

**【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】      | 2019年11月28日提出                   |
| 【計算期間】     | 第6期(自 2018年9月7日至 2019年9月6日)     |
| 【ファンド名】    | 野村インデックスファンド・内外 7 資産バランス・為替ヘッジ型 |
| 【発行者名】     | 野村アセットマネジメント株式会社                |
| 【代表者の役職氏名】 | C E O兼代表取締役社長 中川 順子             |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都中央区日本橋一丁目 1 2 番 1 号          |
| 【事務連絡者氏名】  | 松井 秀仁                           |
| 【連絡場所】     | 東京都中央区日本橋一丁目 1 2 番 1 号          |
| 【電話番号】     | 03-3241-9511                    |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。                     |

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

## 信託金の限度額

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

## &lt;商品分類&gt;

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

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

（野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型）

## 《商品分類表》

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

## 《属性区分表》

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

|   |   |  |                                      |                                       |   |
|---|---|--|--------------------------------------|---------------------------------------|---|
| 株式<br>一般<br>大型株<br>中小型株   | 年1回<br>年2回<br>年4回                               | <b>グローバル</b><br><b>(日本を含む)</b><br>日本                             |                                      |                                       |   |
| 債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券<br>クレジット属性<br>( )   | 年6回<br>(隔月)<br>年12回<br>(毎月)<br>日々<br>その他<br>( ) | 北米<br>欧州<br>アジア<br>オセアニア<br>中南米<br>アフリカ<br>中近東<br>(中東)<br>エマージング | <b>ファミリーファンド</b><br><br>ファンド・オブ・ファンズ | <b>あり</b><br><b>(フルヘッジ)</b><br><br>なし | 日経225<br><br>T O P I X<br><br><b>その他</b><br><b>(合成指数)</b> |
| 不動産投信<br><br><b>その他資産</b><br><b>(投資信託証券</b><br><b>(資産複合(株式、</b><br><b>債券、不動産投</b><br><b>信)資産配分固定</b><br><b>型))</b><br><br>資産複合<br>( )<br>資産配分固定型<br>資産配分変更型 |   |  |                                      |                                       |   |

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

#### < 商品分類表定義 >

##### [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

##### [ 投資対象地域による区分 ]

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

##### [ 投資対象資産による区分 ]

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

があるものをいう。

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

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

#### < 属性区分表定義 >

##### [ 投資対象資産による属性区分 ]

###### 株式

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

###### 債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

##### [ 決算頻度による属性区分 ]

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

##### [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

#### [投資形態による属性区分]

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

#### [為替ヘッジによる属性区分]

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

#### [インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

#### [特殊型]

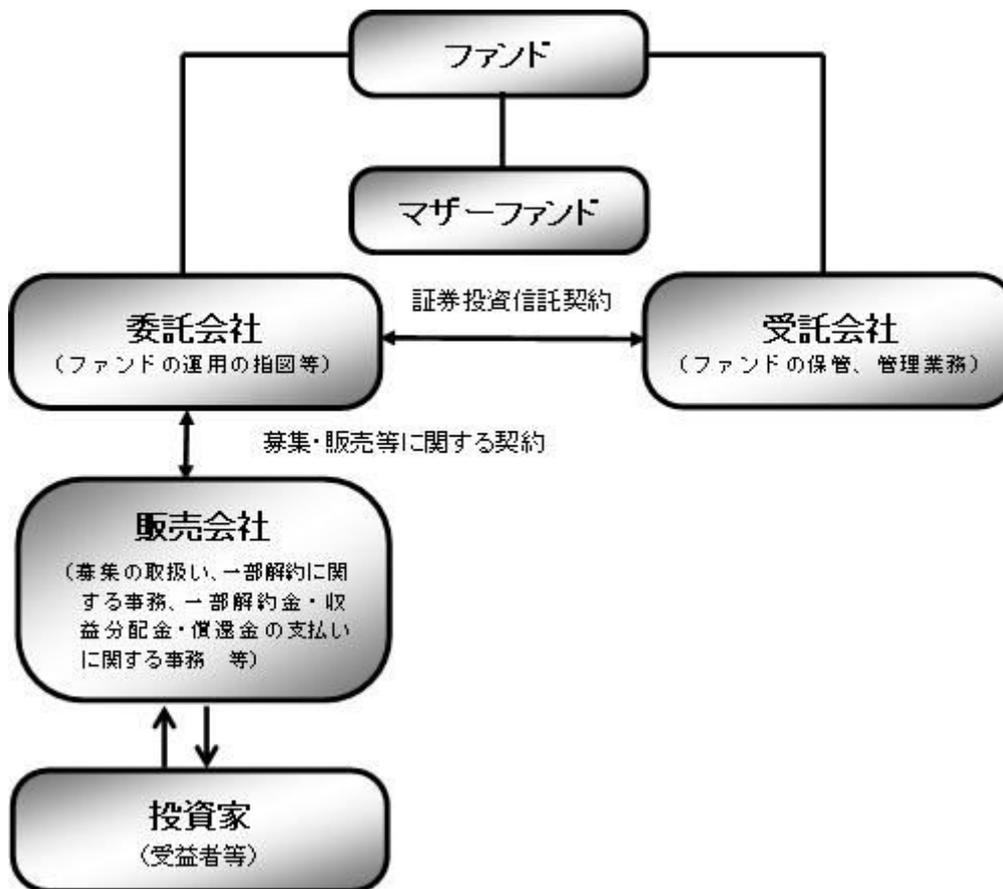
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定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

## (2)【ファンドの沿革】

2013年9月12日

信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

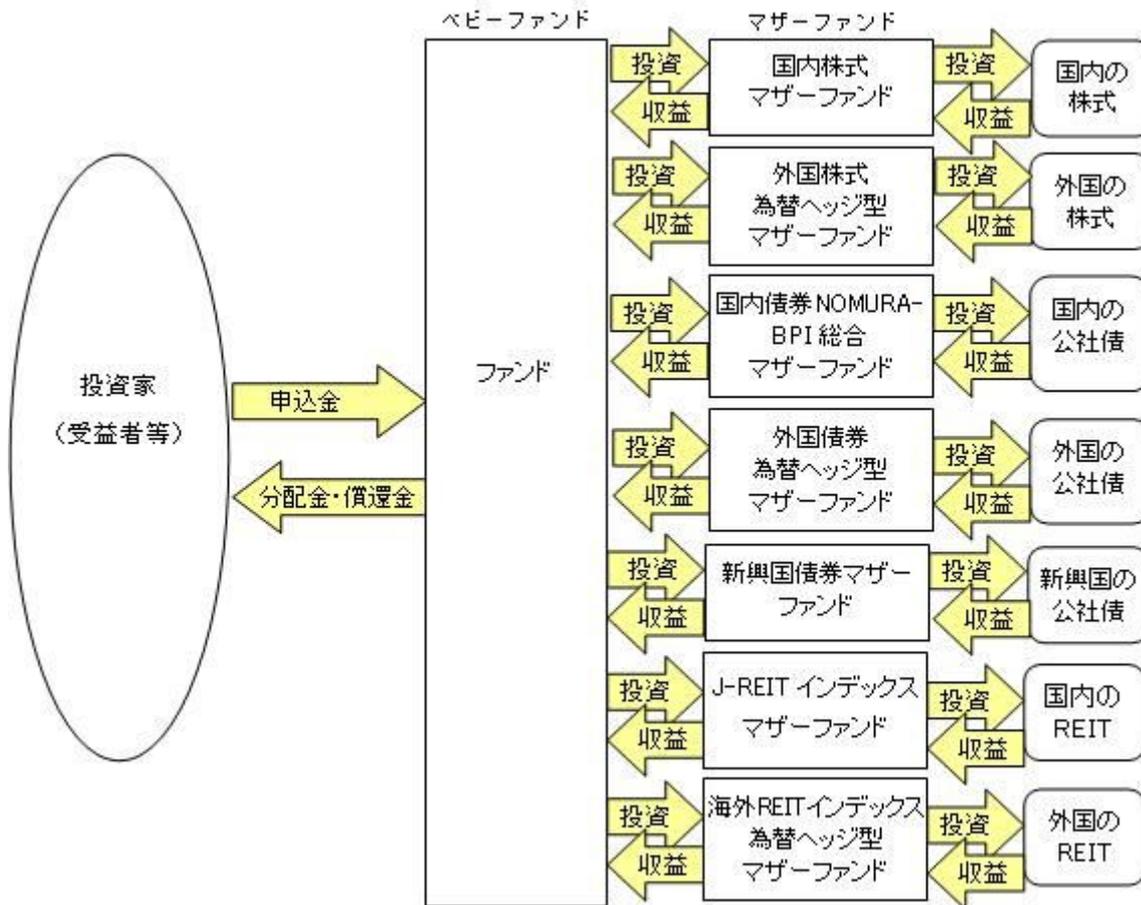
## (3)【ファンドの仕組み】



|                            |  |
|----------------------------|--|
| <b>ファンド</b>                | 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  |
| <b>マザーファンド<br/>(親投資信託)</b> | 国内株式マザーファンド<br>外国株式為替ヘッジ型マザーファンド<br>国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド<br>外国債券為替ヘッジ型マザーファンド<br>新興国債券マザーファンド<br>J-REITインデックスマザーファンド<br>海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド |
| <b>委託会社(委託者)</b>           | 野村アセットマネジメント株式会社   |
| <b>受託会社(受託者)</b>           | 野村信託銀行株式会社   |

#### ファミリーファンド方式について

ファンドは、ファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様が出資した資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行なうしくみをいいます。



## 委託会社の概況(2019年10月末現在)

## ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

## ・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

## ・資本金の額

17,180百万円

## ・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

## ・大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

[1] ファンドにおける各マザーファンドへの投資比率は、以下を基本（「基本投資割合」といいます。）

とし、原則として毎月、リバランスを行ない、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

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

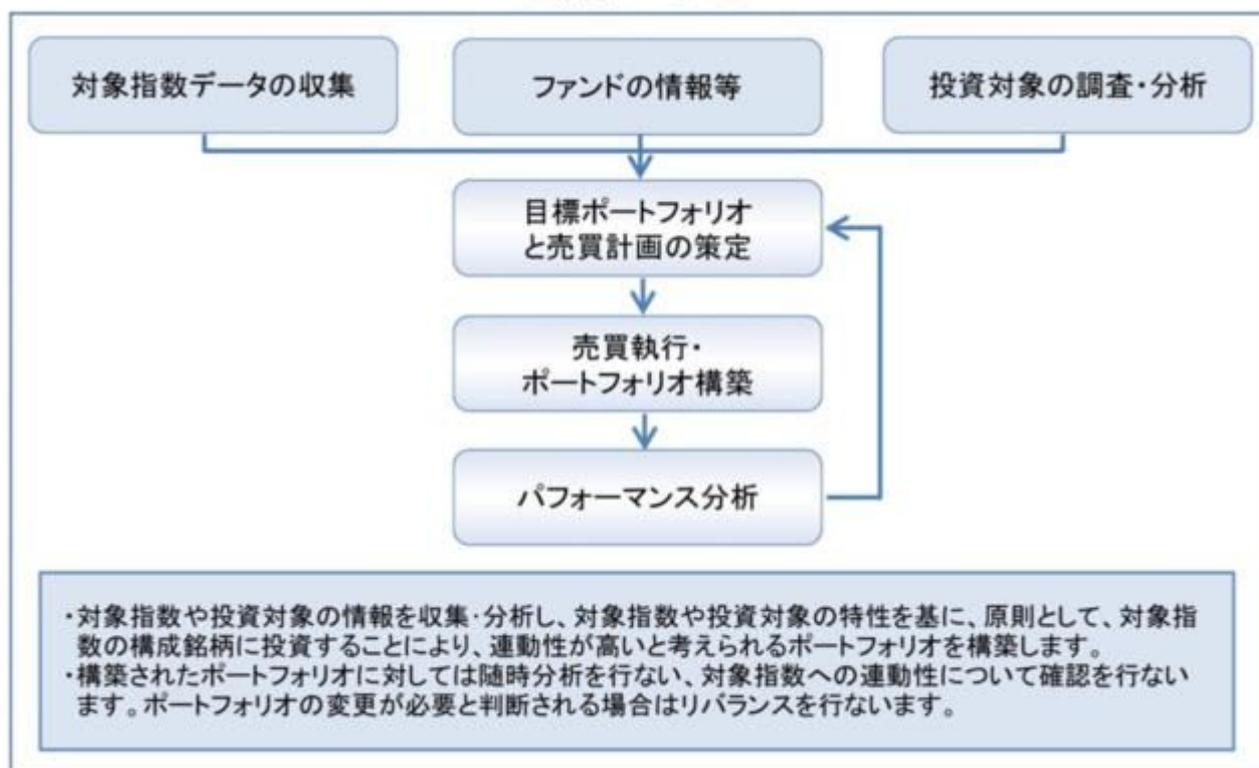
1 わが国の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。)とします。

