付	600,000,000	596,088,000	
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,795,000	
イビデン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,587,000	
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,977,000	
三菱ケミカルホールディングス 第29回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,619,000	
三菱ケミカルホールディングス 第33回社債間限定同順位特約付	200,000,000	197,914,000	
三菱ケミカルホールディングス 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,601,000	
ダイセル 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,181,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,970,000	
電通 第6回社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,267,000	
武田薬品工業 第16回社債間限定同順位特約付	200,000,000	197,726,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,797,000	
オリエンタルランド 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,677,000	
オリエンタルランド 第18回社債間限定同順位特約付	200,000,000	197,868,000	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,773,000	
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,730,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,475,000	
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,736,000	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	300,000,000	298,731,000	
	100,000,000	99,576,000	

ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順			
ジェイ エフ イー ホールディングス 第34回社債間限定同順	100,000,000	99,845,000	
三菱マテリアル 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,119,000	
住友金属鉱山 第33回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,408,000	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,656,000	
LIXILグループ 第11回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,418,000	
日立建機 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,629,000	
荏原製作所 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,452,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	213,520,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,434,000	
パナソニック 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,786,000	
パナソニック 第21回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,673,000	
パナソニック 第22回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,160,000	
パナソニック 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,122,000	
ソニー 第32回	100,000,000	100,181,000	
東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,908,000	
三菱重工業 第35回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,669,000	
三菱重工業 第38回社債間限定同順位特約付(第2回グリーンボ)	300,000,000	297,714,000	
J A三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,170,000	
三井住友トラスト・パナソニックファイナンス 第9回社債間限定	100,000,000	99,672,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	100,954,000	
トヨタ自動車 第26回社債間限定同順位特約付	700,000,000	696,311,000	
トヨタ自動車 第27回社債間限定同順位特約付	300,000,000	297,462,000	
楽天カード 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,348,000	
ドンキホーテホールディングス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,352,000	
ニコン 第22回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,379,000	
丸紅 第113回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,003,000	

豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,810,000
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	205,878,000
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,847,000
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,031,000
住友商事 第53回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,960,000
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,549,000
クレディセゾン 第65回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,093,000
クレディセゾン 第76回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,820,000
イオン 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,325,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付	100,000,000	101,342,000
りそなホールディングス 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,285,000
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	200,000,000	202,518,000
みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,626,000
三菱東京UFJ銀行 第23回劣後特約付	100,000,000	117,594,000
三菱東京UFJ銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	113,988,000
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	300,000,000	303,087,000
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	100,000,000	101,282,000
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付	100,000,000	105,538,000
三井住友信託銀行 第18回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,190,000
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,783,000
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,198,000
セブン銀行 第12回社債間限定同順位特約付	300,000,000	303,768,000
みずほフィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	200,000,000	202,408,000
みずほ銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	110,603,000
芙蓉総合リース 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,528,000
みずほリース 第3回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,583,000
みずほリース 第7回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,862,000

NTTファイナンス 第2回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,160,000	
NTTファイナンス 第16回日本 電信電話保証付	100,000,000	99,940,000	
NTTファイナンス 第17回日本 電信電話保証付	200,000,000	199,962,000	
NTTファイナンス 第18回日本 電信電話保証付	300,000,000	300,030,000	
ホンダファイナンス 第69回社債 間限定同順位特約付	200,000,000	198,662,000	
トヨタファイナンス 第81回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	99,721,000	
トヨタファイナンス 第96回社債 間限定同順位特約付	800,000,000	795,712,000	
リコーリース 第28回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	99,828,000	
イオンフィナンシャルサービス 第 6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,023,000	
アコム 第77回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,094,000	
ジャックス 第19回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,062,000	
オリエントコーポレーション 第3 2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,033,000	
日立キャピタル 第61回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,145,000	
日立キャピタル 第80回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	98,638,000	
オリックス 第202回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	98,655,000	
三井住友ファイナンス&リース 第 27回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,650,000	
三菱UFJリース 第52回社債間 限定同順位特約付	300,000,000	300,438,000	
三菱UFJリース 第56回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,442,000	
三菱UFJリース 第76回社債間 限定同順位特約付	300,000,000	297,612,000	
大和証券グループ本社 第23回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	101,725,000	
大和証券グループ本社 第36回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	99,427,000	
三井住友海上火災保険 第7回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	99,994,000	
三井不動産 第71回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	198,748,000	
三菱地所 第93回担保提供制限等 財務上特約無	200,000,000	228,284,000	
三菱地所 第120回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	99,674,000	
東京建物 第25回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,992,000	
	100,000,000	94,296,000	

ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付			
エヌ・ティ・ティ都市開発 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,041,000	
日本ビルファンド投資法人 第13回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	101,252,000	
野村不動産オフィスファンド投資法人 第7回特定投資法人債間限	100,000,000	113,519,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人 第5回特定投資法人債	100,000,000	101,246,000	
東武鉄道 第124回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,646,000	
相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付	200,000,000	201,564,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,181,000	
東京急行電鉄 第83回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,158,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	211,670,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,477,000	
京成電鉄 第58回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,982,000	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	200,000,000	227,640,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,128,000	
東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,992,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,698,000	
東日本旅客鉄道 第119回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,634,000	
東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,287,000	
東日本旅客鉄道 第145回社債間限定同順位特約付	200,000,000	174,478,000	
東日本旅客鉄道 第147回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,404,000	
東日本旅客鉄道 第153回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,101,000	
東日本旅客鉄道 第164回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,070,000	
東日本旅客鉄道 第165回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,457,000	
東日本旅客鉄道 第167回社債間限定同順位特約付	100,000,000	92,556,000	
西日本旅客鉄道 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,271,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	300,000,000	333,906,000	
	200,000,000	198,558,000	

西日本旅客鉄道 第60回社債間限定同順位特約付			
西日本旅客鉄道 第65回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,264,000	
西日本旅客鉄道 第66回社債間限定同順位特約付	200,000,000	194,174,000	
西日本旅客鉄道 第77回社債間限定同順位特約付	100,000,000	92,591,000	
東海旅客鉄道 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	210,342,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	229,588,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,481,000	
東海旅客鉄道 第73回社債間限定同順位特約付	300,000,000	314,640,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,813,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	99,658,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	99,597,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	100,624,000	
西武ホールディングス 第1回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,684,000	
西日本鉄道 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,376,000	
阪急阪神ホールディングス 第47回	400,000,000	424,492,000	
阪急阪神ホールディングス 第49回	100,000,000	100,492,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,759,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,453,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,325,000	
日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,249,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,411,000	
九州旅客鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	187,796,000	
九州旅客鉄道 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	93,868,000	
A N Aホールディングス 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	92,957,000	
滋澤倉庫 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,649,000	
K D D I 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,211,000	
K D D I 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,240,000	
ソフトバンク 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,428,000	

ソフトバンク 第12回社債間限定 同順位特約付	200,000,000	198,076,000	
ソフトバンク 第14回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	99,063,000	
ソフトバンク 第16回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	98,342,000	
東京電力 第548回	100,000,000	111,071,000	
東京電力 第560回	100,000,000	110,500,000	
中部電力 第500回	200,000,000	203,104,000	
中部電力 第524回	100,000,000	100,440,000	
中部電力 第530回	200,000,000	197,980,000	
関西電力 第509回	100,000,000	100,698,000	
関西電力 第511回	300,000,000	300,981,000	
関西電力 第527回	200,000,000	200,302,000	
関西電力 第535回	200,000,000	199,240,000	
中国電力 第377回	100,000,000	101,483,000	
中国電力 第400回	100,000,000	99,972,000	
中国電力 第402回	100,000,000	100,093,000	
中国電力 第416回	100,000,000	99,617,000	
中国電力 第422回	600,000,000	596,448,000	
中国電力 第425回	100,000,000	99,437,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	101,116,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	103,329,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	101,406,000	
北陸電力 第326回	100,000,000	98,989,000	
東北電力 第475回	100,000,000	101,470,000	
東北電力 第481回	200,000,000	203,644,000	
東北電力 第484回	100,000,000	100,424,000	
東北電力 第491回	100,000,000	100,469,000	
東北電力 第508回	100,000,000	100,402,000	
東北電力 第521回	300,000,000	300,480,000	
東北電力 第529回	200,000,000	198,182,000	
四国電力 第281回	100,000,000	101,493,000	
九州電力 第424回	100,000,000	101,843,000	
九州電力 第428回	105,000,000	106,816,500	
九州電力 第449回	200,000,000	200,660,000	
九州電力 第451回	100,000,000	100,439,000	
九州電力 第476回	100,000,000	99,899,000	
九州電力 第481回	300,000,000	297,312,000	
九州電力 第484回	200,000,000	198,792,000	
九州電力 第493回	300,000,000	297,474,000	
北海道電力 第321回	100,000,000	101,784,000	
北海道電力 第323回	100,000,000	106,760,000	

	北海道電力 第338回	100,000,000	101,141,000	
	北海道電力 第345回	300,000,000	300,192,000	
	電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,579,000	
	電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,402,000	
	電源開発 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,279,000	
	電源開発 第59回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,970,000	
	電源開発 第73回社債間限定同順位特約付	200,000,000	197,276,000	
	東京電力パワーグリッド 第6回	100,000,000	102,144,000	
	東京電力パワーグリッド 第11回	300,000,000	305,127,000	
	東京電力パワーグリッド 第14回	100,000,000	100,337,000	
	東京電力パワーグリッド 第15回	300,000,000	305,049,000	
	東京電力パワーグリッド 第28回	100,000,000	102,945,000	
	東京電力パワーグリッド 第35回	100,000,000	104,195,000	
	東京電力パワーグリッド 第38回	400,000,000	403,556,000	
	東京電力パワーグリッド 第40回	400,000,000	418,908,000	
	東京電力パワーグリッド 第45回	300,000,000	302,235,000	
	東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	120,561,000	
	東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付	100,000,000	92,007,000	
	大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	89,823,000	
	大阪瓦斯 第43回社債間限定同順位特約付	200,000,000	188,804,000	
	北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,927,000	
	北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,838,000	
	広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,721,000	
	東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,893,000	
	ファーストリテイリング 第7回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,409,000	
	ソフトバンクグループ 第54回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,290,000	
小計	銘柄数：257 組入時価比率：4.8%	39,805,000,000	40,110,710,500	4.9%
合計			40,110,710,500	
合計			823,881,347,546	

(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18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	9,733,775,118
コール・ローン	1,752,147,296
株式	1,128,049,925,154
投資証券	26,247,097,381
派生商品評価勘定	30,769,202
未収入金	4,556,016
未収配当金	981,403,227
差入委託証拠金	6,447,826,062
流動資産合計	1,173,247,499,456
資産合計	1,173,247,499,456
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	350,024,127
未払解約金	212,261,123
未払利息	1,111
その他未払費用	1,812,600
流動負債合計	564,098,961
負債合計	564,098,961
純資産の部	
元本等	
元本	272,333,706,456
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	900,349,694,039
元本等合計	1,172,683,400,495
純資産合計	1,172,683,400,495
負債純資産合計	1,173,247,499,456

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価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18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	4.3061円
(10,000口当たり純資産額)	(43,061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19日 至 2022年 2月18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>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18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18日現在	
期首	2021年 2月19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	245,379,120,410円
同期中における追加設定元本額	54,304,148,688円
同期中における一部解約元本額	27,349,562,642円
期末元本額	272,333,706,456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	96,303,828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	490,491,819円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,182,535,062円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	4,099,042,871円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	3,745,037,418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	10,023,556円
野村資産設計ファンド2025	18,122,257円

野村資産設計ファンド2030	26,722,606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)	45,960,406,680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	8,143,159円
野村インデックスファンド・外国株式	7,019,499,298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	142,643,220円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	2,229,254,934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	10,623,735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	1,246,511,404円
野村つみたて外国株投信	10,041,824,238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)	4,746,930,163円
世界6資産分散ファンド	37,936,686円
野村資産設計ファンド2060	7,482,776円
野村スリーゼロ先進国株式投信	599,781,753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	6,044,171,201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)	618,632,500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)	805,493,995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)	391,939,904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)	2,252,907,856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)	196,291,988円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	11,708,011,985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)	1,229,488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-KOKUSAI(確定拠出年金向け)	84,475,240,173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)	7,423,418,891円
マイバランスDC30	768,297,596円
マイバランスDC50	1,753,291,498円
マイバランスDC70	1,555,659,036円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	32,600,059,489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)	383,795,283円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	326,843,498円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	315,455,075円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	16,894,965円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	7,696,357円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	41,631,172円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	7,336,318円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	6,502,952円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	5,210,279円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	171,613,277円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	132,912,085円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	76,180,553円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	105,654,944円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	3,630,552円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	24,679,872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)	101,160,713円
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	1,369,036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18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	29.43	4,443,930.00	
		HALLIBURTON CO	167,000	32.97	5,505,990.00	
		SCHLUMBERGER LTD	258,000	41.11	10,606,380.00	
		CHENIERE ENERGY INC	44,200	115.88	5,121,896.00	
		CHEVRON CORP	357,400	133.61	47,752,214.00	
		CONOCOPHILLIPS	247,500	91.16	22,562,100.00	
		COTERRA ENERGY INC	145,000	22.79	3,304,550.00	
		DEVON ENERGY CORP	120,400	55.25	6,652,100.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	32,100	129.69	4,163,049.00	
		EOG RESOURCES INC	107,700	112.60	12,127,020.00	
		EXXON MOBIL CORP	782,500	78.23	61,214,975.00	
		HESS CORP	52,400	94.20	4,936,080.00	
		KINDER MORGAN INC	372,000	16.76	6,234,720.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	117,000	76.96	9,004,320.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	172,000	39.86	6,855,920.00	
		ONEOK INC	82,200	62.60	5,145,720.00	
		PHILLIPS 66	80,000	87.04	6,963,200.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	42,400	230.13	9,757,512.00	
		VALERO ENERGY CORP	75,900	87.04	6,606,336.00	
		WILLIAMS COS	225,000	29.69	6,680,250.00	
		AIR PRODUCTS	40,900	240.61	9,840,949.00	
		ALBEMARLE CORP	21,800	197.02	4,295,036.00	
		CELANESE CORP-SERIES A	20,900	152.93	3,196,237.00	
		CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	39,300	76.19	2,994,267.00	
		CORTEVA INC	134,000	51.27	6,870,180.00	
		DOW INC	136,700	61.17	8,361,939.00	
		DUPONT DE NEMOURS INC	96,900	79.73	7,725,837.00	
		EASTMAN CHEMICAL CO.	25,000	121.82	3,045,500.00	
		ECOLAB INC	47,100	178.38	8,401,698.00	
		FMC CORP	23,200	118.11	2,740,152.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	45,400	135.70	6,160,780.00			
LINDE PLC	95,400	298.97	28,521,738.00			

LYONDELLBASELL INDU-CL A	49,400	100.95	4,986,930.00
MOSAIC CO/THE	69,000	46.02	3,175,380.00
PPG INDUSTRIES	44,000	149.05	6,558,200.00
RPM INTERNATIONAL INC	23,500	86.20	2,025,700.00
SHERWIN-WILLIAMS	46,500	267.22	12,425,730.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	11,600	385.02	4,466,232.00
VULCAN MATERIALS CO	24,700	187.61	4,633,967.00
AMCOR PLC	286,000	11.79	3,371,940.00
AVERY DENNISON CORP	15,600	182.70	2,850,120.00
BALL CORP	59,700	90.92	5,427,924.00
CROWN HOLDINGS INC	24,700	121.63	3,004,261.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	67,500	46.12	3,113,100.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	17,700	148.53	2,628,981.00
SEALED AIR CORP	26,500	67.35	1,784,775.00
WESTROCK CO	47,300	46.51	2,199,923.00
FREEMONT-MCMORAN INC	271,000	43.21	11,709,910.00
NEWMONT CORP	147,700	67.75	10,006,675.00
NUCOR CORP	55,000	120.94	6,651,700.00
STEEL DYNAMICS	37,100	63.24	2,346,204.00
BOEING CO	102,900	213.58	21,977,382.00
GENERAL DYNAMICS	43,500	214.40	9,326,400.00
HEICO CORP	7,900	143.75	1,135,625.00
HEICO CORP-CLASS A	13,900	118.54	1,647,706.00
HOWMET AEROSPACE INC	72,000	34.98	2,518,560.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	7,500	184.92	1,386,900.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	37,500	221.00	8,287,500.00
LOCKHEED MARTIN	45,900	388.77	17,844,543.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	28,300	398.11	11,266,513.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	278,700	94.36	26,298,132.00
TEXTRON INC	40,700	70.11	2,853,477.00
TRANSDIGM GROUP INC	9,720	657.80	6,393,816.00
ALLEGION PLC	16,300	114.59	1,867,817.00
CARRIER GLOBAL CORP	153,000	44.58	6,820,740.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	25,600	89.37	2,287,872.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	131,600	65.82	8,661,912.00

PLC				
LENNOX INTERNATIONAL INC	6,400	252.74	1,617,536.00	
MASCO CORP	45,800	57.75	2,644,950.00	
OWENS CORNING INC	18,900	97.68	1,846,152.00	
SMITH (A.O.) CORP	24,700	71.05	1,754,935.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	44,000	151.43	6,662,920.00	
AMETEK INC	42,200	128.32	5,415,104.00	
EATON CORP PLC	73,500	152.40	11,201,400.00	
EMERSON ELEC	111,300	93.19	10,372,047.00	
GENERAC HOLDINGS INC	11,600	302.80	3,512,480.00	
PLUG POWER INC	94,000	23.15	2,176,100.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	21,100	266.46	5,622,306.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	28,300	57.68	1,632,344.00	
SUNRUN INC	29,200	23.13	675,396.00	
3M CORP	106,500	148.64	15,830,160.00	
GENERAL ELECTRIC CO	202,000	98.46	19,888,920.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	127,600	184.59	23,553,684.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	41,400	60.34	2,498,076.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	19,500	438.19	8,544,705.00	
CATERPILLAR INC DEL	101,600	194.74	19,785,584.00	
CUMMINS INC	26,700	218.69	5,839,023.00	
DEERE & COMPANY	54,200	380.53	20,624,726.00	
DOVER CORP	26,800	159.39	4,271,652.00	
FORTIVE CORP	61,700	63.37	3,909,929.00	
IDEX CORP	14,200	188.71	2,679,682.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	58,600	217.16	12,725,576.00	
INGERSOLL-RAND INC	76,400	53.31	4,072,884.00	
KORNIT DIGITAL LTD	8,200	94.22	772,604.00	
NORDSON CORP	9,600	228.88	2,197,248.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	75,300	76.22	5,739,366.00	
PACCAR	63,400	93.64	5,936,776.00	
PARKER HANNIFIN CORP	23,900	303.02	7,242,178.00	
PENTAIR PLC	30,000	57.62	1,728,600.00	
SNAP-ON INC	9,700	216.34	2,098,498.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	29,500	162.79	4,802,305.00	
WABTEC CORP	34,100	96.04	3,274,964.00	