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

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

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

### ■投資プロセス■



\* 上記の投資プロセスは、今後変更となる場合があります。

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

[3] 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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。

#### 各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について

##### 東証株価指数(TOPIX)

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

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

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

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

本ファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、本ファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。

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

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

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

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

## MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジあり)

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

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

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

## NOMURA-BPI総合

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

## FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)

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

## JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジベース)

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

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

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

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

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

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

## 東証REIT指数(配当込み)

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

**株**東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができるものとします。

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

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

本ファンドは、東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、本ファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。

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

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

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

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

## S&amp;P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## （２）【投資対象】

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

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

### 各マザーファンドの主要投資対象

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

### 投資の対象とする資産の種類(信託約款)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - イ 有価証券
  - ロ デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後述の「（５）投資制限、および」に定めるものに限り、）に係る権利
  - ハ 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）
  - ニ 金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

### 2 次に掲げる特定資産以外の資産

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

### 有価証券の指図範囲等(信託約款)

委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である国内株式マザーファンド、外国株式為替ヘッジ型マザーファンド、国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド、外国債券為替ヘッジ型マザーファンド、新興国債券マザーファンド、J - REITインデックス マザーファンド、および海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド（以下「各マザーファンド」といいます。）受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資するこ

とを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含み  
ます。)
6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定める  
ものをいいます。）
9. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいま  
す。）
10. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第  
1項第8号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券および新株予約権証券
13. 外国の者の発行する証券または証書で、第1号もしくは第5号の証券または証書の性質を有するプリ  
ファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの
14. 前号以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第12号の証券または証書の  
性質を有するもの
15. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいま  
す。）
16. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるも  
のをいいます。）
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいま  
す。）
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19号の有価証券に表示されるべき権利の  
性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

金融商品の指図範囲等(信託約款)

委託者は、信託金を、上記「有価証券の指図範囲等」に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みま

す。)により運用することを指図することができます。

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

- 1 先物取引等
- 2 スワップ取引
- 3 金利先渡取引<sup>1</sup>
- 4 為替先渡取引<sup>2</sup>
- 5 直物為替先渡取引<sup>3</sup>

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

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

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

## (参考)各マザーファンドの概要

(国内株式マザーファンド)  
運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1. 基本方針

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

## 2. 運用方法

## (1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

## (2) 投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

(外国株式為替ヘッジ型マザーファンド)  
運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1. 基本方針

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

## 2. 運用方法

## (1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

## (2) 投資態度

主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに連動する投資成果を目指します。

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。

MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、株価指数先物取引等のデリバティブ取引ならびに為替予約取引をヘッジ目的外の利用も含め活用する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。

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。

（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いません。

## 2．運用方法

### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

## （外国債券為替ヘッジ型マザーファンド）

### 運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1．基本方針

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

## 2．運用方法

### (1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないます。

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

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割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

## （新興国債券マザーファンド）

### 運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1．基本方針

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

#### 2．運用方法

##### (1) 投資対象

新興国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、一部ローンに投資する場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）を含む市況動向や、その他資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

##### (3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

## (J-REITインデックス マザーファンド)

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1.基本方針

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

## 2.運用方法

## (1)投資対象

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

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

## (2)投資態度

J-REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## (3)投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への直接投資は行ないません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

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

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

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

## (海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド)

## 運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1.基本方針

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

## 2.運用方法

## (1) 投資対象

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

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

## (2) 投資態度

日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないます。

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

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（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

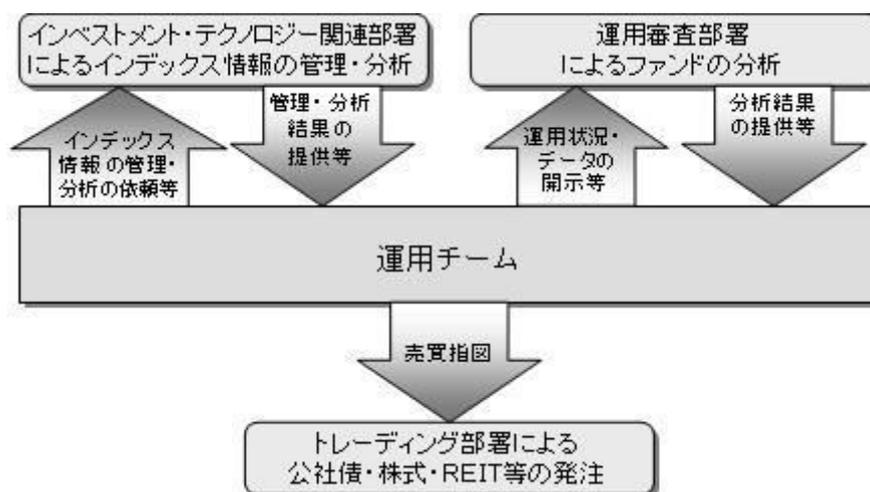
外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

## (3) 【運用体制】

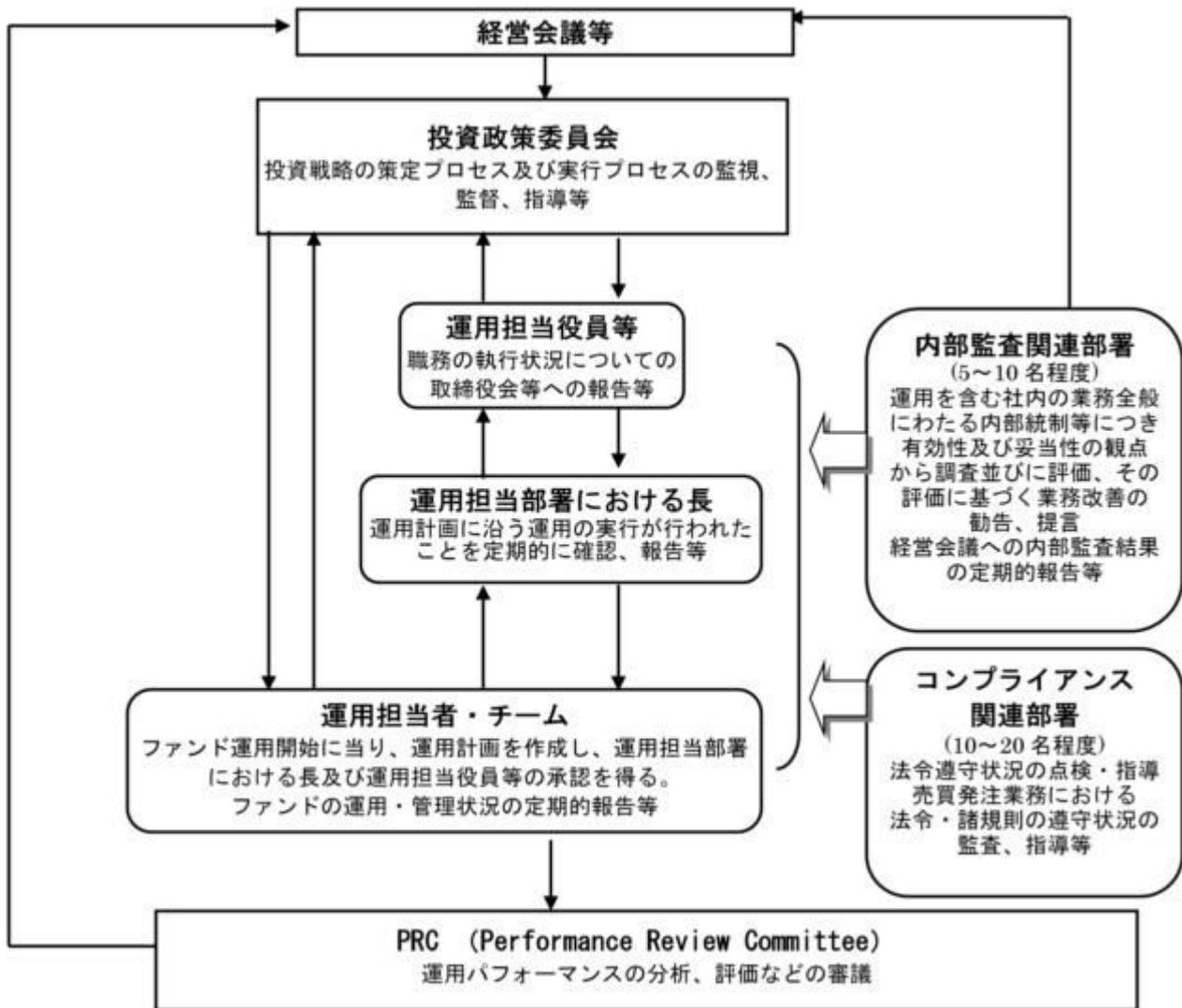
ファンドの運用体制は以下の通りです。



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

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

す。)等の全額とします。

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

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

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

ファンドの決算日

原則として毎年9月6日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

## (5)【投資制限】

運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限(信託約款)

- ・ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 外国為替予約取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ・ 同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ・ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ・ 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。
- ・ 前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

投資する株式等の範囲(信託約款)

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

資することを指図することができるものとします。

#### 信用取引の指図範囲(信託約款)

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

#### 先物取引等の運用指図(信託約款)

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

#### スワップ取引の運用指図(信託約款)

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

#### 有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

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

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

#### 公社債の借入れ(信託約款)

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

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

#### 直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

### 資金の借入れ(信託約款)

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

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

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

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

### 3【投資リスク】

#### 基準価額の変動要因

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

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

#### [株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

#### [REITの価格変動リスク]

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

#### [債券価格変動リスク]

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

#### [為替変動リスク]

ファンドは、実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本としますが、為替変動リスクを完全に排除できるわけではありません。また、円金利がヘッジ対

象通貨の金利より低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかるため、基準価額の変動要因となります。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

#### その他の留意点

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

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

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

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

ファンドの基準価額と対象指数（合成指数）は、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。また、ファンドの投資成果が合成指数に連動または上回ることを保証するものではありません。

投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

ファンドが実質的な投資対象とするREITの中には、流動性の低いものもあり、こうしたREITへの投資は、流動性の高い株式等に比べて制約を受けることが想定されます。

REITに関する法律（税制度、会計制度等）、不動産を取り巻く規制が変更となった場合、REITの価格や配当に影響が及ぶことが想定されます。

ファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国においては、政治、経済、社会情勢の変化が金融市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、当局による海外からの投資規制などが緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により、金融市場が著しい悪影響を被る可能性や運用上の制約を大きく受ける可能性があります。