XYLEM INC	33,800	89.81	3,035,578.00
FASTENAL CO	104,700	51.28	5,369,016.00
GRAINGER(W.W.) INC	8,300	471.37	3,912,371.00
UNITED RENTALS INC	13,500	314.21	4,241,835.00
CINTAS CORP	17,200	370.64	6,375,008.00
COPART INC	38,900	124.80	4,854,720.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	41,800	116.73	4,879,314.00
ROLLINS INC	41,000	31.19	1,278,790.00
WASTE CONNECTIONS INC	47,900	120.46	5,770,034.00
WASTE MANAGEMENT INC	77,700	143.06	11,115,762.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	24,300	90.85	2,207,655.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	30,600	106.06	3,245,436.00
FEDEX CORPORATION	46,700	224.37	10,478,079.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	134,600	210.71	28,361,566.00
DELTA AIR LINES INC	30,000	43.31	1,299,300.00
SOUTHWEST AIRLINES	29,000	46.38	1,345,020.00
AMERCO	1,720	590.11	1,014,989.20
CSX CORP	419,000	35.10	14,706,900.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	15,700	187.84	2,949,088.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	30,100	53.68	1,615,768.00
LYFT INC-A	46,900	42.90	2,012,010.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	45,900	273.23	12,541,257.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	18,100	289.74	5,244,294.00
UBER TECHNOLOGIES INC	229,000	35.71	8,177,590.00
UNION PAC CORP	120,500	250.99	30,244,295.00
APTIV PLC	50,200	143.13	7,185,126.00
BORGWARNER INC	45,000	44.62	2,007,900.00
LEAR CORP	10,900	172.40	1,879,160.00
FORD MOTOR COMPANY	730,000	17.54	12,804,200.00
GENERAL MOTORS CO	240,900	48.82	11,760,738.00
LUCID GROUP INC	72,100	28.11	2,026,731.00
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	30,800	64.74	1,993,992.00
TESLA INC	155,530	876.35	136,298,715.50
DR HORTON INC	63,300	82.75	5,238,075.00

GARMIN LTD	28,800	113.32	3,263,616.00
LENNAR CORP-A	50,600	89.33	4,520,098.00
MOHAWK INDUSTRIES	10,200	146.80	1,497,360.00
NEWELL BRANDS INC	66,000	25.92	1,710,720.00
NVR INC	607	5,001.33	3,035,807.31
PULTEGROUP INC	47,000	47.95	2,253,650.00
WHIRLPOOL CORP	11,300	204.93	2,315,709.00
HASBRO INC	23,400	99.08	2,318,472.00
PELOTON INTERACTIVE INC-A	52,000	30.59	1,590,680.00
LULULEMON ATHLETICA INC	22,000	310.03	6,820,660.00
NIKE INC-B	236,200	142.80	33,729,360.00
V F CORP	61,700	59.15	3,649,555.00
AIRBNB INC-CLASS A	43,700	183.60	8,023,320.00
ARAMARK	44,000	37.60	1,654,400.00
BOOKING HOLDINGS INC	7,560	2,623.95	19,837,062.00
CAESARS ENTERTAINMENT INC	39,700	81.92	3,252,224.00
CARNIVAL CORP	149,000	22.42	3,340,580.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	5,210	1,509.86	7,866,370.60
DARDEN RESTAURANTS INC	23,400	142.85	3,342,690.00
DOMINOS PIZZA INC	6,900	430.53	2,970,657.00
DRAFTKINGS INC - CL A	58,400	22.06	1,288,304.00
EXPEDIA GROUP INC	26,700	209.31	5,588,577.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	51,600	153.04	7,896,864.00
LAS VEGAS SANDS CORP	64,000	47.06	3,011,840.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	51,200	178.17	9,122,304.00
MCDONALD'S CORP	138,000	250.93	34,628,340.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	11.40	387,600.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	71,000	43.68	3,101,280.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	41,100	85.14	3,499,254.00
STARBUCKS CORP	217,900	93.05	20,275,595.00
VAIL RESORTS INC	7,400	266.29	1,970,546.00
WYNN RESORTS LTD	19,300	93.87	1,811,691.00
YUM BRANDS INC	54,300	123.48	6,704,964.00
GENUINE PARTS CO	26,600	127.61	3,394,426.00
LKQ CORP	52,600	47.64	2,505,864.00

POOL CORP	7,360	445.92	3,281,971.20
AMAZON.COM INC	84,240	3,093.05	260,558,532.00
CHEWY INC - CLASS A	15,100	45.66	689,466.00
DOORDASH INC-A	19,600	105.03	2,058,588.00
EBAY INC	120,500	55.76	6,719,080.00
ETSY INC	23,200	132.17	3,066,344.00
FIVERR INTERNATIONAL LTD	5,200	78.46	407,992.00
MERCADOLIBRE INC	8,190	1,021.07	8,362,563.30
WAYFAIR INC - CLASS A	13,100	130.80	1,713,480.00
DOLLAR GENERAL CORP	43,100	197.12	8,495,872.00
DOLLAR TREE INC	42,200	135.75	5,728,650.00
TARGET CORP	89,800	204.00	18,319,200.00
ADVANCE AUTO PARTS	12,000	220.41	2,644,920.00
AUTOZONE	3,950	1,893.11	7,477,784.50
BATH & BODY WORKS INC	50,400	52.16	2,628,864.00
BEST BUY COMPANY INC	40,700	98.63	4,014,241.00
BURLINGTON STORES INC	12,100	217.52	2,631,992.00
CARMAX INC	29,500	107.48	3,170,660.00
CARVANA CO	13,800	135.23	1,866,174.00
HOME DEPOT	195,100	347.94	67,883,094.00
LOWES COS INC	128,000	223.79	28,645,120.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	12,760	674.94	8,612,234.40
ROSS STORES INC	66,300	91.75	6,083,025.00
TJX COS INC	223,400	65.17	14,558,978.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	21,500	213.48	4,589,820.00
ULTA BEAUTY INC	9,400	369.12	3,469,728.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	81,710	515.01	42,081,467.10
KROGER CO	133,000	45.23	6,015,590.00
SYSCO CORP	95,600	84.26	8,055,256.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	134,000	46.81	6,272,540.00
WALMART INC	284,900	138.88	39,566,912.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	58,500	65.98	3,859,830.00
COCA COLA CO	758,500	62.12	47,118,020.00
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	39,300	55.76	2,191,368.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	31,200	218.87	6,828,744.00

KEURIG DR PEPPER INC	131,000	37.92	4,967,520.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	35,000	48.75	1,706,250.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	72,300	82.14	5,938,722.00	
PEPSICO INC	255,500	166.75	42,604,625.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	104,500	76.65	8,009,925.00	
BUNGE LIMITED	26,800	100.00	2,680,000.00	
CAMPBELL SOUP CO	36,000	44.19	1,590,840.00	
CONAGRA BRANDS INC	87,000	35.88	3,121,560.00	
GENERAL MILLS	113,300	67.79	7,680,607.00	
HERSHEY CO/THE	26,400	202.03	5,333,592.00	
HORMEL FOODS CORP	55,000	47.31	2,602,050.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	20,100	138.33	2,780,433.00	
KELLOGG CO	46,300	64.84	3,002,092.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	125,000	37.79	4,723,750.00	
MCCORMICK & CO INC.	45,700	98.08	4,482,256.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	259,600	66.06	17,149,176.00	
TYSON FOODS INC-CL A	54,900	93.21	5,117,229.00	
ALTRIA GROUP INC	339,500	51.37	17,440,115.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	288,100	111.90	32,238,390.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	45,000	96.95	4,362,750.00	
CLOROX CO	22,500	146.01	3,285,225.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	147,800	79.15	11,698,370.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	62,300	131.63	8,200,549.00	
PROCTER & GAMBLE CO	448,800	159.82	71,727,216.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	43,300	304.29	13,175,757.00	
ABBOTT LABORATORIES	327,700	120.58	39,514,066.00	
ABIOMED INC	8,700	307.11	2,671,857.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	13,780	501.76	6,914,252.80	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	93,300	82.80	7,725,240.00	
BECTON,DICKINSON	53,400	266.15	14,212,410.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	263,000	42.83	11,264,290.00	
DENTSPLY SIRONA INC	38,400	55.55	2,133,120.00	
DEXCOM INC	18,100	387.25	7,009,225.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	115,000	106.88	12,291,200.00	
HOLOGIC INC	46,100	69.88	3,221,468.00	

IDEXX LABORATORIES INC	15,880	493.35	7,834,398.00
INMODE LTD	8,800	42.50	374,000.00
INSULET CORP	12,500	240.81	3,010,125.00
INTUITIVE SURGICAL INC	66,300	284.08	18,834,504.00
MASIMO CORP	9,300	152.37	1,417,041.00
MEDTRONIC PLC	248,700	101.70	25,292,790.00
NOVOCURE LTD	16,400	78.63	1,289,532.00
RESMED INC	26,500	234.24	6,207,360.00
STERIS PLC	18,300	226.70	4,148,610.00
STRYKER CORP	62,500	251.58	15,723,750.00
TELEFLEX INC	8,700	317.99	2,766,513.00
THE COOPER COMPANIES, INC.	9,300	388.95	3,617,235.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	38,200	119.97	4,582,854.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	28,900	142.11	4,106,979.00
ANTHEM INC	44,900	451.34	20,265,166.00
CARDINAL HEALTH INC	55,300	54.51	3,014,403.00
CENTENE CORP	107,900	82.81	8,935,199.00
CIGNA CORP	63,200	227.11	14,353,352.00
CVS HEALTH CORP	243,900	102.30	24,950,970.00
DAVITA INC	12,500	117.32	1,466,500.00
HCA HEALTHCARE INC	47,700	250.80	11,963,160.00
HENRY SCHEIN INC	25,700	84.00	2,158,800.00
HUMANA INC	23,900	424.71	10,150,569.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	17,600	261.92	4,609,792.00
MCKESSON CORP	28,700	273.35	7,845,145.00
MOLINA HEALTHCARE INC	11,100	319.84	3,550,224.00
OAK STREET HEALTH INC	16,300	16.00	260,800.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	22,300	129.12	2,879,376.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	174,300	470.34	81,980,262.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	14,400	136.36	1,963,584.00
ABBVIE INC	326,600	144.97	47,347,202.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	21,600	149.95	3,238,920.00
AMGEN INC	105,000	221.68	23,276,400.00
BIOGEN INC	27,700	210.60	5,833,620.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	33,400	90.30	3,016,020.00

EXACT SCIENCES CORP	32,300	74.77	2,415,071.00	
GILEAD SCIENCES INC	230,900	61.29	14,151,861.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	38,600	94.36	3,642,296.00	
INCYTE CORP	33,700	67.83	2,285,871.00	
MODERNA INC	63,400	146.36	9,279,224.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	17,000	84.68	1,439,560.00	
NOVAVAX INC	13,000	83.44	1,084,720.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	19,560	626.72	12,258,643.20	
SEAGEN INC	25,800	124.16	3,203,328.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	48,300	232.77	11,242,791.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	410,700	67.39	27,677,073.00	
CATALENT INC	32,300	97.97	3,164,431.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	81,000	25.78	2,088,180.00	
ELI LILLY & CO.	150,300	240.97	36,217,791.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,600	140.90	1,493,540.00	
JOHNSON & JOHNSON	486,600	166.19	80,868,054.00	
MERCK & CO INC	467,900	76.36	35,728,844.00	
PFIZER INC	1,036,300	48.90	50,675,070.00	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	63,000	39.68	2,499,840.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	195,000	8.32	1,622,400.00	
VIATRIS INC	229,000	14.83	3,396,070.00	
ZOETIS INC	88,000	193.07	16,990,160.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,400,000	46.07	64,498,000.00	
CITIGROUP	374,600	64.71	24,240,366.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	78,800	53.09	4,183,492.00	
FIFTH THIRD BANCORP	127,000	48.19	6,120,130.00	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	2,250	766.02	1,723,545.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	32,500	172.62	5,610,150.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	271,000	15.87	4,300,770.00	
JPMORGAN CHASE & CO	552,300	151.43	83,634,789.00	
KEYCORP	178,000	25.73	4,579,940.00	
M & T BANK CORP	23,200	182.66	4,237,712.00	
PNC FINANCIAL	78,300	201.30	15,761,790.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	180,000	23.90	4,302,000.00	
SIGNATURE BANK	11,500	338.59	3,893,785.00	

SVB FINANCIAL GROUP	10,890	620.80	6,760,512.00	
TRUIST FINANCIAL CORP	245,900	62.55	15,381,045.00	
US BANCORP	259,500	57.13	14,825,235.00	
WEBSTER FINANCIAL CORP	33,000	60.18	1,985,940.00	
WELLS FARGO CO	759,000	56.15	42,617,850.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	66,500	65.23	4,337,795.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	245,000	313.55	76,819,750.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	69,000	33.22	2,292,180.00	
AFLAC INC	116,900	63.20	7,388,080.00	
ALLEGHANY CORP	2,590	680.36	1,762,132.40	
ALLSTATE CORP	54,800	122.64	6,720,672.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	13,900	135.62	1,885,118.00	
AMERICAN INTL GROUP	158,100	61.38	9,704,178.00	
AON PLC	42,000	281.04	11,803,680.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	75,000	46.97	3,522,750.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	38,000	153.50	5,833,000.00	
ASSURANT INC	10,200	166.02	1,693,404.00	
BROWN & BROWN INC	42,700	65.63	2,802,401.00	
CHUBB LTD	81,500	203.63	16,595,845.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	28,500	126.25	3,598,125.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	4,400	180.22	792,968.00	
EVEREST RE GROUP LTD	7,100	302.76	2,149,596.00	
FNF GROUP	50,000	47.23	2,361,500.00	
GLOBE LIFE INC	17,700	104.64	1,852,128.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	65,300	70.62	4,611,486.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	33,200	70.32	2,334,624.00	
LOEWS CORP	41,800	61.00	2,549,800.00	
MARKEL CORP	2,500	1,250.39	3,125,975.00	
MARSH & MCLENNAN COS	93,400	151.15	14,117,410.00	
METLIFE INC	135,800	69.81	9,480,198.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	50,700	72.82	3,691,974.00	
PROGRESSIVE CO	108,000	105.23	11,364,840.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	70,600	114.25	8,066,050.00	
TRAVELERS COS INC/THE	46,600	170.59	7,949,494.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	23,800	223.17	5,311,446.00	

WR BERKLEY CORP	26,600	89.76	2,387,616.00
ACCENTURE PLC-CL A	117,200	322.91	37,845,052.00
AFFIRM HOLDINGS INC	15,600	37.67	587,652.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	29,200	102.93	3,005,556.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	77,900	200.46	15,615,834.00
BLOCK INC	78,725	104.02	8,188,974.50
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	21,800	142.38	3,103,884.00
CLOUDFLARE INC - CLASS A	44,600	103.81	4,629,926.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	97,300	85.92	8,360,016.00
EPAM SYSTEMS INC	10,310	440.99	4,546,606.90
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	113,900	97.57	11,113,223.00
FISERV INC	110,000	94.33	10,376,300.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	14,200	235.39	3,342,538.00
GARTNER INC	15,300	286.50	4,383,450.00
GLOBAL PAYMENTS INC	54,900	137.81	7,565,769.00
GODADDY INC - CLASS A	32,300	83.05	2,682,515.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	165,700	124.97	20,707,529.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	13,900	170.35	2,367,865.00
MASTERCARD INC	162,800	373.70	60,838,360.00
MONGODB INC	10,510	409.56	4,304,475.60
OKTA INC	23,400	173.45	4,058,730.00
PAYCHEX INC	60,500	116.35	7,039,175.00
PAYPAL HOLDINGS INC	206,300	105.20	21,702,760.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	39,200	286.28	11,222,176.00
TWILIO INC - A	31,000	170.13	5,274,030.00
VERISIGN INC	18,500	208.37	3,854,845.00
VISA INC-CLASS A SHARES	311,900	224.61	70,055,859.00
WESTERN UNION CO	75,000	19.81	1,485,750.00
WIX.COM LTD	10,200	88.37	901,374.00
ADOBE INC	88,050	457.71	40,301,365.50
ANSYS INC	16,400	310.79	5,096,956.00
ASANA INC - CL A	11,900	67.18	799,442.00
AUTODESK INC.	41,000	223.39	9,158,990.00
AVALARA INC	15,300	96.57	1,477,521.00
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	33,000	37.82	1,248,060.00

BILL.COM HOLDINGS INC	14,200	232.04	3,294,968.00
BLACK KNIGHT INC	29,800	57.81	1,722,738.00
CADENCE DESIGN SYS INC	51,700	138.22	7,145,974.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	24,000	68.99	1,655,760.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	20,100	132.43	2,661,843.00
CITRIX SYSTEMS INC	23,800	101.67	2,419,746.00
COUPA SOFTWARE INC	14,200	119.59	1,698,178.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	34,800	169.85	5,910,780.00
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	7,100	146.42	1,039,582.00
DATADOG INC - CLASS A	35,000	165.81	5,803,350.00
DOCUSIGN INC	36,400	115.00	4,186,000.00
DROPBOX INC-CLASS A	57,000	23.58	1,344,060.00
DYNATRACE INC	33,000	41.76	1,378,080.00
FAIR ISAAC CORP	5,120	508.93	2,605,721.60
FORTINET INC	25,900	310.54	8,042,986.00
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	13,600	90.51	1,230,936.00
HUBSPOT INC	8,400	507.58	4,263,672.00
INTUIT INC	50,510	496.18	25,062,051.80
MICROSOFT CORP	1,319,500	290.73	383,618,235.00
NORTONLIFELOCK INC	110,000	28.19	3,100,900.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	56,700	55.18	3,128,706.00
ORACLE CORPORATION	309,600	75.53	23,384,088.00
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	286,000	11.77	3,366,220.00
PALO ALTO NETWORKS INC	17,800	499.14	8,884,692.00
PAYCOM SOFTWARE INC	9,600	327.72	3,146,112.00
PTC INC	20,300	109.54	2,223,662.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	14,500	156.31	2,266,495.00
SALESFORCE.COM INC	180,940	200.03	36,193,428.20
SERVICENOW INC	36,610	565.75	20,712,107.50
SPLUNK INC	30,400	117.54	3,573,216.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	42,700	74.69	3,189,263.00
SYNOPSYS INC	28,500	293.31	8,359,335.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	79,900	79.41	6,344,859.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	7,510	428.62	3,218,936.20

UNITY SOFTWARE INC	11,200	102.27	1,145,424.00
VMMWARE INC - CLASS A	38,000	124.40	4,727,200.00
WORKDAY INC-CLASS A	35,400	216.71	7,671,534.00
ZENDESK INC	22,600	116.65	2,636,290.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	40,600	129.38	5,252,828.00
ZSCALER INC	15,400	261.94	4,033,876.00
ARISTA NETWORKS INC	42,000	129.23	5,427,660.00
CISCO SYSTEMS	778,900	55.77	43,439,253.00
F5 INC	11,300	200.65	2,267,345.00
JUNIPER NETWORKS INC	60,000	34.38	2,062,800.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	31,600	215.91	6,822,756.00
APPLE INC	3,055,200	168.88	515,962,176.00
DELL TECHNOLOGIES-C	49,600	59.26	2,939,296.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	246,000	17.24	4,241,040.00
HP INC	224,000	36.42	8,158,080.00
NETAPP INC	40,300	91.07	3,670,121.00
SEAGATE TECHNOLOGY	38,400	111.19	4,269,696.00
WESTERN DIGITAL CORP	58,600	56.45	3,307,970.00
AMPHENOL CORP-CL A	109,600	75.48	8,272,608.00
ARROW ELECTRS INC	13,700	125.16	1,714,692.00
CDW CORPORATION	25,000	182.28	4,557,000.00
COGNEX CORP	33,600	61.65	2,071,440.00
CORNING INC	149,000	41.36	6,162,640.00
IPG PHOTONICS CORP	6,900	138.08	952,752.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	33,500	165.50	5,544,250.00
TE CONNECTIVITY LTD	60,000	144.30	8,658,000.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	8,600	419.98	3,611,828.00
TRIMBLE INC	47,300	68.06	3,219,238.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	9,750	423.50	4,129,125.00
ADVANCED MICRO DEVICES	303,648	112.37	34,120,925.76
ANALOG DEVICES INC	99,800	160.43	16,010,914.00
APPLIED MATERIALS	166,900	136.47	22,776,843.00
BROADCOM INC	75,830	579.00	43,905,570.00
ENPHASE ENERGY INC	23,200	148.37	3,442,184.00
ENTEGRIS INC	25,700	133.50	3,430,950.00

INTEL CORP	749,500	47.57	35,653,715.00
KLA CORP	28,400	366.05	10,395,820.00
LAM RESEARCH	26,380	580.61	15,316,491.80
MARVELL TECHNOLOGY INC	152,100	67.55	10,274,355.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	102,400	71.17	7,287,808.00
MICRON TECHNOLOGY	209,100	93.73	19,598,943.00
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	8,000	461.88	3,695,040.00
NVIDIA CORP	462,040	245.07	113,232,142.80
NXP SEMICONDUCTORS NV	48,500	187.61	9,099,085.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	78,000	60.19	4,694,820.00
QORVO INC	20,700	133.04	2,753,928.00
QUALCOMM INC	208,500	166.80	34,777,800.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	30,200	136.42	4,119,884.00
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	10,000	263.26	2,632,600.00
TERADYNE INC	30,200	116.00	3,503,200.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	170,600	164.65	28,089,290.00
AT & T INC	1,320,000	23.76	31,363,200.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	31,000	28.14	872,340.00
LIBERTY GLOBAL PLC-C	64,000	28.17	1,802,880.00
LUMEN TECHNOLOGIES INC	180,000	9.78	1,760,400.00
VERIZON COMMUNICATIONS	765,200	53.58	40,999,416.00
T-MOBILE US INC	115,100	124.55	14,335,705.00
ALLIANT ENERGY CORP	44,700	56.62	2,530,914.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	91,700	85.49	7,839,433.00
CONSTELLATION ENERGY	59,166	45.29	2,679,628.14
DUKE ENERGY CORP	141,800	98.73	13,999,914.00
EDISON INTERNATIONAL	69,600	60.25	4,193,400.00
ENTERGY CORP	37,600	104.95	3,946,120.00
EVERGY INC	42,900	61.05	2,619,045.00
EVERSOURCE ENERGY	64,400	82.28	5,298,832.00
EXELON CORPORATION	183,000	41.75	7,640,250.00
FIRSTENERGY CORP	99,000	41.12	4,070,880.00
NEXTERA ENERGY INC	362,600	75.38	27,332,788.00
NRG ENERGY INC	45,000	38.32	1,724,400.00
PG&E CORP	277,000	11.59	3,210,430.00

PPL CORPORATION	142,000	28.14	3,995,880.00
SOUTHERN CO.	196,900	64.79	12,757,151.00
XCEL ENERGY INC	99,800	66.10	6,596,780.00
ATMOS ENERGY CORP	24,400	106.66	2,602,504.00
UGI CORP	40,000	38.58	1,543,200.00
AMEREN CORPORATION	47,200	84.51	3,988,872.00
CENTERPOINT ENERGY INC	113,000	26.81	3,029,530.00
CMS ENERGY CORP	54,300	62.40	3,388,320.00
CONSOLIDATED EDISON INC	66,300	81.45	5,400,135.00
DOMINION ENERGY INC	150,500	79.14	11,910,570.00
DTE ENERGY COMPANY	36,200	118.55	4,291,510.00
NISOURCE INC	73,000	28.57	2,085,610.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	92,200	64.73	5,968,106.00
SEMPRA ENERGY	59,100	135.39	8,001,549.00
WEC ENERGY GROUP INC	58,100	89.39	5,193,559.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	33,100	148.06	4,900,786.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	44,000	45.93	2,020,920.00
ALLY FINANCIAL INC	67,000	49.34	3,305,780.00
AMERICAN EXPRESS CO	124,800	195.71	24,424,608.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	83,000	154.36	12,811,880.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	55,600	123.08	6,843,248.00
SOFI TECHNOLOGIES INC	92,000	12.18	1,120,560.00
SYNCHRONY FINANCIAL	103,800	43.66	4,531,908.00
UPSTART HOLDINGS INC	3,500	139.63	488,705.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	20,700	299.40	6,197,580.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	150,100	57.35	8,608,235.00
BLACKROCK INC	28,130	762.50	21,449,125.00
BLACKSTONE INC	127,400	122.63	15,623,062.00
CARLYLE GROUP INC/THE	29,000	45.58	1,321,820.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	19,500	118.43	2,309,385.00
CME GROUP INC	66,200	238.85	15,811,870.00
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	6,700	191.92	1,285,864.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,900	405.68	2,799,192.00
FRANKLIN RESOURCES INC	57,000	30.11	1,716,270.00
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	8,200	44.28	363,096.00

GOLDMAN SACHS GROUP	62,800	349.06	21,920,968.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	104,700	123.25	12,904,275.00
INVESCO LTD	65,000	22.39	1,455,350.00
KKR & CO INC-A	97,400	58.41	5,689,134.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	7,200	374.88	2,699,136.00
MOODYS CORP	31,000	323.14	10,017,340.00
MORGAN STANLEY	252,900	96.15	24,316,335.00
MSCI INC	15,390	531.48	8,179,477.20
NASDAQ INC	21,200	171.88	3,643,856.00
NORTHERN TRUST CORP	36,300	118.45	4,299,735.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	34,200	108.98	3,727,116.00
ROBINHOOD MARKETS INC -A	32,000	12.25	392,000.00
S&P GLOBAL INC	44,400	381.49	16,938,156.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	267,400	86.02	23,001,748.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	22,500	58.94	1,326,150.00
STATE STREET CORP	67,200	93.65	6,293,280.00
T ROWE PRICE GROUP INC	42,100	143.42	6,037,982.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	18,700	81.87	1,530,969.00
AES CORP	127,000	21.47	2,726,690.00
VISTRA CORP	80,000	21.49	1,719,200.00
CERNER CORP	54,500	91.71	4,998,195.00
TELADOC HEALTH INC	27,600	70.49	1,945,524.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	25,400	219.29	5,569,966.00
10X GENOMICS INC-CLASS A	14,400	80.99	1,166,256.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	56,600	130.25	7,372,150.00
AVANTOR INC	97,000	34.40	3,336,800.00
BIO TECHNE CORP	6,990	398.19	2,783,348.10
BIO-RAD LABORATORIES-A	3,980	588.23	2,341,155.40
CHARLES RIVER LABORATORIES	9,600	291.63	2,799,648.00
DANAHER CORP	118,800	269.27	31,989,276.00
ILLUMINA INC	27,300	317.84	8,677,032.00
IQVIA HOLDINGS INC	35,700	226.36	8,081,052.00
METTLER-TOLEDO INTL	4,250	1,417.12	6,022,760.00
PERKINELMER INC	21,200	177.82	3,769,784.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	72,710	540.54	39,302,663.40
	11,200	314.98	3,527,776.00

WATERS CORP				
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	13,500	387.30	5,228,550.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	24,800	73.87	1,831,976.00	
CLARIVATE PLC	65,000	15.92	1,034,800.00	
COSTAR GROUP INC	72,100	65.65	4,733,365.00	
EQUIFAX INC	22,400	212.00	4,748,800.00	
IHS MARKIT LTD	69,400	107.89	7,487,566.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	24,500	119.70	2,932,650.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	23,800	91.81	2,185,078.00	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	20,300	121.13	2,458,939.00	
TRUNSION	35,200	98.30	3,460,160.00	
VERISK ANALYTICS INC	28,500	190.30	5,423,550.00	
CBRE GROUP INC	62,300	99.80	6,217,540.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	220,000	5.71	1,256,200.00	
ZILLOW GROUP INC - A	9,800	62.23	609,854.00	
ZILLOW GROUP INC - C	29,600	62.68	1,855,328.00	
CABLE ONE INC	980	1,462.58	1,433,328.40	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	23,920	597.83	14,300,093.60	
COMCAST CORP-CL A	846,100	46.77	39,572,097.00	
DISCOVERY INC - A	31,000	29.87	925,970.00	
DISCOVERY INC - C	58,000	29.76	1,726,080.00	
DISH NETWORK CORP-A	43,400	29.88	1,296,792.00	
FOX CORP-CLASS A	58,000	42.91	2,488,780.00	
FOX CORP-CLASS B	25,400	38.66	981,964.00	
INTERPUBLIC GROUP	73,000	36.12	2,636,760.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-A	4,000	146.37	585,480.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	26,400	148.81	3,928,584.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	29,900	51.11	1,528,189.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	17,000	51.19	870,230.00	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	75,000	22.76	1,707,000.00	
OMNICOM GROUP	40,000	84.46	3,378,400.00	
PARAMOUNT GLOBAL	114,000	29.35	3,345,900.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	175,000	6.03	1,055,250.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	144,800	80.97	11,724,456.00	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	91,000	18.94	1,723,540.00	
	335,900	152.95	51,375,905.00	

	DISNEY (WALT) CO				
	ELECTRONIC ARTS	53,200	130.40	6,937,280.00	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	37,100	62.98	2,336,558.00	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	30,900	116.48	3,599,232.00	
	NETFLIX INC	81,820	386.67	31,637,339.40	
	ROKU INC	22,000	144.71	3,183,620.00	
	SEA LTD-ADR	24,800	137.65	3,413,720.00	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	21,900	162.13	3,550,647.00	
	ALPHABET INC-CL A	55,650	2,650.78	147,515,907.00	
	ALPHABET INC-CL C	53,260	2,646.17	140,935,014.20	
	IAC/INTERACTIVECORP	15,000	115.01	1,725,150.00	
	MATCH GROUP INC	48,000	111.88	5,370,240.00	
	META PLATFORMS INC	440,600	207.71	91,517,026.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	103,000	24.69	2,543,070.00	
	SNAP INC-A	198,000	39.45	7,811,100.00	
	TWITTER INC	149,000	35.43	5,279,070.00	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	40,100	53.30	2,137,330.00	
小計	銘柄数：607			7,106,145,507.51	
				(816,851,426,088)	
	組入時価比率：69.7%			72.5%	
カナダドル	CAMECO CORP	72,000	26.74	1,925,280.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	220,500	68.49	15,102,045.00	
	CENOVUS ENERGY INC	240,000	20.15	4,836,000.00	
	ENBRIDGE INC	373,000	52.75	19,675,750.00	
	IMPERIAL OIL	46,000	56.08	2,579,680.00	
	KEYERA CORP	41,000	30.36	1,244,760.00	
	PARKLAND CORP	28,000	34.11	955,080.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	102,000	42.31	4,315,620.00	
	SUNCOR ENERGY INC	272,000	37.68	10,248,960.00	
	TC ENERGY CORP	183,000	66.60	12,187,800.00	
	TOURMALINE OIL CORP	55,000	46.60	2,563,000.00	
	NUTRIEN LTD	105,700	98.03	10,361,771.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	28,200	63.96	1,803,672.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	82,688	71.35	5,899,788.80	
	BARRICK GOLD	325,000	29.53	9,597,250.00	

FIRST QUANTUM MINERALS LTD	111,000	34.40	3,818,400.00
FRANCO-NEVADA CORP	35,300	189.95	6,705,235.00
IVANHOE MINES LTD-CL A	103,000	11.46	1,180,380.00
KINROSS GOLD CORP	217,000	7.38	1,601,460.00
LUNDIN MINING CORP	118,000	12.07	1,424,260.00
PAN AMERICAN SILVER CORP	35,300	31.26	1,103,478.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	87,000	45.71	3,976,770.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	85,000	56.03	4,762,550.00
WEST FRASER TIMBER	17,800	123.63	2,200,614.00
CAE INC	60,000	32.78	1,966,800.00
WSP GLOBAL INC	21,400	155.90	3,336,260.00
BALLARD POWER SYSTEMS INC	37,000	12.66	468,420.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	15,000	110.70	1,660,500.00
GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	30,000	36.68	1,100,400.00
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	21,100	72.88	1,537,768.00
AIR CANADA	32,000	24.63	788,160.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	130,400	160.33	20,907,032.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	172,900	93.24	16,121,196.00
TFI INTERNATIONAL INC	14,900	131.93	1,965,757.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	52,800	99.37	5,246,736.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	37,000	49.45	1,829,650.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	52,400	72.42	3,794,808.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	10,200	188.68	1,924,536.00
DOLLARAMA INC	52,000	64.17	3,336,840.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	152,000	50.80	7,721,600.00
EMPIRE CO LTD A	32,000	39.27	1,256,640.00
LOBLAW COMPANIES	31,400	98.82	3,102,948.00
METRO INC	46,700	67.38	3,146,646.00
WESTON(GEORGE)LTD	14,100	138.48	1,952,568.00
SAPUTO INC	50,000	30.87	1,543,500.00
BAUSCH HEALTH COS INC	58,000	31.38	1,820,040.00
CANOPY GROWTH CORP	35,000	10.35	362,250.00
BANK OF MONTREAL	119,200	146.95	17,516,440.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	225,700	92.02	20,768,914.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF	83,100	160.78	13,360,818.00

COMMERCE				
NATIONAL BANK OF CANADA	63,400	100.65	6,381,210.00	
ROYAL BANK OF CANADA	263,700	141.46	37,303,002.00	
TORONTO DOMINION BANK	337,400	106.59	35,963,466.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,640	648.32	3,008,204.80	
GREAT-WEST LIFECO INC	50,000	39.28	1,964,000.00	
IA FINANCIAL CORP INC	21,100	80.62	1,701,082.00	
INTACT FINANCIAL CORP	32,900	183.47	6,036,163.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	360,000	26.98	9,712,800.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	103,000	40.89	4,211,670.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	106,900	68.30	7,301,270.00	
CGI INC	39,800	105.72	4,207,656.00	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	10,700	71.65	766,655.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	20,840	837.09	17,444,955.60	
BLACKBERRY LTD	94,000	8.70	817,800.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,670	2,046.84	7,511,902.80	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	19,400	35.58	690,252.00	
OPEN TEXT CORP	51,000	54.90	2,799,900.00	
BCE INC	14,400	66.77	961,488.00	
TELUS CORP	78,600	31.92	2,508,912.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	67,000	67.27	4,507,090.00	
EMERA INC	47,000	58.70	2,758,900.00	
FORTIS INC	89,000	57.83	5,146,870.00	
HYDRO ONE LTD	63,000	31.44	1,980,720.00	
ALTAGAS LTD	52,000	27.78	1,444,560.00	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	126,000	17.81	2,244,060.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	27,000	35.07	946,890.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	262,300	69.33	18,185,259.00	
IGM FINANCIAL INC	15,000	45.42	681,300.00	
ONEX CORPORATION	13,200	87.87	1,159,884.00	
TMX GROUP LTD	9,500	127.30	1,209,350.00	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	24,000	44.43	1,066,320.00	
NORTHLAND POWER INC	40,000	37.27	1,490,800.00	
THOMSON REUTERS CORP	32,600	127.96	4,171,496.00	
FIRSTSERVICE CORP	7,200	178.82	1,287,504.00	
	34,000	30.54	1,038,360.00	