金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、投資信託約款の規定に従い、委託会社の判断でファンドの購入・換金の各受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた購入・換金の各受け付けを取り消す場合があります。

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

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

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

#### 委託会社におけるリスクマネジメント体制

## リスク管理関連の委員会

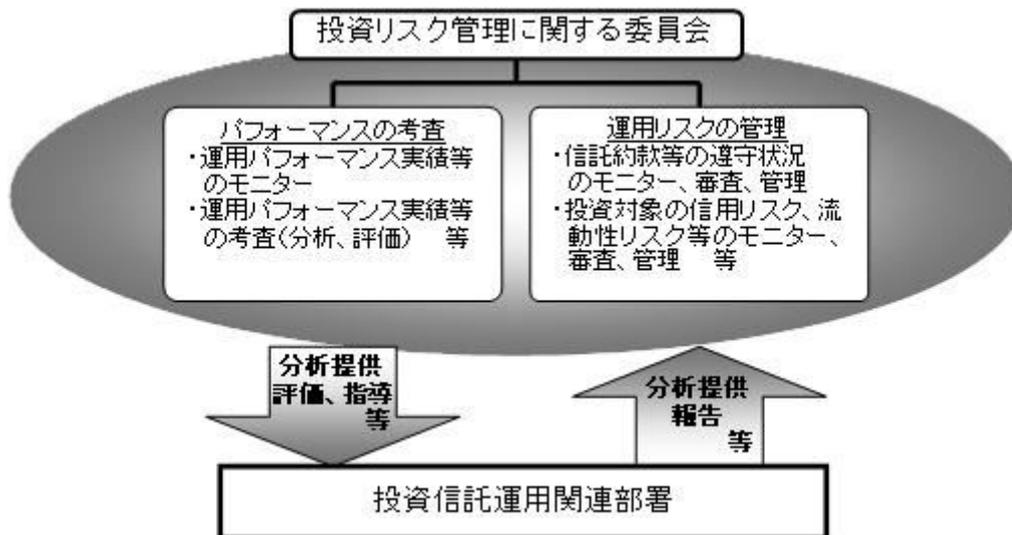
### パフォーマンスの考査

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

### 運用リスクの管理

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

## リスク管理体制図



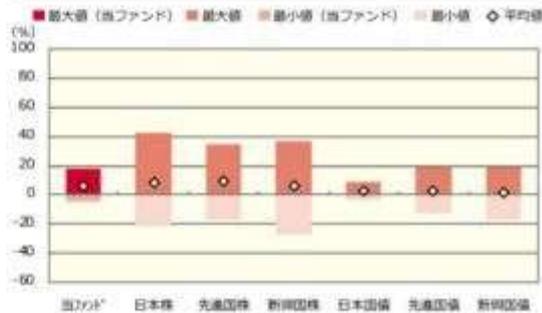
投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

## ■ リスクの定量的比較 (2014年10月末～2019年9月末：月次)

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



|         | 当ファンド | 日本株   | 先進国株  | 新興国株  | 日本国債 | 先進国債  | 新興国債  |
|---------|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|
| 最大値 (%) | 18.1  | 41.9  | 34.1  | 37.2  | 9.3  | 19.3  | 19.3  |
| 最小値 (%) | △4.7  | △22.0 | △17.5 | △27.4 | △4.0 | △12.3 | △17.4 |
| 平均値 (%) | 5.5   | 8.4   | 9.6   | 5.9   | 2.1  | 2.3   | 1.2   |

- \* 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。2014年10月末を10,000として指数化しております。
- \* 年間騰落率は、2014年10月から2019年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2014年10月から2019年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

### <代表的な資産クラスの指数>

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

### ■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)・・・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)は、株式会社東京証券取引所 (東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など向指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
- MSCI-KOKUSAI 指数 (配当込み、円ベース)、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI 指数 (配当込み、円ベース)、MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース) は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
- JP モルガン・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値や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社 (以下、JPM) がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC (ここでは「JPMSEC」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) についての種別、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。
- JPMSEC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA、JPSI、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】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率）（税抜2.0%）以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

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

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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

## （２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

## （３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.55%（税抜年0.50%）以内（2019年11月28日現在 年0.55%（税抜年0.50%））の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り（税抜）とします。

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

\* 上記配分は、2019年11月28日現在の信託報酬率における配分です。

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

### 支払先の役務の内容

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

## （４）【その他の手数料等】

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

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

ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用は信託財産から支払われます。

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

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

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

なお、配当控除は適用されません。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

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

損益通算について

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

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

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

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

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

## 法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 換金（解約）時および償還時の課税について

### [ 個人の投資家の場合 ]

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

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

### [ 法人の投資家の場合 ]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

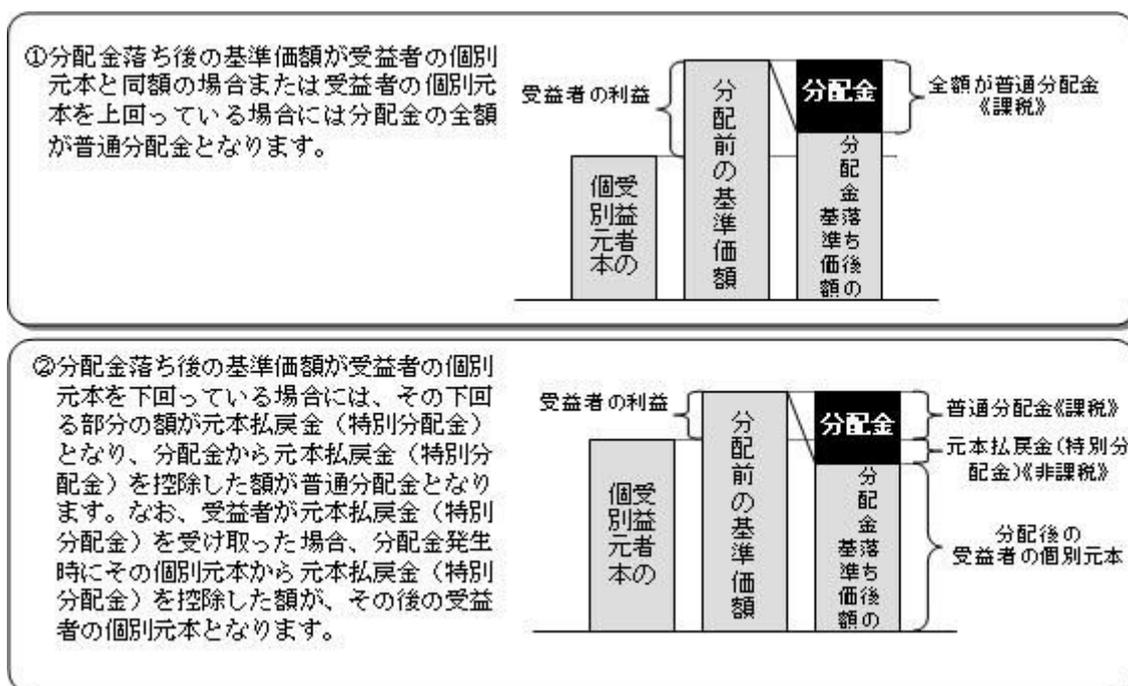
## 個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

## 分配金の課税について

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



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

ありません。

\* 2020年1月1日以降の分配時において、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（2019年9月末現在）が変更になる場合があります。

## 5【運用状況】

以下は2019年9月30日現在の運用状況であります。

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

### (1)【投資状況】

#### 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型

| 資産の種類              | 国/地域 | 時価合計(円)        | 投資比率(%) |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券          | 日本   | 10,815,897,973 | 99.90   |
| 現金・預金・その他資産(負債控除後) |      | 9,877,793      | 0.09    |
| 合計(純資産総額)          |      | 10,825,775,766 | 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   | 431,514,797,010 | 97.56   |
| 現金・預金・その他資産(負債控除後) |      | 10,768,822,098  | 2.43    |
| 合計(純資産総額)          |      | 442,283,619,108 | 100.00  |

### その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 資産の種類    | 建別 | 国/地域 | 時価合計(円)       | 投資比率(%) |
|----------|----|------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本   | 9,877,360,000 | 2.23    |

### (参考)外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円)        | 投資比率(%) |
|-------|------|----------------|---------|
| 株式    | アメリカ | 32,502,692,061 | 66.02   |
|       | カナダ  | 1,853,052,974  | 3.76    |
|       | ドイツ  | 1,512,574,167  | 3.07    |

|                    |          |                |        |
|--------------------|----------|----------------|--------|
|                    | イタリア     | 417,761,873    | 0.84   |
|                    | フランス     | 1,946,698,040  | 3.95   |
|                    | オランダ     | 655,274,825    | 1.33   |
|                    | スペイン     | 517,159,123    | 1.05   |
|                    | ベルギー     | 181,462,631    | 0.36   |
|                    | オーストリア   | 39,583,553     | 0.08   |
|                    | ルクセンブルグ  | 18,415,109     | 0.03   |
|                    | フィンランド   | 175,764,883    | 0.35   |
|                    | アイルランド   | 95,088,383     | 0.19   |
|                    | ポルトガル    | 28,120,507     | 0.05   |
|                    | イギリス     | 2,890,182,289  | 5.87   |
|                    | スイス      | 1,683,777,218  | 3.42   |
|                    | スウェーデン   | 457,380,669    | 0.92   |
|                    | ノルウェー    | 116,382,027    | 0.23   |
|                    | デンマーク    | 316,941,868    | 0.64   |
|                    | オーストラリア  | 1,159,373,494  | 2.35   |
|                    | ニュージーランド | 42,850,439     | 0.08   |
|                    | 香港       | 550,064,875    | 1.11   |
|                    | シンガポール   | 201,665,560    | 0.40   |
|                    | イスラエル    | 59,488,105     | 0.12   |
|                    | 小計       | 47,421,754,673 | 96.33  |
| 投資証券               | アメリカ     | 1,129,889,074  | 2.29   |
|                    | カナダ      | 8,387,971      | 0.01   |
|                    | フランス     | 54,296,104     | 0.11   |
|                    | イギリス     | 31,055,097     | 0.06   |
|                    | オーストラリア  | 102,388,164    | 0.20   |
|                    | 香港       | 33,695,488     | 0.06   |
|                    | シンガポール   | 24,510,742     | 0.04   |
|                    | 小計       | 1,384,222,640  | 2.81   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） |          | 419,387,301    | 0.85   |
| 合計（純資産総額）          |          | 49,225,364,614 | 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    | 895,574,120 | 1.81    |
|          | 買建 | カナダ     | 48,737,539  | 0.09    |
|          | 買建 | ドイツ     | 149,979,816 | 0.30    |
|          | 買建 | イギリス    | 78,430,404  | 0.15    |
|          | 買建 | スイス     | 43,599,906  | 0.08    |
|          | 買建 | オーストラリア | 36,594,870  | 0.07    |

## （参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

| 資産の種類              | 国/地域 | 時価合計（円）         | 投資比率（％） |
|--------------------|------|-----------------|---------|
| 国債証券               | 日本   | 567,087,585,560 | 80.26   |
| 地方債証券              | 日本   | 46,390,613,372  | 6.56    |
| 特殊債券               | 日本   | 59,590,428,626  | 8.43    |
| 社債券                | 日本   | 26,961,200,200  | 3.81    |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） |      | 6,452,850,537   | 0.91    |
| 合計（純資産総額）          |      | 706,482,678,295 | 100.00  |