	QUEBECOR INC-CL B			
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	84,000	37.39	3,140,760.00
小計	銘柄数：86			472,359,343.00 (42,706,008,200)
	組入時価比率：3.6%			3.8%
ユ-口	TENARIS SA	88,000	11.52	1,013,760.00
	ENI SPA	472,000	13.33	6,293,648.00
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	96,000	9.99	959,040.00
	NESTE OYJ	78,000	36.92	2,879,760.00
	OMV AG	28,100	56.00	1,573,600.00
	REPSOL SA	274,000	11.87	3,252,380.00
	TOTALENERGIES SE	464,400	50.65	23,521,860.00
	AIR LIQUIDE SA	88,000	150.32	13,228,160.00
	AKZO NOBEL	34,500	91.78	3,166,410.00
	ARKEMA	11,600	128.25	1,487,700.00
	BASF SE	169,400	67.85	11,493,790.00
	COVESTRO AG	34,400	54.10	1,861,040.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	39,000	29.38	1,145,820.00
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	15,000	37.86	567,900.00
	KONINKLIJKE DSM NV	32,100	163.35	5,243,535.00
	LANXESS	15,500	53.00	821,500.00
	SOLVAY SA	14,200	109.75	1,558,450.00
	SYMRISE AG	23,700	104.65	2,480,205.00
	UMICORE	34,300	36.59	1,255,037.00
	CRH PLC	146,000	43.70	6,380,200.00
	HEIDELBERGCEMENT AG	27,400	66.18	1,813,332.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	46,200	48.16	2,224,992.00
	ARCELORMITTAL	127,000	27.04	3,434,080.00
	VOESTALPINE AG	20,000	31.10	622,000.00
	STORA ENSO OYJ-R	108,000	18.32	1,978,560.00
	UPM-KYMMENE OYJ	97,000	33.07	3,207,790.00
	AIRBUS SE	108,600	116.32	12,632,352.00
	DASSAULT AVIATION SA	5,000	116.90	584,500.00
	MTU AERO ENGINES AG	10,100	207.50	2,095,750.00
	SAFRAN SA	62,700	114.36	7,170,372.00
	THALES SA	20,600	84.36	1,737,816.00

COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	93,900	61.81	5,803,959.00
KINGSPAN GROUP PLC	27,800	91.40	2,540,920.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	46,168	22.43	1,035,548.24
BOUYGUES	40,000	32.43	1,297,200.00
EIFFAGE SA	15,900	97.94	1,557,246.00
FERROVIAL SA	88,000	25.29	2,225,520.00
VINCI	99,300	102.18	10,146,474.00
LEGRAND SA	48,800	86.34	4,213,392.00
PRYSMIAN SPA	48,000	29.26	1,404,480.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	100,400	146.40	14,698,560.00
SIEMENS ENERGY AG	73,000	18.96	1,384,445.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	45,000	17.00	765,000.00
SIEMENS AG	141,900	139.50	19,795,050.00
ALSTOM	61,000	25.84	1,576,240.00
CNH INDUSTRIAL NV	193,000	14.10	2,721,300.00
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	75,900	31.50	2,390,850.00
GEA GROUP AG	29,000	41.26	1,196,540.00
KION GROUP AG	13,100	79.86	1,046,166.00
KNORR-BREMSE AG	12,700	91.30	1,159,510.00
KONE OYJ	63,500	54.10	3,435,350.00
RATIONAL AG	1,050	682.00	716,100.00
WARTSILA OYJ	82,000	10.28	842,960.00
BRENTAG SE	29,000	78.68	2,281,720.00
IMCD NV	10,200	141.60	1,444,320.00
DEUTSCHE POST AG-REG	184,600	49.95	9,221,693.00
INPOST SA	34,000	5.93	201,722.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	112,000	7.67	859,264.00
ADP	6,100	139.80	852,780.00
AENA SME SA	14,400	154.35	2,222,640.00
ATLANTIA SPA	89,000	16.79	1,494,755.00
GETLINK	83,000	14.41	1,196,445.00
CONTINENTAL AG	20,600	90.23	1,858,738.00
FAURECIA	20,688	41.04	849,035.52
MICHELIN (CGDE)	31,200	139.25	4,344,600.00
VALEO SA	44,000	26.62	1,171,280.00

BAYER MOTOREN WERK	62,000	95.97	5,950,140.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,200	80.80	824,160.00
FERRARI NV	23,200	196.75	4,564,600.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	157,800	76.06	12,002,268.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	27,300	86.96	2,374,008.00
RENAULT SA	33,700	36.34	1,224,658.00
STELLANTIS NV	373,000	16.85	6,285,050.00
VOLKSWAGEN AG	5,800	250.00	1,450,000.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	34,400	184.00	6,329,600.00
SEB SA	5,400	135.40	731,160.00
ADIDAS AG	35,200	230.55	8,115,360.00
ESSILORLUXOTTICA	53,000	166.24	8,810,720.00
HERMES INTERNATIONAL	5,800	1,255.00	7,279,000.00
KERING SA	13,850	663.90	9,195,015.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	51,310	684.10	35,101,171.00
MONCLER SPA	37,600	55.64	2,092,064.00
PUMA SE	18,900	90.36	1,707,804.00
ACCOR SA	32,000	33.47	1,071,040.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	31,100	131.95	4,103,645.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	15,400	37.85	582,890.00
SODEXO	15,900	79.84	1,269,456.00
DELIVERY HERO SE	29,000	51.24	1,485,960.00
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	32,900	38.68	1,272,736.50
PROSUS NV	172,000	66.94	11,513,680.00
ZALANDO SE	40,200	62.50	2,512,500.00
INDITEX SA	199,000	25.46	5,066,540.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	119,000	18.01	2,143,785.00
COLRUYT SA	8,700	36.24	315,288.00
HELLOFRESH SE	31,800	50.62	1,609,716.00
JERONIMO MARTINS	55,000	20.07	1,103,850.00
KESKO OYJ-B SHS	50,000	26.81	1,340,500.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	194,000	26.72	5,183,680.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	142,200	55.87	7,944,714.00
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	91,000	10.49	955,045.00
HEINEKEN HOLDING NV	22,000	79.25	1,743,500.00

HEINEKEN NV	47,700	98.46	4,696,542.00
PERNOD RICARD SA	39,100	193.20	7,554,120.00
REMY COINTREAU	3,900	176.80	689,520.00
DANONE	121,000	55.44	6,708,240.00
JDE PEET'S BV	21,000	26.95	565,950.00
KERRY GROUP PLC-A	29,300	110.00	3,223,000.00
HENKEL AG & CO KGAA	20,300	71.30	1,447,390.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	33,200	73.92	2,454,144.00
BEIERSDORF AG	17,900	90.32	1,616,728.00
LOREAL-ORD	46,200	356.60	16,474,920.00
BIOMERIEUX	6,900	102.15	704,835.00
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	7,200	136.75	984,600.00
DIASORIN SPA	4,800	120.75	579,600.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	168,000	29.82	5,009,760.00
SARTORIUS AG-VORZUG	4,720	411.70	1,943,224.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	50,700	54.24	2,749,968.00
AMPLIFON SPA	24,000	35.68	856,320.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	36,600	59.20	2,166,720.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	78,000	37.07	2,891,850.00
ORPEA	9,300	38.21	355,353.00
ARGENX SE	8,300	255.90	2,123,970.00
GRIFOLS SA	54,000	14.47	781,650.00
BAYER AG-REG	182,900	54.08	9,891,232.00
IPSEN	7,300	100.10	730,730.00
MERCK KGAA	24,300	181.00	4,398,300.00
ORION OYJ	21,000	36.47	765,870.00
RECORDATI SPA	19,900	45.81	911,619.00
SANOFI	211,000	93.63	19,755,930.00
UCB SA	22,700	86.56	1,964,912.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	82,000	12.84	1,053,536.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,245,000	5.74	7,156,260.00
BANCO SANTANDER SA	3,200,000	3.34	10,688,000.00
BNP PARIBAS	207,200	62.02	12,850,544.00
CAIXABANK	830,000	3.23	2,684,220.00
COMMERZBANK AG	188,000	8.85	1,664,364.00

CREDIT AGRICOLE SA	226,000	13.14	2,970,544.00
ERSTE GROUP BANK AG	65,000	40.94	2,661,100.00
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	111,000	15.82	1,756,020.00
ING GROEP NV	727,000	12.72	9,253,256.00
INTESA SANPAOLO	3,080,000	2.73	8,436,120.00
KBC GROEP NV	46,000	74.90	3,445,400.00
MEDIOBANCA S.P.A.	107,000	10.13	1,084,445.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	29,000	25.00	725,000.00
SOCIETE GENERALE	151,000	32.99	4,981,490.00
UNICREDIT SPA	389,000	14.68	5,710,520.00
EURAZEO SE	7,800	71.55	558,090.00
EXOR NV	19,500	72.84	1,420,380.00
GROUPE BRUXELLES LAM	21,400	93.76	2,006,464.00
SOFINA SA	2,900	344.20	998,180.00
WENDEL	4,300	92.50	397,750.00
AEGON NV	329,000	4.83	1,589,728.00
AGEAS	32,000	43.45	1,390,400.00
ALLIANZ SE-REG	75,900	222.50	16,887,750.00
ASSICURAZIONI GENERALI	208,000	18.61	3,870,880.00
AXA SA	357,000	27.19	9,706,830.00
CNP ASSURANCES	28,000	21.79	610,120.00
HANNOVER RUECK SE	10,900	174.60	1,903,140.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	25,900	263.50	6,824,650.00
NN GROUP NV	49,400	50.68	2,503,592.00
POSTE ITALIANE SPA	103,000	11.13	1,146,905.00
SAMPO OYJ-A SHS	91,000	43.62	3,969,420.00
ADYEN NV	3,700	1,925.00	7,122,500.00
AMADEUS IT GROUP SA	82,900	61.92	5,133,168.00
BECHTLE AG	15,700	47.04	738,528.00
CAPGEMINI SA	30,000	185.70	5,571,000.00
EDENRED	47,000	38.72	1,819,840.00
NEXI SPA	89,000	12.59	1,120,510.00
WORLDLINE SA	44,800	44.65	2,000,320.00
DASSAULT SYSTEMES SE	125,000	41.57	5,196,250.00
NEMETSCHKE SE	11,000	77.76	855,360.00

SAP SE	193,700	105.26	20,388,862.00
NOKIA OYJ	1,002,000	5.09	5,102,184.00
ASM INTERNATIONAL NV	8,400	288.00	2,419,200.00
ASML HOLDING NV	76,390	578.20	44,168,698.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	244,000	32.33	7,888,520.00
STMICROELECTRONICS NV	128,000	39.13	5,008,640.00
CELLNEX TELECOM SA	95,000	39.10	3,714,500.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	615,000	17.23	10,600,140.00
ELISA OYJ	25,700	50.68	1,302,476.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	55,000	8.87	488,070.00
KONINKLIJKE KPN NV	610,000	3.08	1,879,410.00
ORANGE SA	367,000	10.93	4,012,778.00
PROXIMUS	26,000	18.06	469,560.00
TELECOM ITALIA SPA	1,930,000	0.41	793,809.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	210,000	2.64	556,080.00
TELEFONICA SA	990,000	4.36	4,317,885.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	34.56	580,608.00
ELECTRICITE DE FRANCE	79,000	8.33	658,544.00
ELIA GROUP SA/NV	6,200	117.30	727,260.00
ENDESA S.A.	57,000	18.77	1,069,890.00
ENEL SPA	1,501,000	6.48	9,729,482.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	509,000	4.18	2,131,183.00
FORTUM OYJ	79,000	23.19	1,832,010.00
IBERDROLA SA	1,075,133	9.40	10,114,851.26
RED ELECTRICA CORPORACION SA	79,000	16.91	1,336,285.00
TERNA SPA	251,000	6.73	1,689,732.00
VERBUND AG	12,700	96.10	1,220,470.00
ENAGAS SA	48,000	18.44	885,120.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	34,000	24.32	826,880.00
SNAM SPA	384,000	4.80	1,845,504.00
E.ON SE	410,000	12.14	4,977,400.00
ENGIE	337,000	14.40	4,854,148.00
RWE AG	119,000	38.60	4,593,400.00
VEOLIA ENVIRONNEMENT	119,000	32.33	3,847,270.00
AMUNDI SA	10,000	67.50	675,000.00

	DEUTSCHE BANK AG-REG	387,000	13.69	5,298,030.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG	34,700	157.75	5,473,925.00	
	EURONEXT NV	15,300	81.85	1,252,305.00	
	EDP RENOVAVEIS SA	49,000	18.61	911,890.00	
	UNIPER SE	15,100	39.00	588,900.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	25,500	86.50	2,205,750.00	
	QIAGEN N.V.	44,000	43.34	1,906,960.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,950	353.00	1,747,350.00	
	BUREAU VERITAS SA	54,000	24.58	1,327,320.00	
	RANDSTAD NV	21,400	64.94	1,389,716.00	
	TELEPERFORMANCE	10,800	315.00	3,402,000.00	
	WOLTERS KLUWER	50,300	86.96	4,374,088.00	
	AROUNDTOWN SA	173,000	5.60	969,146.00	
	LEG IMMOBILIEN SE	14,000	114.30	1,600,200.00	
	VONOVIA SE	135,400	47.00	6,363,800.00	
	PUBLICIS GROUPE	43,300	62.66	2,713,178.00	
	VIVENDI SE	145,000	11.52	1,670,400.00	
	BOLLORE	168,000	4.86	817,152.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	17,300	44.08	762,584.00	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	135,000	20.35	2,747,925.00	
	SCOUT24 SE	15,200	52.14	792,528.00	
小計	銘柄数：227			885,373,012.52	
				(115,603,154,244)	
	組入時価比率：9.9%			10.2%	
英ボンド	BP PLC	3,734,000	3.97	14,857,586.00	
	SHELL PLC-NEW	1,423,000	19.69	28,024,562.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	26,300	72.54	1,907,802.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	34,800	17.72	616,830.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	239,000	35.23	8,419,970.00	
	ANTOFAGASTA PLC	70,000	13.73	961,100.00	
	GLENCORE PLC	1,861,000	4.20	7,829,227.00	
	RIO TINTO PLC-REG	206,900	55.88	11,561,572.00	
	MONDI PLC	91,000	19.09	1,737,190.00	
	BAE SYSTEMS PLC	599,000	5.94	3,560,456.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,520,000	1.18	1,793,904.00	

DCC PLC	18,400	62.00	1,140,800.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	765,000	1.55	1,189,957.50
SMITHS GROUP PLC	71,000	15.11	1,073,165.00
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	14,100	118.80	1,675,080.00
ASHTED GROUP PLC	83,200	49.19	4,092,608.00
BUNZLE	61,000	27.40	1,671,400.00
FERGUSON PLC	40,500	111.05	4,497,525.00
RENTOKIL INTIAL PLC	345,000	4.99	1,723,965.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	181,000	6.02	1,090,706.00
PERSIMMON PLC	58,000	24.08	1,396,640.00
TAYLOR WIMPEY PLC	710,000	1.48	1,056,125.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	20,871	39.76	829,830.96
BURBERRY GROUP PLC	73,000	19.94	1,455,620.00
COMPASS GROUP PLC	333,000	17.51	5,830,830.00
ENTAIN PLC	110,000	16.99	1,868,900.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	32,500	50.80	1,651,000.00
WHITBREAD PLC	36,300	31.43	1,140,909.00
NEXT PLC	23,800	69.18	1,646,484.00
JD SPORTS FASHION PLC	465,000	1.65	767,250.00
KINGFISHER PLC	390,000	3.18	1,243,710.00
OCADO GROUP PLC	92,000	13.60	1,251,660.00
SAINSBURY	340,000	2.78	945,880.00
TESCO PLC	1,420,000	2.93	4,170,540.00
COCA-COLA HBC AG-DI	39,000	24.31	948,090.00
DIAGEO PLC	432,000	36.16	15,621,120.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	68,000	18.99	1,291,320.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	405,000	34.35	13,913,775.00
IMPERIAL BRANDS PLC	172,000	17.53	3,016,020.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	133,000	61.52	8,182,160.00
UNILEVER PLC	479,600	37.99	18,222,402.00
SMITH & NEPHEW PLC	160,000	12.08	1,933,600.00
NMC HEALTH PLC	13,300	0.02	266.00
ASTRAZENECA PLC	286,280	89.18	25,530,450.40
GLAXOSMITHKLINE PLC	934,000	15.79	14,753,464.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	29,600	19.89	588,892.00

BARCLAYS PLC	3,100,000	1.92	5,971,840.00	
HSBC HOLDINGS PLC	3,775,000	5.40	20,388,775.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	12,990,000	0.51	6,662,571.00	
NATWEST GROUP PLC	1,070,000	2.40	2,571,210.00	
STANDARD CHARTERED PLC	479,000	5.58	2,672,820.00	
M&G PLC	500,000	2.13	1,067,000.00	
ADMIRAL GROUP PLC	35,000	29.93	1,047,550.00	
AVIVA PLC	737,000	4.32	3,186,051.00	
LEGAL & GENERAL	1,080,000	2.72	2,944,080.00	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	122,000	6.52	795,440.00	
PRUDENTIAL PLC	488,000	11.83	5,775,480.00	
AVEVA GROUP PLC	19,911	26.90	535,605.90	
SAGE GROUP PLC (THE)	197,000	6.85	1,349,844.00	
HALMA PLC	70,000	23.15	1,620,500.00	
BT GROUP PLC	1,620,000	1.95	3,161,430.00	
VODAFONE GROUP PLC	5,120,000	1.37	7,063,552.00	
SSE PLC	195,000	16.05	3,130,725.00	
NATIONAL GRID PLC	668,000	10.78	7,205,048.00	
SEVERN TRENT PLC	48,000	28.29	1,357,920.00	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	122,000	10.50	1,281,610.00	
3I GROUP PLC	178,000	13.20	2,350,490.00	
ABRDN PLC	420,000	2.31	973,140.00	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	65,000	12.88	837,200.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	60,500	67.54	4,086,170.00	
SCHRODERS PLC	24,000	32.16	771,840.00	
ST JAMES S PLACE PLC	104,000	15.16	1,576,640.00	
EXPERIAN PLC	172,000	28.91	4,972,520.00	
INTERTEK GROUP PLC	31,000	51.94	1,610,140.00	
RELX PLC	357,000	22.41	8,000,370.00	
INFORMA PLC	275,000	6.09	1,674,750.00	
PEARSON	148,000	6.23	922,336.00	
WPP PLC	218,000	11.92	2,599,650.00	
AUTO TRADER GROUP PLC	171,000	6.34	1,084,140.00	
小計銘柄数：79			339,930,781.76	
			(53,171,972,882)	