## （参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

| 資産の種類              | 国/地域        | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|--------------------|-------------|----------------|---------|
| 国債証券               | アメリカ        | 27,873,886,103 | 46.98   |
|                    | カナダ         | 1,107,043,019  | 1.86    |
|                    | メキシコ        | 448,119,477    | 0.75    |
|                    | ドイツ         | 3,579,996,414  | 6.03    |
|                    | イタリア        | 5,699,757,586  | 9.60    |
|                    | フランス        | 5,805,226,062  | 9.78    |
|                    | オランダ        | 1,030,729,889  | 1.73    |
|                    | スペイン        | 3,589,810,748  | 6.05    |
|                    | ベルギー        | 1,474,079,847  | 2.48    |
|                    | オーストリア      | 868,377,002    | 1.46    |
|                    | フィンランド      | 351,227,310    | 0.59    |
|                    | アイルランド      | 543,278,427    | 0.91    |
|                    | イギリス        | 3,879,308,665  | 6.53    |
|                    | スウェーデン      | 190,574,140    | 0.32    |
|                    | ノルウェー       | 94,443,119     | 0.15    |
|                    | デンマーク       | 305,746,771    | 0.51    |
|                    | ポーランド       | 362,885,467    | 0.61    |
|                    | オーストラリア     | 1,238,120,397  | 2.08    |
|                    | シンガポール      | 501,564,107    | 0.84    |
| 南アフリカ              | 332,630,057 | 0.56           |         |
|                    | 小計          | 59,276,804,607 | 99.92   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） |             | 43,430,768     | 0.07    |
| 合計（純資産総額）          |             | 59,320,235,375 | 100.00  |

## （参考）新興国債券マザーファンド

| 資産の種類              | 国/地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 国債証券               | アメリカ | 20,704,812,181 | 98.18   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） |      | 382,887,998    | 1.81    |
| 合計（純資産総額）          |      | 21,087,700,179 | 100.00  |

（参考）J-REITインデックス マザーファンド

| 資産の種類              | 国/地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 投資証券               | 日本   | 45,630,870,750 | 96.93   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） |      | 1,440,498,929  | 3.06    |
| 合計（純資産総額）          |      | 47,071,369,679 | 100.00  |

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 資産の種類      | 建別 | 国/地域 | 時価合計（円）       | 投資比率（％） |
|------------|----|------|---------------|---------|
| REIT指数先物取引 | 買建 | 日本   | 1,034,136,000 | 2.19    |

（参考）海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域     | 時価合計（円）       | 投資比率（％） |
|-------|----------|---------------|---------|
| 投資証券  | アメリカ     | 5,038,919,037 | 73.85   |
|       | カナダ      | 128,939,773   | 1.88    |
|       | ドイツ      | 17,459,642    | 0.25    |
|       | イタリア     | 1,443,621     | 0.02    |
|       | フランス     | 220,393,251   | 3.23    |
|       | オランダ     | 16,753,648    | 0.24    |
|       | スペイン     | 43,936,485    | 0.64    |
|       | ベルギー     | 66,542,036    | 0.97    |
|       | アイルランド   | 15,862,360    | 0.23    |
|       | イギリス     | 317,781,350   | 4.65    |
|       | オーストラリア  | 431,610,446   | 6.32    |
|       | ニュージーランド | 27,950,414    | 0.40    |
|       | 香港       | 140,866,348   | 2.06    |
|       | シンガポール   | 239,164,728   | 3.50    |
|       | イスラエル    | 5,088,465     | 0.07    |
| 小計    |          | 6,712,711,604 | 98.38   |

|                    |  |               |        |
|--------------------|--|---------------|--------|
| 現金・預金・その他資産(負債控除後) |  | 109,914,719   | 1.61   |
| 合計(純資産総額)          |  | 6,822,626,323 | 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 | 221,736,743 | 3.25    |

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型

| 順位 | 国/地域 | 種類        | 銘柄名                       | 数量            | 簿価単価(円) | 簿価金額(円)       | 評価単価(円) | 評価金額(円)       | 投資比率(%) |
|----|------|-----------|---------------------------|---------------|---------|---------------|---------|---------------|---------|
| 1  | 日本   | 親投資信託受益証券 | 国内株式マザーファンド               | 1,157,112,266 | 1.5370  | 1,778,481,553 | 1.6014  | 1,852,999,582 | 17.11   |
| 2  | 日本   | 親投資信託受益証券 | J-REITインデックスマザーファンド       | 692,091,984   | 2.5949  | 1,795,949,772 | 2.6697  | 1,847,677,969 | 17.06   |
| 3  | 日本   | 親投資信託受益証券 | 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド | 1,133,491,152 | 1.5742  | 1,784,394,929 | 1.5975  | 1,810,752,115 | 16.72   |
| 4  | 日本   | 親投資信託受益証券 | 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド         | 913,824,817   | 1.9669  | 1,797,427,601 | 1.9648  | 1,795,483,000 | 16.58   |
| 5  | 日本   | 親投資信託受益証券 | 新興国債券マザーファンド              | 617,018,456   | 1.9088  | 1,177,821,344 | 1.9082  | 1,177,394,617 | 10.87   |
| 6  | 日本   | 親投資信託受益証券 | 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド         | 963,671,464   | 1.2115  | 1,167,549,539 | 1.2116  | 1,167,584,345 | 10.78   |
| 7  | 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   | 859,870,241   | 1.3620  | 1,171,157,801 | 1.3537  | 1,164,006,345 | 10.75   |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.90   |
| 合計        | 99.90   |

## (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 | 2,116,400  | 6,589.50 | 13,946,019,435 | 7,216.00 | 15,271,942,400 | 3.45    |
| 2  | 日本   | 株式 | ソニー               | 電気機器  | 1,274,900  | 5,479.04 | 6,985,233,642  | 6,347.00 | 8,091,790,300  | 1.82    |
| 3  | 日本   | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業   | 12,894,500 | 524.82   | 6,767,397,639  | 548.40   | 7,071,343,800  | 1.59    |

|    |    |    |                 |        |            |           |               |           |               |      |
|----|----|----|-----------------|--------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 4  | 日本 | 株式 | 日本電信電話          | 情報・通信業 | 1,274,700  | 4,783.38  | 6,097,384,776 | 5,156.00  | 6,572,353,200 | 1.48 |
| 5  | 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ      | 情報・通信業 | 1,478,700  | 5,362.61  | 7,929,700,302 | 4,240.00  | 6,269,688,000 | 1.41 |
| 6  | 日本 | 株式 | キーエンス           | 電気機器   | 93,200     | 66,567.41 | 6,204,082,696 | 66,900.00 | 6,235,080,000 | 1.40 |
| 7  | 日本 | 株式 | 武田薬品工業          | 医薬品    | 1,658,000  | 4,233.51  | 7,019,171,680 | 3,690.00  | 6,118,020,000 | 1.38 |
| 8  | 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業    | 1,320,200  | 3,862.80  | 5,099,671,536 | 3,695.00  | 4,878,139,000 | 1.10 |
| 9  | 日本 | 株式 | 本田技研工業          | 輸送用機器  | 1,602,100  | 2,827.80  | 4,530,430,400 | 2,798.50  | 4,483,476,850 | 1.01 |
| 10 | 日本 | 株式 | 任天堂             | その他製品  | 108,700    | 37,287.43 | 4,053,143,765 | 40,020.00 | 4,350,174,000 | 0.98 |
| 11 | 日本 | 株式 | KDDI            | 情報・通信業 | 1,527,700  | 2,585.32  | 3,949,603,348 | 2,825.00  | 4,315,752,500 | 0.97 |
| 12 | 日本 | 株式 | リクルートホールディングス   | サービス業  | 1,300,000  | 3,287.31  | 4,273,503,015 | 3,286.00  | 4,271,800,000 | 0.96 |
| 13 | 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ  | 銀行業    | 25,453,200 | 166.81    | 4,245,953,730 | 165.60    | 4,215,049,920 | 0.95 |
| 14 | 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス    | 保険業    | 669,800    | 5,486.33  | 3,674,747,364 | 5,779.00  | 3,870,774,200 | 0.87 |
| 15 | 日本 | 株式 | 信越化学工業          | 化学     | 327,800    | 9,625.31  | 3,155,179,409 | 11,560.00 | 3,789,368,000 | 0.85 |
| 16 | 日本 | 株式 | 東海旅客鉄道          | 陸運業    | 170,100    | 22,144.99 | 3,766,864,094 | 22,220.00 | 3,779,622,000 | 0.85 |
| 17 | 日本 | 株式 | 第一三共            | 医薬品    | 543,500    | 5,629.79  | 3,059,795,142 | 6,804.00  | 3,697,974,000 | 0.83 |
| 18 | 日本 | 株式 | ダイキン工業          | 機械     | 259,200    | 13,655.16 | 3,539,418,030 | 14,180.00 | 3,675,456,000 | 0.83 |
| 19 | 日本 | 株式 | ファナック           | 電気機器   | 180,500    | 19,209.62 | 3,467,337,516 | 20,340.00 | 3,671,370,000 | 0.83 |
| 20 | 日本 | 株式 | 花王              | 化学     | 454,700    | 8,391.36  | 3,815,552,025 | 7,984.00  | 3,630,324,800 | 0.82 |
| 21 | 日本 | 株式 | オリエンタルランド       | サービス業  | 214,400    | 12,711.48 | 2,725,343,359 | 16,440.00 | 3,524,736,000 | 0.79 |
| 22 | 日本 | 株式 | 三菱商事            | 卸売業    | 1,312,600  | 2,830.96  | 3,715,923,048 | 2,651.00  | 3,479,702,600 | 0.78 |
| 23 | 日本 | 株式 | 東日本旅客鉄道         | 陸運業    | 334,300    | 9,944.00  | 3,324,280,684 | 10,310.00 | 3,446,633,000 | 0.77 |
| 24 | 日本 | 株式 | 日立製作所           | 電気機器   | 855,000    | 3,710.77  | 3,172,714,353 | 4,023.00  | 3,439,665,000 | 0.77 |
| 25 | 日本 | 株式 | HOYA            | 精密機器   | 382,300    | 7,807.95  | 2,984,981,398 | 8,819.00  | 3,371,503,700 | 0.76 |
| 26 | 日本 | 株式 | 日本電産            | 電気機器   | 228,500    | 14,835.55 | 3,389,925,432 | 14,520.00 | 3,317,820,000 | 0.75 |
| 27 | 日本 | 株式 | 資生堂             | 化学     | 377,400    | 8,433.63  | 3,182,855,040 | 8,629.00  | 3,256,584,600 | 0.73 |
| 28 | 日本 | 株式 | NTTドコモ          | 情報・通信業 | 1,180,000  | 2,441.06  | 2,880,453,110 | 2,753.00  | 3,248,540,000 | 0.73 |
| 29 | 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業    | 784,000    | 3,728.49  | 2,923,142,731 | 4,132.00  | 3,239,488,000 | 0.73 |
| 30 | 日本 | 株式 | 村田製作所           | 電気機器   | 597,700    | 5,028.67  | 3,005,640,938 | 5,185.00  | 3,099,074,500 | 0.70 |

## 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  | 0.10    |
|    |       | 鉱業      | 0.26    |
|    |       | 建設業     | 2.82    |
|    |       | 食料品     | 3.96    |
|    |       | 繊維製品    | 0.64    |
|    |       | パルプ・紙   | 0.24    |
|    |       | 化学      | 7.09    |
|    |       | 医薬品     | 5.39    |
|    |       | 石油・石炭製品 | 0.54    |
|    |       | ゴム製品    | 0.74    |

|     |            |       |
|-----|------------|-------|
|     | ガラス・土石製品   | 0.79  |
|     | 鉄鋼         | 0.74  |
|     | 非鉄金属       | 0.72  |
|     | 金属製品       | 0.55  |
|     | 機械         | 4.92  |
|     | 電気機器       | 13.69 |
|     | 輸送用機器      | 7.66  |
|     | 精密機器       | 2.19  |
|     | その他製品      | 2.20  |
|     | 電気・ガス業     | 1.60  |
|     | 陸運業        | 4.60  |
|     | 海運業        | 0.16  |
|     | 空運業        | 0.51  |
|     | 倉庫・運輸関連業   | 0.18  |
|     | 情報・通信業     | 8.34  |
|     | 卸売業        | 4.73  |
|     | 小売業        | 4.68  |
|     | 銀行業        | 5.73  |
|     | 証券、商品先物取引業 | 0.76  |
|     | 保険業        | 2.26  |
|     | その他金融業     | 1.09  |
|     | 不動産業       | 2.48  |
|     | サービス業      | 5.06  |
| 合 計 |            | 97.56 |

## (参考) 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

| 順位 | 国/<br>地域 | 種類 | 銘柄名                 | 業種                   | 数量     | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----------|----|---------------------|----------------------|--------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | アメリカ     | 株式 | MICROSOFT CORP      | ソフトウェア               | 87,460 | 13,592.72       | 1,188,819,535   | 14,863.82       | 1,299,989,837   | 2.64            |
| 2  | アメリカ     | 株式 | APPLE INC           | コンピュータ・周辺機器          | 55,040 | 21,618.53       | 1,189,884,133   | 23,615.05       | 1,299,772,594   | 2.64            |
| 3  | アメリカ     | 株式 | AMAZON.COM INC      | インターネット販売・通信販売       | 5,031  | 203,795.89      | 1,025,297,126   | 186,210.56      | 936,825,348     | 1.90            |
| 4  | アメリカ     | 株式 | FACEBOOK INC-A      | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 28,930 | 20,249.86       | 585,828,641     | 19,112.63       | 552,928,444     | 1.12            |
| 5  | 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 | 3,777  | 125,239.80      | 473,030,733     | 132,211.71      | 499,363,639     | 1.01            |
| 6  | アメリカ     | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行                   | 39,100 | 12,110.42       | 473,517,787     | 12,704.34       | 496,739,788     | 1.00            |
| 7  | 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 | 3,610  | 125,786.36      | 454,088,770     | 132,304.52      | 477,619,332     | 0.97            |

|    |      |    |                              |                         |         |           |             |           |             |      |
|----|------|----|------------------------------|-------------------------|---------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| 8  | アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON            | 医薬品                     | 32,010  | 14,900.24 | 476,956,723 | 13,878.51 | 444,251,169 | 0.90 |
| 9  | スイス  | 株式 | NESTLE SA-REG                | 食品                      | 36,910  | 10,634.09 | 392,504,400 | 11,726.37 | 432,820,538 | 0.87 |
| 10 | アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO          | 家庭用品                    | 30,260  | 11,360.33 | 343,763,690 | 13,443.59 | 406,803,167 | 0.82 |
| 11 | アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP             | 石油・ガス・消耗燃料              | 51,100  | 8,224.08  | 420,250,584 | 7,714.12  | 394,191,614 | 0.80 |
| 12 | アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES      | 情報技術サービス                | 20,980  | 17,360.00 | 364,212,932 | 18,778.07 | 393,964,118 | 0.80 |
| 13 | アメリカ | 株式 | AT & T INC                   | 各種電気通信サービス              | 88,100  | 3,312.04  | 291,791,012 | 4,039.44  | 355,875,157 | 0.72 |
| 14 | アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B  | 各種金融サービス                | 15,700  | 22,431.64 | 352,176,782 | 22,388.00 | 351,491,663 | 0.71 |
| 15 | アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP         | 銀行                      | 109,100 | 3,186.35  | 347,631,789 | 3,167.45  | 345,569,013 | 0.70 |
| 16 | アメリカ | 株式 | HOME DEPOT                   | 専門小売り                   | 13,290  | 21,109.24 | 280,541,874 | 24,806.49 | 329,678,268 | 0.66 |
| 17 | アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS       | 各種電気通信サービス              | 50,000  | 6,101.22  | 305,061,447 | 6,507.57  | 325,378,800 | 0.66 |
| 18 | アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC               | 情報技術サービス                | 10,980  | 26,690.18 | 293,058,177 | 29,044.50 | 318,908,715 | 0.64 |
| 19 | アメリカ | 株式 | DISNEY (WALT) CO             | 娯楽                      | 21,740  | 14,435.54 | 313,828,710 | 14,025.28 | 304,909,657 | 0.61 |
| 20 | アメリカ | 株式 | INTEL CORP                   | 半導体・半導体製造装置             | 54,200  | 5,026.47  | 272,434,956 | 5,480.17  | 297,025,626 | 0.60 |
| 21 | アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP                 | 石油・ガス・消耗燃料              | 23,030  | 13,036.07 | 300,220,852 | 12,799.31 | 294,768,155 | 0.59 |
| 22 | アメリカ | 株式 | COCA COLA CO                 | 飲料                      | 49,000  | 5,173.62  | 253,507,684 | 5,861.13  | 287,195,625 | 0.58 |
| 23 | アメリカ | 株式 | WELLS FARGO CO               | 銀行                      | 51,700  | 5,033.30  | 260,222,071 | 5,472.62  | 282,934,619 | 0.57 |
| 24 | アメリカ | 株式 | MERCK & CO INC               | 医薬品                     | 31,130  | 8,506.33  | 264,802,222 | 8,947.64  | 278,540,257 | 0.56 |
| 25 | アメリカ | 株式 | CISCO SYSTEMS                | 通信機器                    | 51,800  | 5,692.34  | 294,863,364 | 5,270.81  | 273,028,103 | 0.55 |
| 26 | アメリカ | 株式 | BOEING CO                    | 航空宇宙・防衛                 | 6,470   | 38,200.41 | 247,156,658 | 41,318.25 | 267,329,085 | 0.54 |
| 27 | スイス  | 株式 | ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE) | 医薬品                     | 8,500   | 28,388.81 | 241,304,920 | 31,422.76 | 267,093,528 | 0.54 |
| 28 | 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 | 11,490  | 25,615.93 | 294,327,087 | 23,230.85 | 266,922,572 | 0.54 |
| 29 | アメリカ | 株式 | COMCAST CORP-CL A            | メディア                    | 54,800  | 4,636.11  | 254,058,917 | 4,835.89  | 265,007,057 | 0.53 |
| 30 | アメリカ | 株式 | PFIZER INC                   | 医薬品                     | 67,200  | 4,353.82  | 292,577,133 | 3,908.86  | 262,675,553 | 0.53 |

## 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 | 3.30    |
|    |       | メディア                 | 1.29    |
|    |       | 娯楽                   | 1.28    |
|    |       | 不動産管理・開発             | 0.47    |
|    |       | エネルギー設備・サービス         | 0.28    |
|    |       | 石油・ガス・消耗燃料           | 5.26    |
|    |       | 化学                   | 2.25    |
|    |       | 建設資材                 | 0.30    |
|    |       | 容器・包装                | 0.28    |
|    |       | 金属・鉱業                | 1.36    |
|    |       | 紙製品・林産品              | 0.08    |

|                         |      |
|-------------------------|------|
| 航空宇宙・防衛                 | 2.45 |
| 建設関連製品                  | 0.39 |
| 建設・土木                   | 0.33 |
| 電気設備                    | 0.68 |
| コングロマリット                | 1.27 |
| 機械                      | 1.57 |
| 商社・流通業                  | 0.26 |
| 商業サービス・用品               | 0.50 |
| 航空貨物・物流サービス             | 0.49 |
| 旅客航空輸送業                 | 0.10 |
| 海運業                     | 0.05 |
| 陸運・鉄道                   | 1.05 |
| 運送インフラ                  | 0.20 |
| 自動車部品                   | 0.28 |
| 自動車                     | 0.77 |
| 家庭用耐久財                  | 0.38 |
| レジャー用品                  | 0.05 |
| 繊維・アパレル・贅沢品             | 1.47 |
| ホテル・レストラン・レジャー          | 1.86 |
| 販売                      | 0.05 |
| インターネット販売・通信販売          | 2.50 |
| 複合小売り                   | 0.53 |
| 専門小売り                   | 1.74 |
| 食品・生活必需品小売り             | 1.57 |
| 飲料                      | 2.07 |
| 食品                      | 2.09 |
| タバコ                     | 0.80 |
| 家庭用品                    | 1.49 |
| パーソナル用品                 | 0.75 |
| ヘルスケア機器・用品              | 2.78 |
| ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 1.73 |
| バイオテクノロジー               | 1.78 |
| 医薬品                     | 5.40 |
| 銀行                      | 7.84 |
| 各種金融サービス                | 0.95 |
| 保険                      | 3.90 |
| 情報技術サービス                | 4.16 |
| ソフトウェア                  | 5.14 |
| 通信機器                    | 0.84 |
| コンピュータ・周辺機器             | 2.92 |
| 電子装置・機器・部品              | 0.51 |
| 半導体・半導体製造装置             | 3.05 |

|      |                    |       |
|------|--------------------|-------|
|      | 各種電気通信サービス         | 2.19  |
|      | 無線通信サービス           | 0.29  |
|      | 電力                 | 2.22  |
|      | ガス                 | 0.21  |
|      | 総合公益事業             | 1.11  |
|      | 水道                 | 0.09  |
|      | 消費者金融              | 0.48  |
|      | 資本市場               | 2.85  |
|      | 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 | 0.11  |
|      | 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  | 0.74  |
|      | 専門サービス             | 0.77  |
| 投資証券 |                    | 2.81  |
| 合計   |                    | 99.14 |

## (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<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|------|---------------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>50回 | 7,950,000,000 | 102.10          | 8,117,583,000   | 103.65          | 8,240,493,000   | 0.1       | 2028/3/20  | 1.16            |
| 2  | 日本   | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>34回 | 7,600,000,000 | 104.14          | 7,914,972,000   | 104.60          | 7,950,132,000   | 0.6       | 2024/6/20  | 1.12            |
| 3  | 日本   | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年)第13<br>0回  | 7,500,000,000 | 100.83          | 7,562,325,000   | 100.96          | 7,572,075,000   | 0.1       | 2021/12/20 | 1.07            |
| 4  | 日本   | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年)第12<br>6回  | 7,500,000,000 | 100.47          | 7,535,475,000   | 100.49          | 7,537,125,000   | 0.1       | 2020/12/20 | 1.06            |
| 5  | 日本   | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年)第12<br>9回  | 7,000,000,000 | 100.75          | 7,052,810,000   | 100.84          | 7,058,940,000   | 0.1       | 2021/9/20  | 0.99            |
| 6  | 日本   | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>51回 | 6,600,000,000 | 102.65          | 6,774,950,000   | 103.62          | 6,839,382,000   | 0.1       | 2028/6/20  | 0.96            |
| 7  | 日本   | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>43回 | 6,400,000,000 | 102.36          | 6,551,204,000   | 103.20          | 6,604,928,000   | 0.1       | 2026/6/20  | 0.93            |
| 8  | 日本   | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>53回 | 6,100,000,000 | 102.88          | 6,275,960,000   | 103.44          | 6,310,389,000   | 0.1       | 2028/12/20 | 0.89            |
| 9  | 日本   | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年)第13<br>3回  | 6,200,000,000 | 101.25          | 6,277,820,000   | 101.36          | 6,284,630,000   | 0.1       | 2022/9/20  | 0.88            |
| 10 | 日本   | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>41回 | 6,000,000,000 | 103.74          | 6,224,664,000   | 104.23          | 6,253,860,000   | 0.3       | 2025/12/20 | 0.88            |
| 11 | 日本   | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年)第13<br>7回  | 6,000,000,000 | 101.58          | 6,095,130,000   | 101.85          | 6,111,120,000   | 0.1       | 2023/9/20  | 0.86            |
| 12 | 日本   | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年)第12<br>7回  | 6,000,000,000 | 100.54          | 6,032,520,000   | 100.60          | 6,036,180,000   | 0.1       | 2021/3/20  | 0.85            |