	組入時価比率：4.5%			4.7%
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	41,000	17.04	698,640.00
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,370	938.50	1,285,745.00
	GIVAUDAN-REG	1,690	3,681.00	6,220,890.00
	SIKA AG-REG	26,400	302.80	7,993,920.00
	HOLCIM LTD	96,500	50.70	4,892,550.00
	GEBERIT AG-REG	6,580	607.40	3,996,692.00
	ABB LTD	303,000	32.00	9,696,000.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,700	206.00	762,200.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,400	210.50	1,557,700.00
	VAT GROUP AG	4,810	346.60	1,667,146.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	10,100	252.30	2,548,230.00
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	97,100	130.40	12,661,840.00
	THE SWATCH GROUP AG-B	5,500	286.80	1,577,400.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10,500	55.40	581,700.00
	BARRY CALLEBAUT AG	630	2,106.00	1,326,780.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	195	10,060.00	1,961,700.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	20	104,100.00	2,082,000.00
	NESTLE SA-REG	520,300	117.38	61,072,814.00
	ALCON INC	92,600	71.34	6,606,084.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	10,300	328.50	3,383,550.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,900	1,468.00	2,789,200.00
	NOVARTIS AG-REG	405,000	79.98	32,391,900.00
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	129,900	345.00	44,815,500.00
	ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	5,800	374.00	2,169,200.00
	VIFOR PHARMA AG	9,100	162.05	1,474,655.00
	BALOISE HOLDING AG	8,600	158.40	1,362,240.00
	SWISS LIFE HOLDING AG	5,710	590.60	3,372,326.00
	SWISS RE LTD	55,100	98.12	5,406,412.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	28,000	434.80	12,174,400.00
	TEMENOS AG-REG	12,000	101.15	1,213,800.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	31,600	68.30	2,158,280.00
	SWISSCOM AG-REG	4,850	545.20	2,644,220.00
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	481,000	8.36	4,023,084.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	42,200	58.68	2,476,296.00	

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	4,140	1,256.50	5,201,910.00	
	UBS GROUP AG	649,000	18.74	12,162,260.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,100	511.00	562,100.00	
	LONZA AG-REG	13,890	613.80	8,525,682.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	28,100	47.05	1,322,105.00	
	SGS SA-REG	1,140	2,603.00	2,967,420.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	13,500	89.15	1,203,525.00	
小計	銘柄数：41			282,990,096.00	
				(35,345,462,990)	
	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	331.40	12,261,800.00	
	BOLIDEN AB	49,000	402.00	19,698,000.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B	112,000	163.85	18,351,200.00	
	ASSA ABLOY AB-B	183,000	268.50	49,135,500.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	273,000	83.40	22,768,200.00	
	SKANSKA AB-B SHS	66,000	238.90	15,767,400.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	26,000	269.90	7,017,400.00	
	LIFCO AB-B SHS	42,000	206.90	8,689,800.00	
	ALFA LAVAL AB	57,000	292.80	16,689,600.00	
	ATLAS COPCO AB-A	123,100	502.60	61,870,060.00	
	ATLAS COPCO AB-B	73,100	443.90	32,449,090.00	
	EPIROC AB - A	121,000	192.10	23,244,100.00	
	EPIROC AB - B	69,000	165.50	11,419,500.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	73,000	119.75	8,741,750.00	
	SANDVIK AB	210,000	238.80	50,148,000.00	
	SKF AB-B SHARES	68,000	184.35	12,535,800.00	
	VOLVO AB-A SHS	40,000	213.40	8,536,000.00	
	VOLVO AB-B SHS	269,000	209.35	56,315,150.00	
	SECURITAS AB-B SHS	54,000	116.90	6,312,600.00	
	ELECTROLUX AB-B	41,000	181.30	7,433,300.00	
	EVOLUTION AB	31,400	1,047.20	32,882,080.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	133,000	176.58	23,485,140.00	
	SWEDISH MATCH AB	285,000	72.02	20,525,700.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	116,000	264.20	30,647,200.00	
	GETINGE AB-B SHS	41,000	360.60	14,784,600.00	

	NORDEA BANK ABP	607,000	107.70	65,373,900.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	299,000	119.20	35,640,800.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	266,000	95.58	25,424,280.00	
	SWEDBANK AB	170,000	167.54	28,481,800.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	24,092	288.20	6,943,314.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	32,000	282.80	9,049,600.00	
	INVESTOR AB-A SHS	96,000	211.40	20,294,400.00	
	INVESTOR AB-B SHS	334,000	196.54	65,644,360.00	
	KINNEVIK AB - B	44,000	246.90	10,863,600.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	15,500	472.60	7,325,300.00	
	SINCH AB	92,000	76.16	7,006,720.00	
	ERICSSON LM-B	547,000	98.21	53,720,870.00	
	HEXAGON AB-B SHS	363,000	125.00	45,375,000.00	
	TELIA CO AB	480,000	37.40	17,954,400.00	
	TELE 2 AB-B SHS	92,000	131.45	12,093,400.00	
	EQT AB	53,000	334.40	17,723,200.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	18,700	598.20	11,186,340.00	
	SAGAX AB-B	29,000	262.40	7,609,600.00	
	EMBRACER GROUP AB	110,000	78.76	8,663,600.00	
小計	銘柄数：44			1,028,083,454.40	
				(12,645,426,489)	
	組入時価比率：1.1%				1.1%
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	22,000	262.90	5,783,800.00	
	EQUINOR ASA	179,000	267.25	47,837,750.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,600	444.90	13,169,040.00	
	NORSK HYDRO	246,000	76.96	18,932,160.00	
	MOWI ASA	84,000	232.80	19,555,200.00	
	ORKLA ASA	133,000	83.00	11,039,000.00	
	DNB BANK ASA	174,000	208.80	36,331,200.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	40,000	213.40	8,536,000.00	
	TELENOR ASA	129,000	136.75	17,640,750.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	18,100	205.20	3,714,120.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	14,400	231.40	3,332,160.00	
	ADEVINTA ASA	45,000	84.20	3,789,000.00	
小計	銘柄数：12			189,660,180.00	

				(2,444,719,720)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	20,400	486.30	9,920,520.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	37,600	397.20	14,934,720.00	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S-B SHS	1,700	2,687.00	4,567,900.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	184,000	170.95	31,454,800.00	
	DSV A/S	37,800	1,236.50	46,739,700.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	560	22,240.00	12,454,400.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,090	23,370.00	25,473,300.00	
	PANDORA A/S	17,700	726.60	12,860,820.00	
	CARLSBERG B	18,000	1,070.00	19,260,000.00	
	AMBU A/S-B	29,000	113.60	3,294,400.00	
	COLOPLAST-B	22,100	927.80	20,504,380.00	
	DEMANT A/S	20,100	274.90	5,525,490.00	
	GN STORE NORD A/S	24,100	351.30	8,466,330.00	
	GENMAB A/S	12,000	2,157.00	25,884,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	311,200	672.90	209,406,480.00	
	DANSKE BANK AS	132,000	126.45	16,691,400.00	
	TRYG A/S	68,000	152.50	10,370,000.00	
	ORSTED A/S	35,100	671.00	23,552,100.00	
小計	銘柄数：18			501,360,740.00	
				(8,798,880,987)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
豪ドル	AMPOL LTD	40,000	32.13	1,285,200.00	
	SANTOS LTD.	610,000	7.07	4,312,700.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	38,000	25.80	980,400.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	174,000	27.72	4,823,280.00	
	ORICA LTD	79,000	14.96	1,181,840.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	85,000	46.69	3,968,650.00	
	BHP GROUP LIMITED	935,000	47.97	44,851,950.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	90,000	19.03	1,712,700.00	
	EVOLUTION MINING LTD	340,000	4.08	1,387,200.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	313,000	20.50	6,416,500.00	
	NEWCREST MINING	154,000	23.85	3,672,900.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	194,000	9.44	1,831,360.00	

RIO TINTO LTD	68,000	119.94	8,155,920.00
SOUTH32 LTD	870,000	4.50	3,915,000.00
REECE LTD	49,000	20.39	999,110.00
BRAMBLES LTD	270,000	10.10	2,727,000.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	170,000	5.39	916,300.00
AURIZON HOLDINGS LTD	305,000	3.68	1,122,400.00
SYDNEY AIRPORT	244,000	8.72	2,127,680.00
TRANSURBAN GROUP	562,000	13.08	7,350,960.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	110,000	40.30	4,433,000.00
CROWN RESORTS LTD	77,000	12.47	960,190.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	10,300	103.17	1,062,651.00
TABCORP HOLDINGS	420,000	5.36	2,251,200.00
WESFARMERS LIMITED	212,000	50.81	10,771,720.00
COLES GROUP LTD	243,000	16.63	4,041,090.00
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	253,000	6.59	1,667,270.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	233,000	34.47	8,031,510.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	135,000	11.94	1,611,900.00
COCHLEAR LTD	11,500	192.80	2,217,200.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	33,000	64.91	2,142,030.00
SONIC HEALTHCARE LTD	84,000	38.10	3,200,400.00
CSL LIMITED	88,800	277.00	24,597,600.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	530,000	28.22	14,956,600.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	329,000	98.81	32,508,490.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	608,000	30.85	18,756,800.00
WESTPAC BANKING CORP	683,000	23.49	16,043,670.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	430,000	4.75	2,042,500.00
MEDIBANK PRIVATE LTD	520,000	3.21	1,669,200.00
QBE INSURANCE	266,000	12.65	3,364,900.00
SUNCORP GROUP LTD	245,000	11.53	2,824,850.00
BLOCK INC-CDI	14,775	149.10	2,202,952.50
COMPUTERSHARE LTD	101,000	23.22	2,345,220.00
WISETECH GLOBAL LTD	28,000	45.26	1,267,280.00
XERO LIMITED	25,500	105.82	2,698,410.00
TELSTRA CORP LTD	790,000	3.90	3,081,000.00
ORIGIN ENERGY LTD	330,000	6.16	2,032,800.00

	APA GROUP	229,000	10.02	2,294,580.00	
	ASX LTD	34,500	82.04	2,830,380.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	64,800	195.65	12,678,120.00	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	26,000	18.32	476,320.00	
	IDP EDUCATION LTD	37,000	27.96	1,034,520.00	
	REA GROUP LTD	10,400	136.06	1,415,024.00	
	SEEK LTD	60,000	28.59	1,715,400.00	
小計	銘柄数：54			298,965,827.50	
				(24,658,701,452)	
	組入時価比率：2.1%			2.2%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	223,000	7.21	1,607,830.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	109,000	29.50	3,215,500.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	74,000	9.60	710,400.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	307,000	4.48	1,375,360.00	
	MERCURY NZ LTD	137,000	5.90	808,300.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	250,000	5.05	1,262,500.00	
小計	銘柄数：6			8,979,890.00	
				(690,553,541)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	330,000	21.85	7,210,500.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	509,040	60.15	30,618,756.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	251,000	138.30	34,713,300.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	230,000	32.55	7,486,500.00	
	MTR CORP	272,000	42.80	11,641,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	409,000	48.35	19,775,150.00	
	SANDS CHINA LTD	432,000	24.00	10,368,000.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	410,000	16.06	6,584,600.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	290,000	23.15	6,713,500.00	
	WH GROUP LIMITED	1,538,306	5.71	8,783,727.26	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	670,000	31.55	21,138,500.00	
	HANG SENG BANK	140,000	166.60	23,324,000.00	
	AIA GROUP LTD	2,239,000	89.30	199,942,700.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	719,600	10.86	7,814,856.00	

	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	134,000	50.85	6,813,900.00	
	CLP HLDGS	299,000	80.00	23,920,000.00	
	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	437.40	98,021,340.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	383,040	53.05	20,320,272.00	
	ESR CAYMAN LTD	380,000	25.85	9,823,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	360,000	16.38	5,896,800.00	
	HENDERSON LAND	267,443	34.20	9,146,550.60	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	268,916	32.80	8,820,444.80	
	SINO LAND CO.LTD	620,000	10.42	6,460,400.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	235,000	99.20	23,312,000.00	
	SWIRE PACIFIC-A	104,000	47.85	4,976,400.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	230,000	21.45	4,933,500.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	311,000	36.35	11,304,850.00	
小計	銘柄数：29			667,779,103.94	
				(9,843,063,992)	
	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	5.41	1,298,400.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,130,000	0.78	887,050.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	340,000	4.73	1,608,200.00	
	DBS GROUP HLDGS	338,000	36.53	12,347,140.00	
	OCBC-ORD	629,000	13.41	8,434,890.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	220,000	32.86	7,229,200.00	
	VENTURE CORP LTD	45,000	18.20	819,000.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,540,000	2.56	3,942,400.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	148,000	9.65	1,428,200.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	480,000	3.74	1,795,200.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	7.31	511,700.00	
	UOL GROUP LIMITED	87,000	7.30	635,100.00	
小計	銘柄数：14			43,835,480.00	

					(3,752,317,088)	
		組入時価比率：0.3%				0.3%
新シケル	ICL GROUP LTD		125,000	33.40	4,175,000.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD		5,000	557.00	2,785,000.00	
	BANK HAPOALIM BM		207,000	33.49	6,932,430.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL		267,000	34.45	9,198,150.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A		213,000	21.35	4,547,550.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		28,000	124.20	3,477,600.00	
	NICE LTD		11,600	811.50	9,413,400.00	
	AZRIELI GROUP		8,600	284.40	2,445,840.00	
	小計	銘柄数：8				42,974,970.00
		組入時価比率：0.1%			(1,538,237,481)	0.1%
合計					1,128,049,925,154	(1,128,049,925,154)

(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18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	1,256,430.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	27,200	5,059,472.00	
		AMERICAN TOWER CORP	83,700	19,139,679.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	267,000	1,890,360.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	25,900	6,116,026.00	
		BOSTON PROPERTIES	26,800	3,270,136.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	18,800	3,042,404.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	79,600	13,004,252.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	52,300	7,204,848.00	
		DUKE REALTY CORP	70,100	3,716,001.00	
		EQUINIX INC	16,560	11,453,061.60	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	32,100	2,428,686.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	65,000	5,520,450.00	

	ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,000	3,775,200.00	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	24,900	4,699,377.00	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	100,000	3,186,000.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	135,000	2,605,500.00	
	INVITATION HOMES INC	105,000	4,124,400.00	
	IRON MOUNTAIN INC	54,000	2,352,780.00	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	108,000	2,211,840.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,400	4,388,926.00	
	PROLOGIS INC	136,000	19,486,080.00	
	PUBLIC STORAGE	28,900	10,001,134.00	
	REALTY INCOME CORP	102,100	6,852,952.00	
	REGENCY CENTERS CORP	28,800	1,921,536.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	20,500	6,067,590.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	61,300	8,806,971.00	
	SUN COMMUNITIES INC	21,300	3,998,862.00	
	UDR INC	54,800	2,971,804.00	
	VENTAS INC	73,600	3,822,048.00	
	VICI PROPERTIES INC	111,000	3,098,010.00	
	VORNADO REALTY TRUST	32,000	1,442,560.00	
	WELLTOWER INC	77,600	6,374,064.00	
	WEYERHAEUSER CO	138,000	5,405,460.00	
	WP CAREY INC	34,000	2,586,380.00	
小計	銘柄数：35	2,338,260	193,281,279.60	
			(22,217,683,090)	
	組入時価比率：1.9%		84.7%	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	819,649.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	28,000	693,000.00	
小計	銘柄数：2	42,900	1,512,649.00	
			(136,758,596)	
	組入時価比率：0.0%		0.5%	
ユーロ	COVIVIO	8,500	648,380.00	
	GECINA SA	8,100	946,080.00	
	KLEPIERRE	40,000	1,054,800.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,900	1,716,976.00	
小計	銘柄数：4	80,500	4,366,236.00	
			(570,099,434)	

		組入時価比率：0.0%		2.2%
英ポンド	BRITISH LAND		159,000	857,328.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC		132,000	1,046,760.00
	SEGRO PLC		220,000	2,810,500.00
小計	銘柄数：3		511,000	4,714,588.00 (737,455,854)
	組入時価比率：0.1%			2.8%
豪ドル	DEXUS/AU		196,000	2,101,120.00
	GOODMAN GROUP		307,000	7,361,860.00
	GPT GROUP		330,000	1,603,800.00
	LENLEASE GROUP		135,000	1,402,650.00
	MIRVAC GROUP		750,000	1,957,500.00
	SCENTRE GROUP		920,000	2,925,600.00
	STOCKLAND TRUST GROUP		460,000	1,895,200.00
	VICINITY CENTRES		670,000	1,273,000.00
小計	銘柄数：8		3,768,000	20,520,730.00 (1,692,549,810)
	組入時価比率：0.1%			6.4%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		470,000	3,717,700.00
	LINK REIT		392,000	25,734,800.00
小計	銘柄数：2		862,000	29,452,500.00 (434,129,850)
	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	1,748,512.80
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		904,221	1,925,990.73
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		370,000	677,100.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST		570,329	1,003,779.04
小計	銘柄数：4		2,464,590	5,355,382.57 (458,420,747)
	組入時価比率：0.0%			1.7%
合計				26,247,097,381 (26,247,097,381)

(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18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	17,843,472,596	-	17,530,102,851	313,369,745
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,419,008,831	-	1,413,123,651	5,885,180
米ドル	1,220,247,381	-	1,214,961,251	5,286,130
ユーロ	104,640,800	-	104,459,440	181,360
豪ドル	49,634,400	-	49,487,160	147,240
香港ドル	44,486,250	-	44,215,800	270,450
合計	-	-	-	319,254,925

(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18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,892,067,406
コール・ローン	616,319,370
国債証券	614,445,070,867
未収入金	100,463,122
未収利息	4,891,955,781
前払費用	378,213,157
その他未収収益	12,401,946
流動資産合計	622,336,491,649
資産合計	622,336,491,649
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	505,580
未払金	1,943,345,055
未払解約金	105,629,375
未払利息	390
その他未払費用	4,661,535
流動負債合計	2,054,141,935
負債合計	2,054,141,935
純資産の部	
元本等	
元本	248,307,306,144
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	371,975,043,570
元本等合計	620,282,349,714
純資産合計	620,282,349,714
負債純資産合計	622,336,491,649

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18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	2,4980円
(10,000口当たり純資産額)	(24,980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	245,341,110,107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	257,671,961,979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19日 至 2022年 2月18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18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18日現在	
期首	2021年 2月19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	230,944,321,776円
同期中における追加設定元本額	45,516,980,956円
同期中における一部解約元本額	28,153,996,588円
期末元本額	248,307,306,144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	271,329,915円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,613,325,883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)	1,822,272,137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	19,162,356円
野村資産設計ファンド2025	34,711,840円
野村資産設計ファンド2030	40,490,779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	50,475,931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)	73,800,513,776円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	6,399,920,538円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	19,938,502,422円
のむらっぴ・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)	518,239,378円
野村資産設計ファンド2045	8,055,142円
野村インデックスファンド・外国債券	970,071,556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	242,927,186円
野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	8,638,475,485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	8,258,608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)	1,676,724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	2,122,860,013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)	6,628,170,153円
世界6資産分散ファンド	64,607,713円
野村資産設計ファンド2060	4,057,622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	9,203,044,360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)	6,263,023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)	1,227,960,056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)	685,231,037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)	1,918,317,621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)	1,243,165,917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)	759,096,937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)	6,281,602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)	588,531,965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)	20,382,600,491円
マイバランスDC30	2,018,336,524円
マイバランスDC50	1,539,295,053円
マイバランスDC70	1,094,222,001円

野村DC外国債券インデックスファンド	8,103,199,109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）	269,137,225円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	494,780,072円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	236,579,650円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	19,181,872円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	43,690,672円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	20,257,023円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	11,118,558円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	7,618,830円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	4,050,863円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	146,866,494円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	96,300,033円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	52,313,933円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	71,973,823円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,968,710円
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	16,812,321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）	57,426,958円
みらいバランス・株式10（富士通企業年金基金DC向け）	5,828,785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18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18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	39,033,310.68	
		US TREASURY BOND	46,700,000.00	47,542,785.56	
		US TREASURY BOND	66,600,000.00	77,380,875.00	
		US TREASURY BOND	15,000,000.00	18,445,312.50	
		US TREASURY BOND	129,400,000.00	156,493,125.00	
		US TREASURY BOND	100,000.00	129,960.93	
		US TREASURY BOND	100,000.00	107,730.46	
		US TREASURY BOND	200,000.00	245,468.74	

US TREASURY N/B	20,450,000.00	20,582,603.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	101,230.46	
US TREASURY N/B	400,000.00	403,640.60	
US TREASURY N/B	500,000.00	501,503.90	
US TREASURY N/B	67,400,000.00	67,663,277.88	
US TREASURY N/B	17,900,000.00	18,176,889.73	
US TREASURY N/B	500,000.00	496,640.60	
US TREASURY N/B	400,000.00	401,421.84	
US TREASURY N/B	100,000.00	101,457.03	
US TREASURY N/B	900,000.00	889,488.27	
US TREASURY N/B	15,700,000.00	15,769,299.80	
US TREASURY N/B	400,000.00	407,140.60	
US TREASURY N/B	37,200,000.00	37,438,310.64	
US TREASURY N/B	21,200,000.00	21,289,436.44	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	10,081,757.07	
US TREASURY N/B	800,000.00	800,374.96	
US TREASURY N/B	100,000.00	101,757.81	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,293,617.08	
US TREASURY N/B	37,100,000.00	37,853,593.75	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,608,163.90	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,893,187.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,020,312.50	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,471,054.65	
US TREASURY N/B	200,000.00	196,062.50	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	35,178,000.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,023,046.80	
US TREASURY N/B	200,000.00	195,765.62	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,630,640.36	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,023,671.80	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	43,538,529.12	
US TREASURY N/B	300,000.00	293,835.93	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,307,812.04	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	30,025,632.08	
US TREASURY N/B	44,400,000.00	45,024,375.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	816,624.96	

US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,461,679.65	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,115,624.80	
US TREASURY N/B	6,900,000.00	7,033,147.92	
US TREASURY N/B	800,000.00	819,437.44	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,654,312.50	
US TREASURY N/B	500,000.00	506,054.65	
US TREASURY N/B	400,000.00	406,843.72	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,398.43	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,743,937.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,460.93	
US TREASURY N/B	500,000.00	504,609.35	
US TREASURY N/B	700,000.00	710,335.92	
US TREASURY N/B	65,400,000.00	66,718,215.48	
US TREASURY N/B	13,900,000.00	13,497,116.84	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,220,625.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,937.50	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,865,937.50	
US TREASURY N/B	500,000.00	501,796.85	
US TREASURY N/B	300,000.00	291,351.54	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,848,390.34	
US TREASURY N/B	500,000.00	501,679.65	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,968.74	
US TREASURY N/B	300,000.00	301,828.11	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,089,429.66	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,820.31	
US TREASURY N/B	43,600,000.00	44,127,965.48	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,095,788.98	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,359.37	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,437,312.32	
US TREASURY N/B	500,000.00	497,812.50	
US TREASURY N/B	57,850,000.00	58,726,786.17	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,327,671.76	
US TREASURY N/B	500,000.00	497,773.40	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,929,984.28	
US TREASURY N/B	100,000.00	100,187.50	

US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,023,046.80	
US TREASURY N/B	300,000.00	297,187.50	
US TREASURY N/B	23,000,000.00	23,195,858.80	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,957,000.00	
US TREASURY N/B	17,300,000.00	16,998,601.13	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	33,594,138.99	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,289.06	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	35,710,194.45	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,726.56	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	8,146,222.45	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,035,156.20	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,230,366.88	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,390,125.00	
US TREASURY N/B	23,000,000.00	23,163,513.90	
US TREASURY N/B	700,000.00	722,750.00	
US TREASURY N/B	29,200,000.00	30,436,436.04	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,242.18	
US TREASURY N/B	49,700,000.00	50,486,268.91	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,389,062.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,303,125.00	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	17,094,108.96	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,425.78	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,983,593.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,025,156.20	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,792.96	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,079,296.50	
US TREASURY N/B	200,000.00	191,335.92	
US TREASURY N/B	42,300,000.00	43,185,656.25	
US TREASURY N/B	300,000.00	286,734.36	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,783,406.16	
US TREASURY N/B	300,000.00	303,187.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	286,441.38	
US TREASURY N/B	800,000.00	800,750.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	287,707.02	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	7,203,374.64	

US TREASURY N/B	100,000.00	94,761.71	
US TREASURY N/B	41,900,000.00	41,278,044.78	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,746,874.40	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,218.75	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,353,866.10	
US TREASURY N/B	300,000.00	287,015.61	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,544,000.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	290,085.93	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	14,389,375.00	
US TREASURY N/B	81,000,000.00	80,180,506.80	
US TREASURY N/B	500,000.00	486,328.10	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,570.31	
US TREASURY N/B	200,000.00	196,718.74	
US TREASURY N/B	29,000,000.00	29,555,077.40	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,351,328.02	
US TREASURY N/B	300,000.00	282,140.61	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	15,862,460.30	
US TREASURY N/B	38,000,000.00	38,955,935.60	
US TREASURY N/B	700,000.00	651,710.92	
US TREASURY N/B	300,000.00	279,000.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	92,203.12	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	8,866,523.22	
US TREASURY N/B	100,000.00	92,679.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,921.87	
US TREASURY N/B	300,000.00	277,312.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,018,515.60	
US TREASURY N/B	300,000.00	278,835.93	
US TREASURY N/B	500,000.00	463,984.35	
US TREASURY N/B	500,000.00	466,875.00	
US TREASURY N/B	27,700,000.00	28,996,271.36	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,453.12	
US TREASURY N/B	500,000.00	480,234.35	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,968.75	
US TREASURY N/B	53,600,000.00	56,556,372.32	
US TREASURY N/B	500,000.00	479,453.10	

US TREASURY N/B	500,000.00	479,218.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,281.25	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	10,463,835.69	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,960.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,679.68	
US TREASURY N/B	300,000.00	289,195.29	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,289,250.00	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,149,585.91	
US TREASURY N/B	23,100,000.00	23,783,974.83	
US TREASURY N/B	300,000.00	293,742.18	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,074,898.28	
US TREASURY N/B	600,000.00	547,968.72	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,645,414.02	
US TREASURY N/B	41,100,000.00	54,595,567.23	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	14,933,514.38	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,625.00	
US TREASURY N/B	150,750,000.00	193,690,187.77	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	931,250.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,140.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,804.68	
US TREASURY N/B	6,200,000.00	5,872,562.50	
US TREASURY N/B	29,100,000.00	37,866,375.00	
US TREASURY N/B	8,200,000.00	11,282,046.26	
US TREASURY N/B	100,000.00	131,851.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	117,882.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	128,921.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	132,812.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	130,953.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	134,867.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	131,367.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	123,375.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	129,195.31	
US TREASURY N/B	300,000.00	412,148.43	
US TREASURY N/B	100,000.00	131,625.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	121,851.56	

US TREASURY N/B	100,000.00	112,023.43	
US TREASURY N/B	100,000.00	112,273.43	
US TREASURY N/B	100,000.00	110,179.68	
US TREASURY N/B	200,000.00	211,601.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	105,828.12	
US TREASURY N/B	290,000.00	324,732.02	
US TREASURY N/B	100,000.00	120,460.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	120,742.18	
US TREASURY N/B	25,500,000.00	29,725,429.05	
US TREASURY N/B	39,950,000.00	44,846,995.09	
US TREASURY N/B	36,700,000.00	40,392,937.50	
US TREASURY N/B	39,900,000.00	40,414,334.94	
US TREASURY N/B	23,400,000.00	25,807,640.04	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	18,942,381.50	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,539,249.92	
US TREASURY N/B	51,500,000.00	52,244,334.65	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	28,603,169.76	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	33,408,395.85	
US TREASURY N/B	14,200,000.00	15,451,375.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,226,406.20	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,896,960.81	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	12,191,765.34	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	9,946,640.16	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	10,665,975.85	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,865,000.00	
US TREASURY N/B	10,500,000.00	11,812,500.00	
US TREASURY N/B	6,100,000.00	7,344,304.23	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,790,906.84	
US TREASURY N/B	100,000.00	110,601.56	
US TREASURY N/B	11,250,000.00	11,032,031.25	
US TREASURY N/B	300,000.00	302,250.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	928,046.80	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,697,265.46	
US TREASURY N/B	9,100,000.00	7,247,296.42	
US TREASURY N/B	6,900,000.00	5,848,288.89	

小計	US TREASURY N/B	15,200,000.00	13,699,000.00	
	US TREASURY N/B	48,550,000.00	49,008,948.00	
	銘柄数：220	2,411,910,000.00	2,562,389,413.49	
	組入時価比率：47.5%		(294,546,663,080)	48.0%
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,311,819.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,380,000.00	7,396,560.72	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,070,000.00	3,098,854.93	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	507,315.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,373,471.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	34,400,000.00	34,008,149.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,772,009.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	330,201.55	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	297,502.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	11,400,000.00	11,027,881.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	192,521.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	810,996.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	14,730,000.00	18,684,047.55	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,031,127.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,254,472.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	12,000,000.00	16,455,996.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	2,601,153.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,411,542.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	12,349,243.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,449,119.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,600,000.00	10,197,571.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	113,717.00	
小計	銘柄数：22	126,580,000.00	137,675,272.25	
	組入時価比率：2.0%		(12,447,221,364)	2.0%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,300,000.00	4,269,986.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	107,500,000.00	108,117,050.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	65,000,000.00	68,616,398.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	110,000,000.00	102,438,149.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	62,300,000.00	61,665,667.63	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	77,300,000.00	80,611,400.59	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	76,600,000.00	76,400,840.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	400,000.00	396,752.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	63,093,400.63
	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,800,000.00	27,045,616.26
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,200,000.00	66,058,520.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	42,659,891.50
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	96,800,000.00	97,192,785.36
	銘柄数：13	790,500,000.00	798,566,457.47 (4,520,764,572)
組入時価比率：0.7%		0.7%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	3,800,000.00	3,939,536.00
	BELGIUM KINGDOM	1,900,000.00	1,919,760.00
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,270,000.00
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,020,226.00
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,750,832.04
	BELGIUM KINGDOM	6,700,000.00	7,953,275.20
	BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,433,102.20
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,065,654.00
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,033,532.00
	BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	6,746,044.50
	BELGIUM KINGDOM	10,400,000.00	10,806,952.00
	BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,604,464.90
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	106,550.00
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	538,033.00
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	114,805.70
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	5,442,907.40
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	6,173,624.00
	BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	5,670,485.60
	BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	2,997,270.00
	BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	3,919,481.90
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,265,216.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	15,239,305.50
	BELGIUM KINGDOM GOVT	10,500,000.00	15,998,451.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,168,000.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,061,182.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,300,000.00	7,880,258.75
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,300,000.00	20,076,503.61
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,400,000.00	11,297,000.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,700,000.00	6,128,486.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,100,000.00	2,200,380.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,700,000.00	20,375,602.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,600,000.00	7,058,436.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,197,250.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,650,000.00	43,080,310.35
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	832,877.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,200,000.00	9,605,720.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,800,000.00	2,922,977.68
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,211,500.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,000,000.00	18,021,500.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,245,385.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	6,021,000.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,056,070.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,900,000.00	2,937,647.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	6,404,848.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,000,000.00	18,298,988.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	3,951,452.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,500,000.00	12,551,154.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,700,000.00	4,975,227.20
BUNDESobligation	100,000.00	100,732.00
BUNDESobligation	2,000,000.00	2,016,940.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	398,357.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	205,288.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,330,000.00	1,381,803.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	6,207,685.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,776,551.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,100,000.00	10,533,290.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000.00	7,959,952.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,765,232.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	8,545,056.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,400,000.00	20,923,260.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,004,920.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	710,738.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	27,335,650.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	205,592.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,300,000.00	25,759,324.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	617,214.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,700,000.00	13,960,290.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,600,000.00	27,716,418.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,750,000.00	27,781,875.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	16,500,000.00	25,695,879.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	12,250,000.00	18,921,264.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,700,000.00	6,167,755.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,800,000.00	5,017,045.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,130,000.00	1,780,870.96	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	9,082,541.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,700,000.00	17,519,931.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,900,000.00	25,153,568.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	7,903,116.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,370.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,401,634.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	535,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,038,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,200,000.00	16,354,282.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	22,800,000.00	24,797,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	310,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	619,410.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,600,000.00	7,157,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,821,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,056,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	31,600,000.00	35,853,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	819,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,662,244.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	416,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,750,000.00	16,786,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,144,300.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	16,900,000.00	19,384,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,104,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	23,400,000.00	30,246,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	211,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	209,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	32,800,000.00	42,525,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	209,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,300,000.00	17,394,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	33,000,000.00	42,243,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	997,801.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,900,000.00	25,966,710.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	891,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,400,000.00	14,472,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,485,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	22,300,000.00	29,960,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,500,000.00	15,616,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	3,376,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	552,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	6,346,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	226,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	16,279,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	12,605,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	6,414,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,334,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	10,002,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,900,000.00	7,891,310.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,047,025.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	102,378.40	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	403,163.20	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	736,050.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,103,460.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	103,451.55	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,040,564.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	3,830,574.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,424,206.40	

FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	817,964.80	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	211,138.40	
FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	3,660,660.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	541,545.60	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	906,758.40	
FRANCE (GOVT OF)	200,000.00	201,208.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,615,996.29	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,014,632.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	100,675.00	
FRANCE (GOVT OF)	12,100,000.00	12,803,566.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,806,436.80	
FRANCE (GOVT OF)	13,000,000.00	13,256,204.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,823,400.00	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,369,386.10	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,340,656.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,900,000.00	7,098,927.00	
FRANCE (GOVT OF)	15,100,000.00	15,512,532.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,015,274.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,400,000.00	10,960,080.40	
FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	10,631,068.10	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	104,990.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	114,271.40	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	12,709,198.60	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,153,340.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	439,610.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	441,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,400,000.00	14,465,568.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,300,000.00	5,590,349.90	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	11,638,573.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,225,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	299,379.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000.00	37,882,950.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	5,149,800.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,700,000.00	40,562,685.90	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,600,000.00	15,814,428.00	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	22,500,000.00	34,397,392.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,100,000.00	43,620,783.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	445,980.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,650,000.00	12,390,842.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,150,000.00	34,965,336.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,850,000.00	12,015,790.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,340,000.00	24,359,173.50	
IRISH GOVERNMENT	6,130,000.00	7,170,126.14	
IRISH GOVERNMENT	7,300,000.00	7,584,371.50	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	627,667.50	
IRISH TSY 1.3% 2033	4,300,000.00	4,526,721.80	
IRISH TSY 1.35% 2031	3,300,000.00	3,532,617.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	2,600,000.00	2,772,439.02	
IRISH TSY 1.7% 2037	3,100,000.00	3,433,901.00	
IRISH TSY 1% 2026	7,100,000.00	7,379,789.70	
IRISH TSY 2.4% 2030	7,000,000.00	8,094,160.20	
IRISH TSY 2% 2045	1,600,000.00	1,905,238.40	
IRISH TSY 3.4% 2024	8,500,000.00	9,153,974.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	418,040.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	100,835.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,300,000.00	3,485,984.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,519,963.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	1,942,465.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,587,500.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	16,212,630.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,037,350.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	792,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,200,000.00	14,864,333.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,700,000.00	7,037,295.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	496,955.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,600,000.00	5,775,915.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	8,600,000.00	13,003,096.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,063,666.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	906,165.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	155,465.85	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,308,450.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	736,234.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,360,499.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	6,483,780.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,061,900.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	10,135,208.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	10,600,000.00	10,698,580.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	8,600,000.00	10,365,218.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	596,836.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	6,492,081.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,000,000.00	7,931,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,886,002.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	1,792,154.10	
	REPUBLIC OF IRELAND	10,650,000.00	11,154,554.40	
	SPANISH GOVERNMENT	25,200,000.00	34,195,669.20	
	SPANISH GOVERNMENT	26,900,000.00	39,128,740.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,900,000.00	8,128,105.50	
小計	銘柄数：217	1,451,190,000.00	1,797,843,227.89	
			(234,744,390,265)	
	組入時価比率：37.8%		38.3%	
英ポンド	UK TREASURY	1,600,000.00	1,584,896.00	
	UK TREASURY	9,900,000.00	9,835,650.00	
	UK TREASURY	2,800,000.00	2,840,801.88	
	UK TREASURY	300,000.00	293,088.12	
	UK TREASURY	2,000,000.00	1,987,580.00	
	UK TREASURY	4,100,000.00	4,245,304.00	
	UK TREASURY	14,670,000.00	16,276,775.76	
	UK TREASURY	200,000.00	195,787.44	
	UK TREASURY	200,000.00	204,796.80	
	UK TREASURY	3,810,000.00	3,845,955.73	
	UK TREASURY	400,000.00	399,212.00	
	UK TREASURY	12,900,000.00	15,006,430.68	
	UK TREASURY	200,000.00	204,057.36	
	UK TREASURY	6,300,000.00	8,209,895.40	
	UK TREASURY	6,650,000.00	8,499,697.50	