|    |    |      |                           |               |        |               |        |               |     |            |      |
|----|----|------|---------------------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-----|------------|------|
| 13 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>47回 | 5,700,000,000 | 102.57 | 5,846,628,000 | 103.61 | 5,905,770,000 | 0.1 | 2027/6/20  | 0.83 |
| 14 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>48回 | 5,500,000,000 | 102.50 | 5,637,920,000 | 103.64 | 5,700,530,000 | 0.1 | 2027/9/20  | 0.80 |
| 15 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>32回 | 5,400,000,000 | 103.78 | 5,604,390,000 | 104.06 | 5,619,672,000 | 0.6 | 2023/12/20 | 0.79 |
| 16 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>46回 | 5,400,000,000 | 102.26 | 5,522,148,000 | 103.52 | 5,590,566,000 | 0.1 | 2027/3/20  | 0.79 |
| 17 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>29回 | 5,300,000,000 | 104.23 | 5,524,190,000 | 104.39 | 5,532,670,000 | 0.8 | 2023/6/20  | 0.78 |
| 18 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>44回 | 5,300,000,000 | 102.23 | 5,418,455,000 | 103.28 | 5,474,264,000 | 0.1 | 2026/9/20  | 0.77 |
| 19 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>35回 | 5,200,000,000 | 103.95 | 5,405,912,000 | 104.35 | 5,426,252,000 | 0.5 | 2024/9/20  | 0.76 |
| 20 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年)第12<br>8回  | 5,200,000,000 | 100.62 | 5,232,396,000 | 100.71 | 5,237,232,000 | 0.1 | 2021/6/20  | 0.74 |
| 21 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>49回 | 5,000,000,000 | 102.16 | 5,108,150,000 | 103.67 | 5,183,800,000 | 0.1 | 2027/12/20 | 0.73 |
| 22 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>45回 | 5,000,000,000 | 102.27 | 5,113,500,000 | 103.40 | 5,170,450,000 | 0.1 | 2026/12/20 | 0.73 |
| 23 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>28回 | 5,000,000,000 | 103.17 | 5,158,800,000 | 103.36 | 5,168,450,000 | 0.6 | 2023/3/20  | 0.73 |
| 24 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(20年)第1<br>47回 | 4,200,000,000 | 122.12 | 5,129,262,000 | 122.92 | 5,162,850,000 | 1.6 | 2033/12/20 | 0.73 |
| 25 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>12回 | 4,950,000,000 | 102.36 | 5,067,265,500 | 101.84 | 5,041,129,500 | 1.2 | 2020/12/20 | 0.71 |
| 26 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>52回 | 4,800,000,000 | 101.99 | 4,895,793,000 | 103.54 | 4,970,064,000 | 0.1 | 2028/9/20  | 0.70 |
| 27 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年)第13<br>1回  | 4,800,000,000 | 100.84 | 4,840,488,000 | 101.09 | 4,852,512,000 | 0.1 | 2022/3/20  | 0.68 |
| 28 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年)第3<br>55回 | 4,500,000,000 | 103.34 | 4,650,480,000 | 103.22 | 4,645,260,000 | 0.1 | 2029/6/20  | 0.65 |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(20年)第1<br>50回 | 3,830,000,000 | 120.08 | 4,599,276,000 | 120.59 | 4,618,826,800 | 1.4 | 2034/9/20  | 0.65 |
| 30 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年)第13<br>5回  | 4,500,000,000 | 101.19 | 4,553,920,000 | 101.63 | 4,573,440,000 | 0.1 | 2023/3/20  | 0.64 |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類    | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券  | 80.26   |
| 地方債証券 | 6.56    |
| 特殊債券  | 8.43    |
| 社債券   | 3.81    |
| 合計    | 99.08   |

## (参考) 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

| 順位 | 国/地域 | 種類   | 銘柄名                            | 数量        | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|------|--------------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 6,150,000 | 10,905.40       | 670,682,111     | 10,880.94       | 669,178,347     | 2.125     | 2021/8/15  | 1.12            |
| 2  | イギリス | 国債証券 | UK TREASURY                    | 2,080,000 | 22,968.63       | 477,747,691     | 23,709.04       | 493,148,223     | 4.25      | 2046/12/7  | 0.83            |
| 3  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 4,200,000 | 11,822.29       | 496,536,525     | 11,720.28       | 492,251,775     | 2.75      | 2028/2/15  | 0.82            |
| 4  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>BOND            | 3,450,000 | 14,409.00       | 497,110,697     | 14,195.69       | 489,751,490     | 3.75      | 2043/11/15 | 0.82            |
| 5  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 3,600,000 | 13,005.20       | 468,187,302     | 12,804.53       | 460,963,388     | 3         | 2048/2/15  | 0.77            |
| 6  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 4,200,000 | 10,872.94       | 456,663,480     | 10,802.96       | 453,724,335     | 1.625     | 2026/5/15  | 0.76            |
| 7  | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT<br>OF)            | 3,500,000 | 12,931.00       | 452,585,102     | 12,872.76       | 450,546,602     | 1.75      | 2023/5/25  | 0.75            |
| 8  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 4,000,000 | 11,218.62       | 448,744,829     | 11,148.64       | 445,945,643     | 2.25      | 2024/11/15 | 0.75            |
| 9  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 4,000,000 | 11,065.17       | 442,606,900     | 11,003.62       | 440,144,943     | 2         | 2024/6/30  | 0.74            |
| 10 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 4,000,000 | 10,914.67       | 436,586,949     | 10,896.12       | 435,845,021     | 2.375     | 2021/4/15  | 0.73            |
| 11 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 4,000,000 | 10,699.25       | 427,970,229     | 10,683.23       | 427,329,443     | 1.125     | 2021/8/31  | 0.72            |
| 12 | イタリア | 国債証券 | BUONI<br>POLIENNALI DEL<br>TES | 2,180,000 | 18,322.60       | 399,432,789     | 18,810.02       | 410,058,602     | 4.75      | 2044/9/1   | 0.69            |
| 13 | イタリア | 国債証券 | BUONI<br>POLIENNALI DEL<br>TES | 3,100,000 | 13,134.44       | 407,167,820     | 13,221.78       | 409,875,199     | 2.2       | 2027/6/1   | 0.69            |
| 14 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 3,800,000 | 10,786.09       | 409,871,718     | 10,712.74       | 407,084,337     | 1.5       | 2026/8/15  | 0.68            |
| 15 | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT<br>OF)            | 3,010,000 | 13,479.38       | 405,729,423     | 13,413.53       | 403,747,538     | 2.25      | 2024/5/25  | 0.68            |
| 16 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 3,700,000 | 10,743.09       | 397,494,634     | 10,736.35       | 397,245,069     | 1.375     | 2021/4/30  | 0.66            |
| 17 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 3,400,000 | 11,801.22       | 401,241,492     | 11,625.85       | 395,278,912     | 2.5       | 2046/5/15  | 0.66            |
| 18 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 3,580,000 | 10,842.58       | 388,164,632     | 10,830.78       | 387,742,038     | 2         | 2021/2/28  | 0.65            |
| 19 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 3,400,000 | 11,393.14       | 387,367,027     | 11,331.60       | 385,274,400     | 2.75      | 2024/2/15  | 0.64            |
| 20 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 3,500,000 | 11,056.74       | 386,985,925     | 10,994.35       | 384,802,250     | 2         | 2024/4/30  | 0.64            |
| 21 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>BOND            | 2,680,000 | 14,465.91       | 387,686,554     | 14,342.82       | 384,387,590     | 6.5       | 2026/11/15 | 0.64            |
| 22 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 3,020,000 | 12,919.20       | 390,159,947     | 12,726.12       | 384,329,072     | 3         | 2045/11/15 | 0.64            |
| 23 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 3,500,000 | 10,893.17       | 381,261,125     | 10,874.62       | 380,611,900     | 2.125     | 2021/6/30  | 0.64            |
| 24 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 3,500,000 | 10,704.31       | 374,651,025     | 10,664.68       | 373,264,075     | 1.25      | 2023/7/31  | 0.62            |
| 25 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 3,400,000 | 10,865.35       | 369,421,936     | 10,834.15       | 368,361,294     | 1.75      | 2022/5/31  | 0.62            |
| 26 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 3,200,000 | 11,374.59       | 363,987,154     | 11,282.69       | 361,046,343     | 2.25      | 2027/8/15  | 0.60            |
| 27 | イギリス | 国債証券 | UK TREASURY                    | 1,550,000 | 22,544.03       | 349,432,480     | 23,130.52       | 358,523,072     | 4.5       | 2042/12/7  | 0.60            |
| 28 | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT<br>OF)            | 3,000,000 | 11,964.51       | 358,935,406     | 11,938.07       | 358,142,312     | 0         | 2021/5/25  | 0.60            |
| 29 | イタリア | 国債証券 | BUONI<br>POLIENNALI DEL<br>TES | 3,000,000 | 11,948.46       | 358,453,884     | 11,936.42       | 358,092,743     | 0.45      | 2021/6/1   | 0.60            |
| 30 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 3,000,000 | 11,791.10       | 353,733,086     | 11,683.18       | 350,495,486     | 2.625     | 2029/2/15  | 0.59            |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 99.92   |
| 合計   | 99.92   |

## （参考）新興国債券マザーファンド

| 順位 | 国/<br>地域 | 種類   | 銘柄名                        | 数量        | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----------|------|----------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | アメリカ     | 国債証券 | RUSSIAN<br>FEDERATION      | 4,200,000 | 11,155.69       | 468,538,997     | 12,888.07       | 541,299,200     | 5.25      | 2047/6/23  | 2.56            |
| 2  | アメリカ     | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>COLOMBIA    | 2,500,000 | 11,185.90       | 279,647,700     | 12,651.02       | 316,275,748     | 5         | 2045/6/15  | 1.49            |
| 3  | アメリカ     | 国債証券 | UNITED MEXICAN<br>STATES   | 2,110,000 | 12,329.86       | 260,160,046     | 13,584.53       | 286,633,750     | 6.05      | 2040/1/11  | 1.35            |
| 4  | アメリカ     | 国債証券 | TURKEY GLOBAL              | 2,400,000 | 10,568.71       | 253,649,125     | 11,506.09       | 276,146,301     | 7.375     | 2025/2/5   | 1.30            |
| 5  | アメリカ     | 国債証券 | UNITED MEXICAN<br>STATES   | 2,300,000 | 10,931.10       | 251,415,504     | 11,415.34       | 262,552,956     | 4.15      | 2027/3/28  | 1.24            |
| 6  | アメリカ     | 国債証券 | FED REPUBLIC OF<br>BRAZIL  | 2,300,000 | 10,974.85       | 252,421,642     | 11,411.35       | 262,461,116     | 4.25      | 2025/1/7   | 1.24            |
| 7  | アメリカ     | 国債証券 | PHILIPPINES<br>GLOBAL      | 2,200,000 | 10,863.57       | 238,998,660     | 11,335.55       | 249,382,287     | 3         | 2028/2/1   | 1.18            |
| 8  | アメリカ     | 国債証券 | UNITED MEXICAN<br>STATES   | 2,000,000 | 10,367.06       | 207,341,300     | 11,563.73       | 231,274,718     | 4.6       | 2048/2/10  | 1.09            |
| 9  | アメリカ     | 国債証券 | FED REPUBLIC OF<br>BRAZIL  | 1,900,000 | 10,674.63       | 202,818,103     | 12,120.87       | 230,296,585     | 5.625     | 2047/2/21  | 1.09            |
| 10 | アメリカ     | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>TURKEY      | 2,100,000 | 9,579.96        | 201,179,186     | 10,643.36       | 223,510,597     | 6         | 2027/3/25  | 1.05            |
| 11 | アメリカ     | 国債証券 | UNITED MEXICAN<br>STATES   | 1,950,000 | 11,137.36       | 217,178,613     | 11,415.50       | 222,602,402     | 4         | 2023/10/2  | 1.05            |
| 12 | アメリカ     | 国債証券 | UNITED MEXICAN<br>STATES   | 1,700,000 | 11,993.96       | 203,897,357     | 13,058.32       | 221,991,440     | 5.55      | 2045/1/21  | 1.05            |
| 13 | アメリカ     | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>PERU        | 1,400,000 | 13,800.27       | 193,203,780     | 15,796.89       | 221,156,571     | 5.625     | 2050/11/18 | 1.04            |
| 14 | アメリカ     | 国債証券 | FED REPUBLIC OF<br>BRAZIL  | 1,900,000 | 10,875.74       | 206,639,172     | 11,485.49       | 218,224,384     | 4.625     | 2028/1/13  | 1.03            |
| 15 | アメリカ     | 国債証券 | FED REPUBLIC OF<br>BRAZIL  | 1,800,000 | 10,971.86       | 197,493,600     | 12,114.12       | 218,054,303     | 5.625     | 2041/1/7   | 1.03            |
| 16 | アメリカ     | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>PHILIPPINES | 1,700,000 | 11,485.46       | 195,252,965     | 12,763.02       | 216,971,351     | 3.95      | 2040/1/20  | 1.02            |
| 17 | アメリカ     | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>COLOMBIA    | 1,900,000 | 11,075.29       | 210,430,510     | 11,388.36       | 216,378,952     | 4         | 2024/2/26  | 1.02            |
| 18 | アメリカ     | 国債証券 | RUSSIAN<br>FEDERATION      | 1,600,000 | 11,993.75       | 191,900,149     | 13,363.85       | 213,821,637     | 5.625     | 2042/4/4   | 1.01            |
| 19 | アメリカ     | 国債証券 | RUSSIAN<br>FEDERATION      | 1,800,000 | 11,167.45       | 201,014,167     | 11,822.58       | 212,806,477     | 4.75      | 2026/5/27  | 1.00            |
| 20 | アメリカ     | 国債証券 | RUSSIAN<br>FEDERATION      | 1,800,000 | 11,365.05       | 204,570,993     | 11,802.28       | 212,441,081     | 4.875     | 2023/9/16  | 1.00            |
| 21 | アメリカ     | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>PHILIPPINES | 1,700,000 | 11,101.28       | 188,721,819     | 12,490.56       | 212,339,637     | 3.7       | 2042/2/2   | 1.00            |
| 22 | アメリカ     | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>TURKEY      | 2,400,000 | 7,725.08        | 185,402,070     | 8,683.89        | 208,413,377     | 4.875     | 2043/4/16  | 0.98            |
| 23 | アメリカ     | 国債証券 | UNITED MEXICAN<br>STATES   | 1,700,000 | 10,325.56       | 175,534,686     | 11,510.96       | 195,686,372     | 4.6       | 2046/1/23  | 0.92            |
| 24 | アメリカ     | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>ARGENTINA   | 4,100,000 | 8,343.56        | 342,086,165     | 4,762.07        | 195,245,195     | 7.5       | 2026/4/22  | 0.92            |
| 25 | アメリカ     | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>PANAMA      | 1,700,000 | 11,142.74       | 189,426,580     | 11,426.03       | 194,242,510     | 3.75      | 2025/3/16  | 0.92            |
| 26 | アメリカ     | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>TURKEY      | 1,700,000 | 10,364.22       | 176,191,854     | 11,092.58       | 188,574,023     | 6.25      | 2022/9/26  | 0.89            |
| 27 | アメリカ     | 国債証券 | COLOMBIA GLOBAL            | 1,220,000 | 14,010.71       | 170,930,711     | 15,378.70       | 187,620,237     | 7.375     | 2037/9/18  | 0.88            |
| 28 | アメリカ     | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>COLOMBIA    | 1,320,000 | 12,779.93       | 168,695,148     | 14,083.66       | 185,904,417     | 6.125     | 2041/1/18  | 0.88            |

|    |      |      |                       |           |           |             |           |             |       |           |      |
|----|------|------|-----------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|-----------|------|
| 29 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF INDONESIA | 1,400,000 | 11,740.59 | 164,368,333 | 13,229.35 | 185,210,938 | 5.25  | 2047/1/8  | 0.87 |
| 30 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF TURKEY    | 1,600,000 | 11,299.00 | 180,784,130 | 11,512.32 | 184,197,165 | 7.625 | 2029/4/26 | 0.87 |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.18   |
| 合計   | 98.18   |

## (参考) J - R E I Tインデックス マザーファンド

| 順位 | 国/地域 | 種類   | 銘柄名                      | 数量     | 簿価単価(円) | 簿価金額(円)       | 評価単価(円) | 評価金額(円)       | 投資比率(%) |
|----|------|------|--------------------------|--------|---------|---------------|---------|---------------|---------|
| 1  | 日本   | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 投資証券        | 4,001  | 751,959 | 3,008,591,319 | 830,000 | 3,320,830,000 | 7.05    |
| 2  | 日本   | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券    | 4,132  | 657,808 | 2,718,064,639 | 725,000 | 2,995,700,000 | 6.36    |
| 3  | 日本   | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券   | 12,885 | 167,758 | 2,161,563,376 | 195,200 | 2,515,152,000 | 5.34    |
| 4  | 日本   | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 投資証券        | 8,233  | 198,821 | 1,636,894,280 | 236,000 | 1,942,988,000 | 4.12    |
| 5  | 日本   | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券     | 9,277  | 178,478 | 1,655,748,291 | 207,000 | 1,920,339,000 | 4.07    |
| 6  | 日本   | 投資証券 | 日本リテールファンド投資法人 投資証券      | 7,809  | 218,637 | 1,707,341,096 | 228,600 | 1,785,137,400 | 3.79    |
| 7  | 日本   | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 投資証券      | 5,936  | 233,631 | 1,386,837,889 | 296,100 | 1,757,649,600 | 3.73    |
| 8  | 日本   | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 投資証券        | 5,570  | 258,248 | 1,438,446,094 | 304,000 | 1,693,280,000 | 3.59    |
| 9  | 日本   | 投資証券 | G L P 投資法人 投資証券          | 10,291 | 118,572 | 1,220,224,863 | 143,400 | 1,475,729,400 | 3.13    |
| 10 | 日本   | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券     | 3,919  | 318,496 | 1,248,186,451 | 355,000 | 1,391,245,000 | 2.95    |
| 11 | 日本   | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人 投資証券     | 2,615  | 472,273 | 1,234,994,025 | 513,000 | 1,341,495,000 | 2.84    |
| 12 | 日本   | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人 投資証券        | 18,124 | 60,024  | 1,087,875,700 | 66,700  | 1,208,870,800 | 2.56    |
| 13 | 日本   | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人 投資証券       | 12,081 | 78,460  | 947,881,783   | 96,900  | 1,170,648,900 | 2.48    |
| 14 | 日本   | 投資証券 | アクティブピア・プロパティーズ投資法人 投資証券 | 2,070  | 472,179 | 977,411,627   | 552,000 | 1,142,640,000 | 2.42    |
| 15 | 日本   | 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券     | 1,278  | 754,448 | 964,184,774   | 854,000 | 1,091,412,000 | 2.31    |
| 16 | 日本   | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券    | 13,310 | 87,627  | 1,166,318,963 | 80,600  | 1,072,786,000 | 2.27    |
| 17 | 日本   | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券  | 1,373  | 591,249 | 811,785,439   | 673,000 | 924,029,000   | 1.96    |
| 18 | 日本   | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人 投資証券         | 4,754  | 152,359 | 724,315,541   | 171,600 | 815,786,400   | 1.73    |
| 19 | 日本   | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人 投資証券        | 954    | 763,728 | 728,597,275   | 839,000 | 800,406,000   | 1.70    |
| 20 | 日本   | 投資証券 | 産業ファンド投資法人 投資証券          | 5,084  | 130,453 | 663,224,475   | 155,200 | 789,036,800   | 1.67    |
| 21 | 日本   | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券   | 2,700  | 247,737 | 668,891,061   | 267,400 | 721,980,000   | 1.53    |
| 22 | 日本   | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人 投資証券       | 3,514  | 184,626 | 648,775,974   | 198,600 | 697,880,400   | 1.48    |

|    |    |      |                                   |       |         |             |         |             |      |
|----|----|------|-----------------------------------|-------|---------|-------------|---------|-------------|------|
| 23 | 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 投資証券                | 1,468 | 467,145 | 685,769,476 | 460,500 | 676,014,000 | 1.43 |
| 24 | 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人 投資証券                   | 4,459 | 136,437 | 608,373,563 | 148,900 | 663,945,100 | 1.41 |
| 25 | 日本 | 投資証券 | ジャパンエクセレント投資法人 投資証券               | 3,700 | 160,909 | 595,365,520 | 176,400 | 652,680,000 | 1.38 |
| 26 | 日本 | 投資証券 | 日本リート投資法人 投資証券                    | 1,342 | 421,984 | 566,303,588 | 451,500 | 605,913,000 | 1.28 |
| 27 | 日本 | 投資証券 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券           | 1,720 | 300,814 | 517,401,232 | 347,000 | 596,840,000 | 1.26 |
| 28 | 日本 | 投資証券 | ラサールロジポート投資法人 投資証券                | 3,842 | 128,702 | 494,474,082 | 154,800 | 594,741,600 | 1.26 |
| 29 | 日本 | 投資証券 | プレミアム投資法人 投資証券                    | 3,732 | 136,852 | 510,734,574 | 158,600 | 591,895,200 | 1.25 |
| 30 | 日本 | 投資証券 | M C U B S M i d C i t y 投資法人 投資証券 | 4,901 | 105,057 | 514,886,464 | 118,700 | 581,748,700 | 1.23 |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 96.93   |
| 合計   | 96.93   |