	UK TREASURY	7,710,000.00	9,730,667.64	
	UK TREASURY	15,750,000.00	20,985,347.25	
	UK TREASURY	4,330,000.00	5,777,882.72	
	UK TREASURY	100,000.00	146,530.00	
	UK TREASURY	350,000.00	492,047.50	
	UK TREASURY	300,000.00	428,175.00	
	UK TREASURY	320,000.00	483,040.00	
	UK TREASURY	18,440,000.00	25,074,616.11	
	UK TREASURY	5,900,000.00	9,067,710.00	
	UK TREASURY	8,200,000.00	8,035,672.00	
	UK TREASURY	16,100,000.00	16,713,893.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	8,562,140.00	
	UK TREASURY	1,100,000.00	1,016,290.00	
	UK TREASURY	6,750,000.00	10,330,875.00	
	UK TREASURY	1,300,000.00	1,332,058.00	
	UK TREASURY	700,000.00	749,665.00	
	UK TREASURY	8,950,000.00	15,635,650.00	
	UK TREASURY	100,000.00	136,290.00	
	UK TREASURY	200,000.00	344,970.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	6,350,000.00	8,257,407.92	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,400,000.00	11,014,400.00	
小計	銘柄数：36	180,730,000.00	227,945,255.81	
			(35,655,196,913)	
	組入時価比率：5.7%		5.8%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	7,900,000.00	8,112,541.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	36,350,000.00	38,941,755.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,000,000.00	16,440,720.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	17,300,000.00	17,570,952.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	18,900,000.00	19,209,960.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	8,100,000.00	7,783,084.26	
	SWEDISH GOVERNMENT	21,300,000.00	30,777,288.03	
小計	銘柄数：7	125,850,000.00	138,836,301.49	
			(1,707,686,508)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ノルウェークロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,341,605.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	37,800,000.00	38,775,996.00	

小計	NORWEGIAN GOVERNMENT	12,500,000.00	12,441,362.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,597,628.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	10,064,340.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	9,376,030.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	28,000,000.00	27,369,020.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,400,000.00	6,991,890.00	
	銘柄数：8	116,300,000.00	115,957,871.50	(1,494,696,963)
組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	870,000.00	898,550.79	
	KINGDOM OF DENMARK	24,800,000.00	26,330,160.00	
	KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	15,922,940.00	
	KINGDOM OF DENMARK	37,250,000.00	37,603,875.00	
	KINGDOM OF DENMARK	40,200,000.00	66,726,520.74	
	KINGDOM OF DENMARK	3,500,000.00	3,134,320.00	
	銘柄数：6	122,320,000.00	150,616,366.53	(2,643,317,232)
組入時価比率：0.4%			0.4%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	39,000,000.00	37,719,388.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	731,814.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	2,954,145.30	
	POLAND GOVERNMENT BOND	59,100,000.00	54,939,360.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,442,440.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,412,800.00	
	銘柄数：6	107,100,000.00	101,199,947.50	(2,920,681,084)
組入時価比率：0.5%			0.5%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	750,000.00	791,707.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,136,355.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,300,000.00	10,816,311.19	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	16,380,000.00	17,983,705.19	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	6,038,015.99	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,250,328.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	313,104.48	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	3,017,803.32	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	10,557,530.00	

小計	AUSTRALIAN GOVERNMENT	22,200,000.00	22,806,259.80
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,166,408.18
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	3,111,802.98
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,814,034.31
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,500,000.00	10,409,122.10
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,358,080.75
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,250,000.00	9,596,350.50
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	763,630.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,518,024.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,900,000.00	5,098,940.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,385,900.00
	銘柄数：20	109,480,000.00	115,933,413.59 (9,562,187,952)
	組入時価比率：1.5%		1.6%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	503,977.95
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,800,000.00	3,886,590.60
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,472,533.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,392,000.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,131,790.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,426,460.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,650,000.00	5,028,975.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	521,600.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	319,200.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,850,000.00	4,123,350.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,080,000.00	2,355,600.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,920,000.00	1,953,340.80
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,750,000.00	3,042,022.50
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,109,570.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	1,974,630.00
	銘柄数：15	30,600,000.00	32,241,639.85 (2,759,884,371)
	組入時価比率：0.4%		0.4%
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	411,945.16
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,762,190.08
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,700,000.00	2,639,456.01
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	431,510.64

	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,717,117.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,900,000.00	3,974,903.79	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,249,002.36	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,983,007.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	618,590.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,600,000.00	16,303,686.36	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,702,974.22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,027,218.10	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,218,178.82	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	283,906.67	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,400,000.00	16,245,737.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,594,948.64	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	3,784,167.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	7,239,940.29	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	10,446,660.41	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	7,724,768.25	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	316,561.92	
小計	銘柄数：21	110,980,000.00	114,676,472.30	
			(3,149,486,102)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	96,300,000.00	96,768,981.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	89,500,000.00	90,284,915.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000,000.00	50,517,250.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	33,513,975.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,093,618.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,943,980.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,000,000.00	13,479,761.10	
小計	銘柄数：7	306,800,000.00	310,602,480.10	
			(5,632,030,530)	
	組入時価比率：0.9%		0.9%	
新シエケル	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,221,370.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,082,561.50	
	ISRAEL FIXED BOND	6,200,000.00	6,611,136.26	
	ISRAEL FIXED BOND	11,900,000.00	12,268,916.66	
	ISRAEL FIXED BOND	6,500,000.00	8,068,218.60	

		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,232,233.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,313,541.00	
		ISRAEL FIXED BOND	8,500,000.00	8,183,998.05	
		ISRAEL FIXED BOND	3,700,000.00	3,361,419.66	
		ISRAEL FIXED BOND	6,000,000.00	8,980,726.20	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	6,014,561.50	
	小計	銘柄数：11	67,800,000.00	74,338,682.43	
				(2,660,863,931)	
		組入時価比率：0.4%		0.4%	
	合計			614,445,070,867	
				(614,445,070,867)	

(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18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	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
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000
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18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	136,887,600	-	136,382,020	505,580
米ドル	46,129,600	-	45,977,720	151,880
カナダドル	90,758,000	-	90,404,300	353,700
合計	136,887,600	-	136,382,020	505,580

（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。

世界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18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	376,414,325
コール・ローン	98,633,710
投資証券	103,930,906,687
未収入金	4,854,701
未収配当金	186,049,104
差入委託証拠金	244,342,950
流動資産合計	104,841,201,477
資産合計	104,841,201,477
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	60,717,171
未払金	94,980,460
未払解約金	2,022,899
未払利息	62
その他未払費用	195,400
流動負債合計	157,915,992
負債合計	157,915,992
純資産の部	
元本等	
元本	44,974,940,511
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	59,708,344,974
元本等合計	104,683,285,485
純資産合計	104,683,285,485
負債純資産合計	104,841,201,477

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 国内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。</p> <p>外国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。</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	<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 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> <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18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	2.3276円
(10,000口当たり純資産額)	(23,276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19日

至 2022年 2月18日

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月18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18日現在

期首	2021年 2月19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	41,352,191,880円
同期中における追加設定元本額	9,255,563,382円
同期中における一部解約元本額	5,632,814,751円
期末元本額	44,974,940,511円

期末元本額の内訳*

野村世界REITインデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	8,735,498,659円
のむラップ・ファンド（保守型）	1,453,094,696円
のむラップ・ファンド（普通型）	9,497,145,054円
のむラップ・ファンド（積極型）	4,394,148,129円
マイ・ロード	826,542,738円
野村世界REITインデックス（野村SMA・EW向け）	2,404,679,132円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	263,465,254円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	520,414,622円
野村世界REITインデックスファンド（確定拠出年金向け）	16,879,952,227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18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18日現在)

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	188	25,831,200	
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	240	27,024,000	
		S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	340	50,150,000	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	268	164,284,000	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	888	123,432,000	
		産業ファンド投資法人 投資証券	1,127	191,590,000	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	747	241,281,000	
		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	548	106,257,200	
		アクティブ・プロパティーズ投資 法人 投資証券	402	158,991,000	
		G L P 投資法人 投資証券	2,432	425,113,600	
		コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	343	107,016,000	

日本プロロジスリート投資法人 投資証券	1,394	471,869,000	
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	120	79,080,000	
Oneリート投資法人 投資証券	146	42,982,400	
イオンリート投資法人 投資証券	930	135,315,000	
ヒューリックリート投資法人 投資証券	700	113,400,000	
日本リート投資法人 投資証券	240	90,240,000	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	2,407	185,820,400	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	169	21,615,100	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	317	84,385,400	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	173	24,756,300	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	368	43,240,000	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	2,542	403,669,600	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	141	11,688,900	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	965	166,559,000	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	996	59,262,000	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	63	7,938,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	294	157,878,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	131	9,091,400	
投資法人みらい 投資証券	921	44,760,600	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	160	20,384,000	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	206	91,464,000	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券（権利落ち）	8	3,495,208	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	301	58,996,000	

ザイマックス・リート投資法人 投資証券	109	13,276,200	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	316	36,814,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	299	44,491,200	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	890	579,390,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	748	456,280,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	3,786	367,999,200	
オリックス不動産投資法人 投資証券	1,481	247,623,200	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	515	192,352,500	
N T T都市開発リート投資法人	751	111,748,800	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	503	91,747,200	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	514	57,722,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	1,688	228,048,800	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	516	71,930,400	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	3,259	133,944,900	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	270	130,140,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	511	71,897,700	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	488	146,644,000	
福岡リート投資法人 投資証券	385	61,715,500	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	234	160,056,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	797	66,868,300	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	157	108,330,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	376	55,572,800	
スタートプロシード投資法人 投資	122	27,315,800	

	証券		
	大和ハウスリート投資法人 投資証券	1,134	362,880,000
	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	2,437	149,144,400
	大和証券リビング投資法人 投資証券	1,202	127,532,200
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	679	89,084,800
小計	銘柄数：61 組入時価比率：7.8%	45,382	8,139,410,408 7.7%
米ドル	ACADIA REALTY TRUST	48,000	1,005,120.00
	AGREE REALTY CORP	37,600	2,388,728.00
	ALEXANDER & BALDWIN INC	39,000	881,010.00
	ALEXANDERS INC	1,100	285,989.00
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	75,900	14,118,159.00
	ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	6,000	113,760.00
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	28,800	1,063,872.00
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	74,700	3,867,966.00
	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	152,700	5,753,736.00
	AMERICOLD REALTY TRUST	143,100	4,035,420.00
	APARTMENT INCOME REIT CO	84,700	4,378,990.00
	APARTMENT INVT&MGMT CO-A	85,000	599,250.00
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,000	2,038,950.00
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	34,000	492,660.00
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	18,000	179,820.00
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	75,400	17,804,956.00
	BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	15,000	397,200.00
	BOSTON PROPERTIES	76,800	9,371,136.00
	BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	31,000	199,950.00
	BRANDYWINE REALTY TRUST	93,000	1,254,570.00
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	160,000	4,054,400.00
	BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,000	1,923,820.00
	BRT APARTMENTS CORP	7,000	162,960.00
	CAMDEN PROPERTY TRUST	55,000	8,900,650.00
	CARETRUST REIT INC ACQUIRES	53,000	959,300.00
	CEDAR REALTY TRUST INC	7,000	170,030.00

CENTERSPACE	7,600	710,600.00
CHATHAM LODGING TRUST	27,000	396,900.00
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	10,000	75,200.00
CITY OFFICE REIT INC	23,000	416,990.00
CLIPPER REALTY INC	6,000	57,900.00
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	12,600	554,022.00
COREPOINT LODGING INC	23,000	361,100.00
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	60,000	1,557,000.00
COUSINS PROPERTIES INC	79,900	3,172,829.00
CTO REALTY GROWTH INC	3,500	207,900.00
CUBESMART	117,100	5,668,811.00
CYRUSONE INC	68,600	6,165,768.00
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	115,000	1,182,200.00
DIGITAL REALTY TRUST INC	153,100	21,091,056.00
DIGITALBRIDGE GROUP INC	278,000	2,062,760.00
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	130,000	408,200.00
DOUGLAS EMMETT INC	94,700	3,066,386.00
DUKE REALTY CORP	205,000	10,867,050.00
EAGLE HOSPITALITY TRUST	240,000	0.00
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	46,000	966,000.00
EASTGROUP PROPERTIES	22,000	4,153,600.00
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	77,000	743,820.00
EPR PROPERTIES	40,600	1,892,366.00
EQUINIX INC	48,520	33,556,917.20
EQUITY COMMONWEALTH	65,000	1,764,750.00
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	91,900	6,953,154.00
EQUITY RESIDENTIAL	183,800	15,610,134.00
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	65,500	1,653,875.00
ESSEX PROPERTY TRUST INC	35,050	11,026,730.00
EXTRA SPACE STORAGE INC	72,200	13,626,306.00
FARMLAND PARTNERS INC	14,800	170,348.00
FEDERAL REALTY INVS TRUST	37,800	4,475,142.00
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	69,900	4,021,347.00
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	42,500	1,122,425.00
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	51,000	291,720.00

GAMING AND LEISURE PROPERTIE	122,400	5,424,768.00	
GETTY REALTY CORP	21,400	602,410.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,000	435,400.00	
GLADSTONE LAND CORP	16,500	495,495.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	34,000	555,900.00	
GLOBAL NET LEASE INC	55,000	798,600.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	79,900	2,483,292.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	119,000	3,693,760.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	290,300	9,248,958.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	19,000	194,370.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	56,200	2,471,114.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	385,000	7,430,500.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	83,000	2,152,190.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	56,000	1,386,560.00	
INDUS REALTY TRUST INC	3,300	251,130.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	35,000	777,000.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	13,000	2,428,400.00	
INVITATION HOMES INC	321,800	12,640,304.00	
IRON MOUNTAIN INC	155,700	6,783,849.00	
JBG SMITH PROPERTIES	61,000	1,703,730.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	440,000	314,600.00	
KILROY REALTY CORP	56,200	4,047,524.00	
KIMCO REALTY CORP	333,000	7,952,040.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	117,000	2,559,960.00	
LIFE STORAGE INC	44,200	5,655,832.00	
LTC PROPERTIES INC	21,000	715,050.00	
LXP INDUSTRIAL TRUST	153,000	2,333,250.00	
MACERICH CO /THE	115,000	1,831,950.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	739,999	488,399.34	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	321,000	6,574,080.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	62,100	12,736,089.00	
MONMOUTH REIT-CLASS A	52,000	1,089,920.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	94,800	4,108,632.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	44,300	2,578,260.00	

NATL HEALTH INVESTORS INC	25,000	1,374,250.00	
NETSTREIT CORP	22,000	485,760.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	12,000	1,006,560.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	26,000	660,660.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	129,300	3,726,426.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,032	237,506.24	
ORION OFFICE REIT INC	30,000	513,000.00	
PARAMOUNT GROUP INC	90,000	872,100.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	127,000	2,529,840.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	70,000	1,705,900.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	30,000	26,943.00	
PHILLIPS EDISON & CO INC	10,100	329,563.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	120,000	2,074,800.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	66,000	1,129,260.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	18,400	519,616.00	
POSTAL REALTY TRUST INC-A	7,000	123,480.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	29,000	745,300.00	
PRIME US REIT	340,000	278,800.00	
PROLOGIS INC	398,600	57,111,408.00	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	10,900	1,732,446.00	
PUBLIC STORAGE	82,220	28,453,053.20	
REALTY INCOME CORP	305,200	20,485,024.00	
REGENCY CENTERS CORP	82,900	5,531,088.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	66,000	1,209,120.00	
RETAIL VALUE INC	8,500	26,435.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	81,700	5,718,183.00	
RLJ LODGING TRUST	91,000	1,385,020.00	
RPT REALTY	45,000	588,600.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	29,600	2,767,600.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	122,000	1,651,880.00	
SAFEHOLD INC	7,600	461,244.00	
SAUL CENTERS INC	6,600	309,144.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	20,000	186,400.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	90,000	823,500.00	

	SIMON PROPERTY GROUP INC	177,100	25,443,957.00	
	SITE CENTERS CORP	96,000	1,505,280.00	
	SL GREEN REALTY CORP	36,490	2,998,748.20	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	66,000	3,103,980.00	
	STAG INDUSTRIAL INC	94,600	3,717,780.00	
	STORE CAPITAL CORP	131,800	4,033,080.00	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	57,000	597,360.00	
	SUN COMMUNITIES INC	62,400	11,714,976.00	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	118,000	1,401,840.00	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	55,000	939,400.00	
	TERRENO REALTY CORP	40,000	2,744,000.00	
	THE NECESSITY RETAIL REIT WHERE AMERICA	66,000	557,040.00	
	UDR INC	156,600	8,492,418.00	
	UMH PROPERTIES INC	25,000	580,500.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,900	399,027.00	
	URBAN EDGE PROPERTIES	60,000	1,098,600.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	16,000	307,360.00	
	VENTAS INC	214,900	11,159,757.00	
	VERIS RESIDENTIAL INC	43,000	759,810.00	
	VICI PROPERTIES INC	338,700	9,453,117.00	
	VORNADO REALTY TRUST	85,800	3,867,864.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	46,000	1,123,320.00	
	WELLTOWER INC	234,800	19,286,472.00	
	WHITESTONE REIT	24,000	283,680.00	
	WP CAREY INC	100,100	7,614,607.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	61,500	1,191,870.00	
小計	銘柄数：155	13,782,911	632,552,777.18 (72,711,941,736)	
	組入時価比率：69.5%		69.9%	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	32,600	1,413,862.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	32,000	416,000.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST	9,000	128,790.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	13,200	718,608.00	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	18,000	72,720.00	

	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	45,200	2,486,452.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	87,000	1,255,410.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	24,000	414,960.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	29,000	497,350.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	59,000	959,340.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	12,300	311,559.00	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	22,000	93,720.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	61,000	1,148,630.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	16,900	1,547,195.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	74,000	952,380.00	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,000	82,480.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	38,000	606,860.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	27,800	601,036.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	13,000	283,400.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	9,100	171,262.00	
	NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	12,000	148,560.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	60,000	802,200.00	
	PLAZA RETAIL REIT	24,000	114,240.00	
	PRIMARIS REIT	18,500	256,780.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	85,000	2,103,750.00	
	SLATE GROCERY REIT	15,500	238,080.00	
	SLATE OFFICE REIT	21,000	106,680.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	39,000	1,225,770.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	49,000	1,053,500.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	20,000	148,400.00	
小計	銘柄数：30	975,100	20,359,974.00	
			(1,840,745,249)	
	組入時価比率：1.8%		1.8%	
ユ一ロ	AEDIFICA	20,000	1,959,000.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	8,000	135,840.00	
	ALTAREA	2,398	373,608.40	
	BEFIMMO S.C.A.	12,700	421,005.00	
	CARE PROPERTY INVEST	12,700	290,830.00	
	CARMILA	23,000	364,320.00	

	COFINIMMO	16,000	1,857,600.00	
	COIMA RES SPA	11,000	88,000.00	
	COVIVIO	25,700	1,960,396.00	
	CROMWELL REIT EUR	170,000	402,900.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,000	463,400.00	
	GECINA SA	28,900	3,375,520.00	
	HAMBORNER REIT AG	37,000	370,888.00	
	HIBERNIA REIT PLC	340,000	410,040.00	
	ICADE	17,800	1,068,890.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	27,563	117,142.75	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	140,000	1,082,200.00	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	13,200	360,360.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	250,000	381,500.00	
	KLEPIERRE	106,000	2,795,220.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	40,000	219,200.00	
	MERCIALYS	29,000	300,730.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	183,000	1,885,815.00	
	MONTEA	5,700	619,020.00	
	NSI NV	9,100	322,140.00	
	RETAIL ESTATES	5,900	416,540.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	62,600	4,497,184.00	
	VASTNED RETAIL NV	9,270	249,826.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	76,000	2,675,200.00	
	WERELDHAVE NV	24,000	417,360.00	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	10,000	484,500.00	
小計	銘柄数 : 31	1,736,531	30,366,175.65	
			(3,964,911,554)	
	組入時価比率 : 3.8%		3.8%	
英債券	AEW UK REIT PLC	70,000	81,340.00	
	ASSURA PLC	1,580,000	970,910.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	93,000	1,321,530.00	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	430,000	472,140.00	
	BRITISH LAND	502,000	2,706,784.00	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	460,000	774,640.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	360,000	312,120.00	

	CUSTODIAN REIT PLC	200,000	208,400.00
	DERWENT LONDON PLC	59,600	1,933,424.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	319,285	292,145.77
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	134,000	952,740.00
	HAMMERSON PLC	2,300,000	860,660.00
	HOME REIT PLC	320,000	358,400.00
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	213,750	241,965.00
	INTU PROPERTIES PLC	335,000	0.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	408,000	3,235,440.00
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	501,000	1,302,600.00
	LXI REIT PLC	400,000	547,200.00
	NEWRIVER REIT PLC	141,000	126,195.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	270,000	272,700.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	730,000	979,660.00
	PRS REIT PLC/THE	270,000	279,450.00
	REGIONAL REIT LTD	205,000	181,015.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	114,000	1,461,480.00
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	300,000	165,600.00
	SEGRO PLC	647,000	8,265,425.00
	SHAFTESBURY PLC	159,000	942,075.00
	STANDARD LIFE INV PROP INC	200,000	160,800.00
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	540,000	637,200.00
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	180,000	167,400.00
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,008,000	2,304,288.00
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	470,000	378,820.00
	UNITE GROUP PLC	218,000	2,184,360.00
	WORKSPACE GROUP PLC	69,000	537,165.00
小計	銘柄数：34	14,206,635	35,616,071.77
			(5,571,065,946)
	組入時価比率：5.3%		5.4%
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	194,000	686,760.00
	ARENA REIT	191,000	964,550.00
	AVENTUS GROUP	201,000	655,260.00
	BWP TRUST	273,000	1,102,920.00
	CENTURIA CAPITAL GROUP	317,000	954,170.00

	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	286,000	1,095,380.00
	CENTURIA OFFICE REIT	239,188	540,564.88
	CHARTER HALL GROUP	255,000	4,227,900.00
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	324,000	1,613,520.00
	CHARTER HALL RETAIL REIT	284,000	1,175,760.00
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	188,000	731,320.00
	CROMWELL PROPERTY GROUP	780,000	690,300.00
	DEXUS INDUSTRIA REIT	130,000	421,200.00
	DEXUS/AU	584,000	6,260,480.00
	GDI PROPERTY GROUP	262,730	266,670.95
	GOODMAN GROUP	915,000	21,941,700.00
	GPT GROUP	1,036,000	5,034,960.00
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	145,000	600,300.00
	HOME CONSORTIUM LTD	93,000	598,920.00
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	320,000	438,400.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	97,250	346,210.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	205,000	1,141,850.00
	IRONGATE GROUP	270,000	496,800.00
	MIRVAC GROUP	2,130,000	5,559,300.00
	NATIONAL STORAGE REIT	600,000	1,488,000.00
	RURAL FUNDS GROUP	220,000	613,800.00
	SCENTRE GROUP	2,810,000	8,935,800.00
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	620,000	1,791,800.00
	STOCKLAND TRUST GROUP	1,269,000	5,228,280.00
	VICINITY CENTRES	2,070,000	3,933,000.00
	WAYPOINT REIT	374,341	1,040,667.98
小計	銘柄数：31	17,683,509	80,576,543.81 (6,645,953,333)
	組入時価比率：6.3%		6.4%
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	470,000	665,050.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	560,000	1,416,800.00
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	900,000	999,000.00
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	670,000	1,065,300.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	220,000	690,800.00
小計	銘柄数：5	2,820,000	4,836,950.00

			(371,961,455)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,060,000	4,112,800.00	
	FORTUNE REIT	820,000	6,658,400.00	
	LINK REIT	1,124,000	73,790,600.00	
	PROSPERITY REIT	640,000	1,939,200.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	500,000	2,190,000.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,289,700	4,243,113.00	
小計	銘柄数：6	5,433,700	92,934,113.00	
	組入時価比率：1.3%		(1,369,848,825)	1.3%
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	220,000	308,000.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	679,992	584,793.12	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,819,982	5,132,349.24	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	990,044	1,039,546.20	
	CAPITALAND CHINA TRUST	570,012	678,314.28	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,710,028	5,772,359.64	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	370,040	451,448.80	
	EC WORLD REIT	120,000	89,400.00	
	ESR REIT	1,640,038	729,816.91	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	490,000	296,450.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	630,838	195,559.78	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	580,007	1,339,816.17	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,539,990	2,202,185.70	
	I REIT GLOBAL	338,052	219,733.80	
	KEPPEL DC REIT	719,983	1,562,363.11	
	KEPPEL REIT	1,080,000	1,231,200.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	430,000	363,350.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,170,024	2,141,143.92	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,050,000	2,667,000.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,629,991	2,868,784.16	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,150,000	1,265,000.00	
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,359,967	591,585.64		
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	205,000	943,000.00		

小計	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	260,000	215,800.00	
	SPH REIT	480,000	465,600.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	830,000	518,750.00	
	SUNTEC REIT	1,200,000	1,956,000.00	
	銘柄数：27	24,263,988	35,829,350.47	(3,066,992,400)
	組入時価比率：2.9%		3.0%	
ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	75,859	461,981,310.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9,000	52,920,000.00	
	JR REIT XXVII	66,000	352,440,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	16,000	104,000,000.00	
	LOTTE REIT CO LTD	73,000	397,850,000.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	45,000	208,125,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	21,365	171,347,300.00	
小計	銘柄数：7	306,224	1,748,663,610.00	(168,046,572)
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
新シェケル	REIT 1 LTD	102,000	2,235,840.00	
小計	銘柄数：1	102,000	2,235,840.00	(80,029,209)
	組入時価比率：0.1%		0.1%	
合計			103,930,906,687	(95,791,496,279)

(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18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	673,808,559	-	613,178,113	60,633,746

市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	28,819,500	-	28,736,075	83,425
米ドル	28,819,500	-	28,736,075	83,425
合計	-	-	-	60,717,171

(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。

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

のむらップ・ファンド（保守型）

2022年3月31日現在

資産総額	50,917,706,252円
負債総額	186,459,143円
純資産総額（ - ）	50,731,247,109円
発行済口数	31,890,101,565口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5908円

のむらップ・ファンド（やや保守型）

2022年3月31日現在

資産総額	6,662,046,981円
負債総額	10,563,973円
純資産総額（ - ）	6,651,483,008円
発行済口数	5,056,181,715口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3155円

のむらップ・ファンド（普通型）

2022年3月31日現在

資産総額	178,975,267,499円
負債総額	616,438,172円
純資産総額（ - ）	178,358,829,327円
発行済口数	76,190,033,254口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3410円

のむらップ・ファンド（やや積極型）

2022年3月31日現在

資産総額	9,529,703,344円
負債総額	121,255,663円
純資産総額（ - ）	9,408,447,681円
発行済口数	5,938,553,832口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5843円

のむらップ・ファンド（積極型）

2022年3月31日現在

資産総額	82,436,412,934円
負債総額	428,277,636円
純資産総額（ - ）	82,008,135,298円
発行済口数	27,743,632,029口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9559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NOMURA - B P I総合 マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	845,235,510,832円
負債総額	11,415,470,748円
純資産総額（ - ）	833,820,040,084円
発行済口数	637,009,354,599口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3090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）世界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	120,426,683,595円
負債総額	744,140,561円
純資産総額（ - ）	119,682,543,034円
発行済口数	45,484,596,803口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6313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について

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額

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。

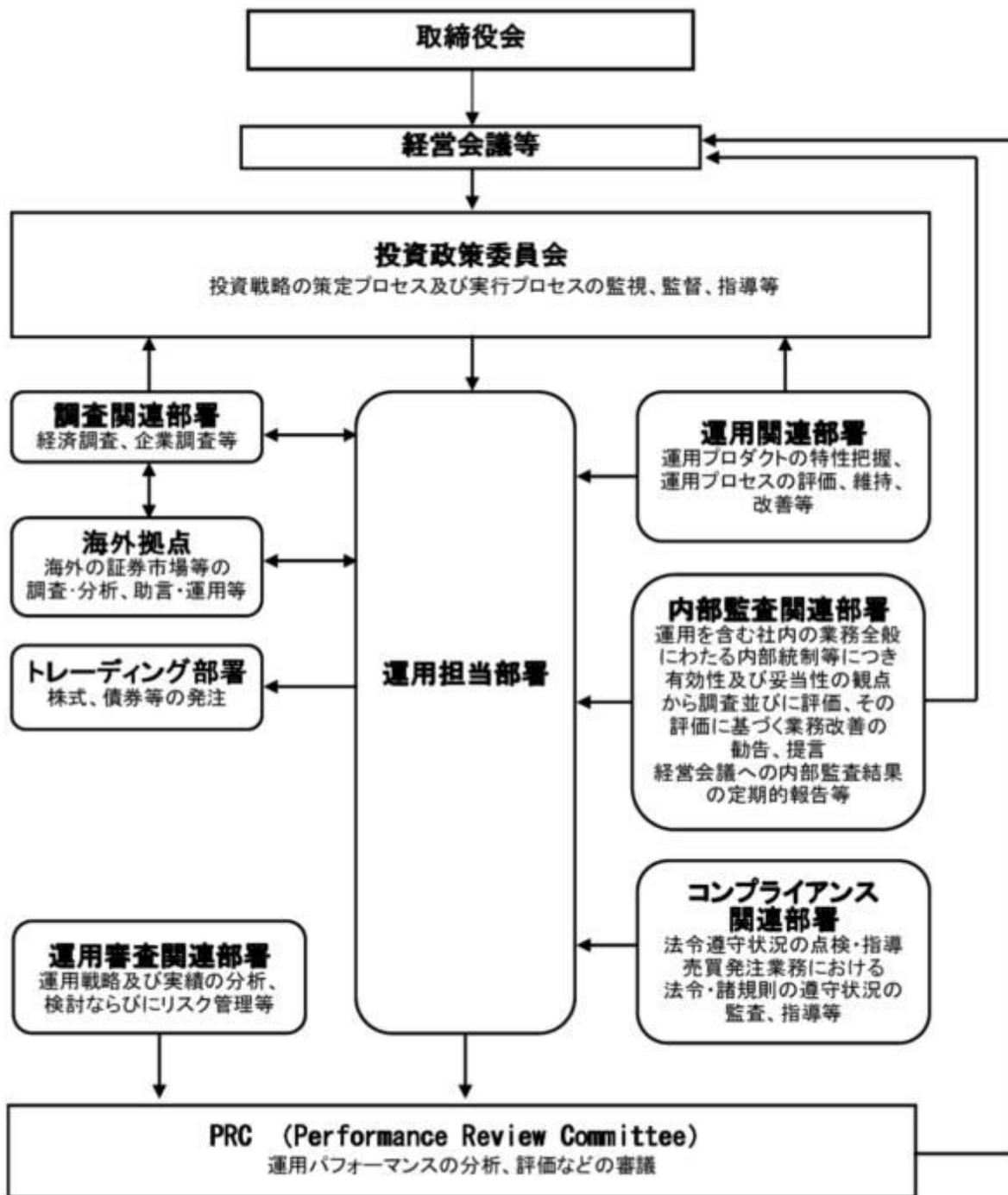
代表取締役・業務執行取締役

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

		前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,936		4,540	
受取利息		0		0	
金銭の信託運用益		-		1,698	
その他		309		447	
営業外収益計			5,246		6,687
営業外費用					
金銭の信託運用損		230		-	
投資事業組合等評価損		146		-	
時効後支払損引当金繰入額		18		13	
為替差損		23		26	
その他		23		32	
営業外費用計			443		72
經常利益			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。</p> <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>(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 従業員から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。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>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)

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

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自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)
<p>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。</p>
<p>2．確定給付制度</p>

(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	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1)	31,378	未払手数料	5,536
							コマースャル・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	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	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	当中間会計期間末
		普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株
2	配当に関する事項					
	配当金支払額	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いません。

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	
a u カブコム証券株式会社	7,196百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
O K B 証券株式会社	1,500百万円	
九州 F G 証券株式会社	3,000百万円	

四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
七十七証券株式会社	3,000百万円	
ちばぎん証券株式会社	4,374百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
とうほう証券株式会社	3,000百万円	
南都まほろば証券株式会社	3,000百万円	
八十二証券株式会社	3,000百万円	
百五証券株式会社	3,000百万円	
ひろぎん証券株式会社	5,000百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
めぶき証券株式会社	3,000百万円	
楽天証券株式会社	17,495百万円	
株式会社愛知銀行	18,000百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	
株式会社イオン銀行	51,250百万円	
株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	
株式会社岩手銀行	12,089百万円	
株式会社大分銀行	19,598百万円	
株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	
株式会社紀陽銀行	80,096百万円	
株式会社佐賀銀行	16,062百万円	
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社七十七銀行	24,658百万円	
株式会社清水銀行	10,816百万円	
株式会社大光銀行	10,000百万円	
株式会社筑邦銀行	8,000百万円	
株式会社筑波銀行	48,868百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社東北銀行	13,233百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	
株式会社トマト銀行	17,810百万円	
株式会社長崎銀行	7,621百万円	
株式会社長野銀行	13,000百万円	
株式会社名古屋銀行	25,090百万円	
株式会社南都銀行	37,900百万円	
株式会社西日本シティ銀行	85,745百万円	
株式会社肥後銀行	18,128百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社広島銀行	54,573百万円	

株式会社福井銀行	17,965百万円	
株式会社福島銀行	18,682百万円	
株式会社豊和銀行	12,400百万円	
株式会社北陸銀行	140,409百万円	
株式会社北海道銀行	93,524百万円	
株式会社みちのく銀行	36,986百万円	
株式会社みなと銀行	39,984百万円	
株式会社宮崎太陽銀行	12,252百万円	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社山形銀行	12,008百万円	
株式会社山梨中央銀行	15,400百万円	
株式会社琉球銀行	56,967百万円	
朝日信用金庫	19,738百万円 ¹	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。
岡崎信用金庫	3,096百万円 ¹	
碧海信用金庫	1,256百万円 ¹	
近畿産業信用組合	26,897百万円 ¹	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
労働金庫連合会	120,000百万円 ¹	労働金庫法に基づき労働金庫の事業を営んでいます。

* 2022年2月末現在

1 朝日信用金庫、岡崎信用金庫、碧海信用金庫、近畿産業信用組合および労働金庫連合会の資本金の額の箇所には、出資の総額を記載しております。

2 【関係業務の概要】

(1) 受託者

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

(2) 販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いおよび販売を行ない、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行ないます。

野村證券株式会社は、ファンドの投資助言を行ないます。なお、同社は金融商品取引法に基づき投資運用業の登録を行なっています。

3 【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年 5月14日	有価証券届出書
2021年 5月14日	有価証券報告書
2021年11月12日	有価証券届出書の訂正届出書
2021年11月12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、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2022年4月1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」に掲げられているのむらっぴ・ファンド（保守型）の2021年2月19日から2022年2月18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、のむらっぴ・ファンド（保守型）の2022年2月18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。

独立監査人の監査報告書

2022年4月1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」に掲げられているのむらっぴ・ファンド（やや保守型）の2021年2月19日から2022年2月18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、のむらっぴ・ファンド（やや保守型）の2022年2月18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。

独立監査人の監査報告書

2022年4月1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」に掲げられているのむらっぴ・ファンド（普通型）の2021年2月19日から2022年2月18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、のむらっぴ・ファンド（普通型）の2022年2月18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。

独立監査人の監査報告書

2022年4月1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」に掲げられているのむらっぴ・ファンド（やや積極型）の2021年2月19日から2022年2月18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、のむらっぴ・ファンド（やや積極型）の2022年2月18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。

独立監査人の監査報告書

2022年4月1日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 志保

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているのむらっぴ・ファンド（積極型）の2021年2月19日から2022年2月18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、のむらっぴ・ファンド（積極型）の2022年2月18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
業務執行社員 公認会計士 湯原 尚指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 津村 健二郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 水永 真太郎

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。