## (参考) 海外 R E I T インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 順位 | 国/地域    | 種類   | 銘柄名                          | 数量      | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|---------|------|------------------------------|---------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | アメリカ    | 投資証券 | PROLOGIS INC                 | 29,580  | 9,128.91        | 270,033,423     | 9,257.37        | 273,833,229     | 4.01            |
| 2  | アメリカ    | 投資証券 | EQUINIX INC                  | 3,970   | 61,279.34       | 243,278,992     | 62,228.83       | 247,048,457     | 3.62            |
| 3  | アメリカ    | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 14,440  | 16,196.77       | 233,881,474     | 17,047.04       | 246,159,304     | 3.60            |
| 4  | アメリカ    | 投資証券 | PUBLIC STORAGE               | 7,040   | 27,865.31       | 196,171,793     | 26,441.47       | 186,148,014     | 2.72            |
| 5  | アメリカ    | 投資証券 | WELLTOWER INC                | 18,910  | 9,830.43        | 185,893,485     | 9,744.09        | 184,260,871     | 2.70            |
| 6  | アメリカ    | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL           | 16,260  | 9,280.04        | 150,893,463     | 9,308.10        | 151,349,706     | 2.21            |
| 7  | アメリカ    | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 6,510   | 23,171.50       | 150,846,486     | 23,124.01       | 150,537,360     | 2.20            |
| 8  | アメリカ    | 投資証券 | VENTAS INC                   | 17,380  | 8,052.99        | 139,960,973     | 7,948.30        | 138,141,593     | 2.02            |
| 9  | アメリカ    | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 9,720   | 13,670.22       | 132,874,600     | 13,905.49       | 135,161,382     | 1.98            |
| 10 | アメリカ    | 投資証券 | REALTY INCOME CORP           | 14,850  | 8,094.00        | 120,195,900     | 8,323.86        | 123,609,464     | 1.81            |
| 11 | 香港      | 投資証券 | LINK REIT                    | 98,500  | 1,230.14        | 121,169,184     | 1,177.85        | 116,018,816     | 1.70            |
| 12 | アメリカ    | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 3,070   | 35,043.78       | 107,584,412     | 35,219.69       | 108,124,454     | 1.58            |
| 13 | フランス    | 投資証券 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 6,460   | 14,162.40       | 91,489,104      | 15,531.43       | 100,333,051     | 1.47            |
| 14 | アメリカ    | 投資証券 | BOSTON PROPERTIES            | 6,710   | 13,988.59       | 93,863,441      | 14,042.55       | 94,225,513      | 1.38            |
| 15 | アメリカ    | 投資証券 | HCP INC                      | 22,930  | 3,814.97        | 87,477,308      | 3,833.31        | 87,897,991      | 1.28            |
| 16 | アメリカ    | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 5,290   | 16,424.34       | 86,884,784      | 16,523.63       | 87,410,009      | 1.28            |
| 17 | アメリカ    | 投資証券 | WP CAREY INC                 | 7,970   | 9,728.98        | 77,540,034      | 9,717.11        | 77,445,421      | 1.13            |
| 18 | オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP                | 75,000  | 1,020.32        | 76,524,000      | 1,023.96        | 76,797,300      | 1.12            |
| 19 | アメリカ    | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 6,000   | 13,079.90       | 78,479,424      | 12,593.18       | 75,559,109      | 1.10            |
| 20 | アメリカ    | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 5,320   | 13,851.53       | 73,690,150      | 14,065.21       | 74,826,936      | 1.09            |
| 21 | オーストラリア | 投資証券 | SCENTRE GROUP                | 250,000 | 290.06          | 72,515,600      | 287.14          | 71,786,800      | 1.05            |
| 22 | アメリカ    | 投資証券 | UDR INC                      | 13,700  | 5,218.26        | 71,490,201      | 5,215.77        | 71,456,098      | 1.04            |
| 23 | アメリカ    | 投資証券 | INVITATION HOMES INC         | 22,200  | 3,098.00        | 68,775,746      | 3,195.51        | 70,940,349      | 1.03            |
| 24 | アメリカ    | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC          | 4,230   | 16,003.45       | 67,694,622      | 16,002.37       | 67,690,057      | 0.99            |

|    |      |      |                             |        |           |            |           |            |      |
|----|------|------|-----------------------------|--------|-----------|------------|-----------|------------|------|
| 25 | アメリカ | 投資証券 | HOST HOTELS & RESORTS INC   | 34,100 | 1,804.42  | 61,530,804 | 1,846.51  | 62,966,032 | 0.92 |
| 26 | アメリカ | 投資証券 | DUKE REALTY CORP            | 16,890 | 3,604.52  | 60,880,478 | 3,673.59  | 62,047,050 | 0.90 |
| 27 | アメリカ | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 4,250  | 14,569.20 | 61,919,100 | 14,398.68 | 61,194,417 | 0.89 |
| 28 | アメリカ | 投資証券 | REGENCY CENTERS CORP        | 7,830  | 7,185.31  | 56,261,006 | 7,455.11  | 58,373,540 | 0.85 |
| 29 | イギリス | 投資証券 | SEGRO PLC                   | 50,700 | 1,042.94  | 52,877,231 | 1,070.01  | 54,249,617 | 0.79 |
| 30 | アメリカ | 投資証券 | CAMDEN PROPERTY TRUST       | 4,520  | 11,817.24 | 53,413,925 | 11,961.85 | 54,067,575 | 0.79 |

### 種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.38   |
| 合計   | 98.38   |

#### 【投資不動産物件】

野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型

該当事項はありません。

(参考) 国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) J-REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型

該当事項はありません。

## （参考）国内株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 種類           | 取引所   | 名称                 | 買建/<br>売建 | 枚数  | 通貨  | 帳簿価額<br>(円)   | 評価額<br>(円)    | 投資<br>比率<br>(%) |
|--------------|-------|--------------------|-----------|-----|-----|---------------|---------------|-----------------|
| 株価指数先物<br>取引 | 大阪取引所 | TOPIX先物(2019年12月限) | 買建        | 622 | 日本円 | 9,971,895,292 | 9,877,360,000 | 2.23            |

## （参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 種類               | 国/地<br>域        | 取引所  | 名称   | 買建/<br>売建 | 枚数 | 通貨                 | 帳簿価額        | 帳簿価額<br>(円) | 評価額       | 評価額<br>(円)  | 投資<br>比率<br>(%) |
|------------------|-----------------|--|--|-----------|----|--------------------|-------------|-------------|-----------|-------------|-----------------|
| 株価指<br>数先物<br>取引 | アメリカ            | シカゴ<br>マーカン<br>タイル取<br>引所  | E-mini S&P500株<br>価指数先物(2019<br>年12月限)       | 買建        | 56 | 米ドル                | 8,405,137.5 | 907,082,439 | 8,298,500 | 895,574,120 | 1.81            |
|                  | カナダ             | モント<br>リアル取<br>引所  | S&P TSX60株価指<br>数先物(2019年12<br>月限)           | 買建        | 3  | カナダ<br>ドル          | 599,112     | 48,821,637  | 598,080   | 48,737,539  | 0.09            |
|                  | ドイツ             | ユーレ<br>ック<br>ス・ド<br>イツ<br>金融先<br>物取<br>引所  | ユーロ50株価指<br>数先物(2019年12<br>月限)               | 買建        | 36 | ユーロ                | 1,262,100   | 148,953,042 | 1,270,800 | 149,979,816 | 0.30            |
|                  | オース<br>トラ<br>リア | シド<br>ニー先<br>物取<br>引所  | SP1200株価指<br>数先物(2019年12<br>月限)              | 買建        | 3  | 豪ドル                | 499,825     | 36,427,246  | 502,125   | 36,594,870  | 0.07            |
|                  | イギリ<br>ス        | ロ<br>ン<br>ド<br>ン<br>国<br>際<br>金<br>融<br>先<br>物<br>オ<br>プ<br>シ<br>ョ<br>ン<br>取<br>引<br>所 | FT100株価指<br>数先物(2019年12<br>月限)               | 買建        | 8  | 英ポ<br>ンド           | 582,615     | 77,307,184  | 591,080   | 78,430,404  | 0.15            |
|                  | スイス             | ユー<br>レ<br>ッ<br>ク<br>ス<br>・<br>チ<br>ュ<br>ー<br>リ<br>ッ<br>ヒ<br>取<br>引<br>所               | SMI株<br>価指<br>数先<br>物<br>(2019<br>年12<br>月限) | 買建        | 4  | スイ<br>ス<br>フ<br>ラン | 399,700     | 43,519,335  | 400,440   | 43,599,906  | 0.08            |

## （参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 種類             | 取引所   | 名称                  | 買建/<br>売建 | 枚数  | 通貨  | 帳簿価額<br>(円)   | 評価額<br>(円)    | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------------|-------|---------------------|-----------|-----|-----|---------------|---------------|-----------------|
| REIT指数先物<br>取引 | 大阪取引所 | REIT指数先物(2019年12月限) | 買建        | 477 | 日本円 | 1,016,777,016 | 1,034,136,000 | 2.19            |

## （参考）海外 R E I Tインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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<br>域 | 取引所                              | 名称                                   | 買建/<br>売建 | 枚数 | 通貨  | 帳簿価額      | 帳簿価額<br>(円) | 評価額       | 評価額<br>(円)  | 投資<br>比率<br>(%) |
|------------------|----------|----------------------------------|--------------------------------------|-----------|----|-----|-----------|-------------|-----------|-------------|-----------------|
| 株価指<br>数先物<br>取引 | アメリ<br>カ | シカゴ<br>ボード<br>オ<br>ブ<br>トレ<br>ード | ダウ・ジョーンズ<br>米国不動産指数先<br>物(2019年12月限) | 買建        | 56 | 米ドル | 2,038,870 | 220,034,848 | 2,054,640 | 221,736,743 | 3.25            |

## （3）【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型

2019年9月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

|        |               | 純資産総額（百万円） |        | 1口当たり純資産額（円） |        |
|--------|---------------|------------|--------|--------------|--------|
|        |               | （分配落）      | （分配付）  | （分配落）        | （分配付）  |
| 第1計算期間 | (2014年 9月 8日) | 643        | 643    | 1.1364       | 1.1364 |
| 第2計算期間 | (2015年 9月 7日) | 1,879      | 1,879  | 1.1491       | 1.1491 |
| 第3計算期間 | (2016年 9月 6日) | 2,813      | 2,813  | 1.2795       | 1.2795 |
| 第4計算期間 | (2017年 9月 6日) | 4,900      | 4,900  | 1.3162       | 1.3162 |
| 第5計算期間 | (2018年 9月 6日) | 7,472      | 7,472  | 1.3695       | 1.3695 |
| 第6計算期間 | (2019年 9月 6日) | 10,413     | 10,413 | 1.4703       | 1.4703 |
|        | 2018年 9月末日    | 7,667      |        | 1.3898       |        |
|        | 10月末日         | 7,825      |        | 1.3396       |        |
|        | 11月末日         | 8,215      |        | 1.3600       |        |
|        | 12月末日         | 8,054      |        | 1.3035       |        |
|        | 2019年 1月末日    | 8,606      |        | 1.3694       |        |

|      |        |  |        |
|------|--------|--|--------|
| 2月末日 | 8,643  |  | 1.3885 |
| 3月末日 | 8,820  |  | 1.4108 |
| 4月末日 | 8,888  |  | 1.4160 |
| 5月末日 | 8,998  |  | 1.3983 |
| 6月末日 | 9,417  |  | 1.4300 |
| 7月末日 | 9,829  |  | 1.4555 |
| 8月末日 | 10,167 |  | 1.4551 |
| 9月末日 | 10,825 |  | 1.4882 |

## 【分配の推移】

野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型

|        | 計算期間                    | 1口当たりの分配金 |
|--------|-------------------------|-----------|
| 第1計算期間 | 2013年 9月12日～2014年 9月 8日 | 0.0000円   |
| 第2計算期間 | 2014年 9月 9日～2015年 9月 7日 | 0.0000円   |
| 第3計算期間 | 2015年 9月 8日～2016年 9月 6日 | 0.0000円   |
| 第4計算期間 | 2016年 9月 7日～2017年 9月 6日 | 0.0000円   |
| 第5計算期間 | 2017年 9月 7日～2018年 9月 6日 | 0.0000円   |
| 第6計算期間 | 2018年 9月 7日～2019年 9月 6日 | 0.0000円   |

## 【収益率の推移】

野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型

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

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

## （４）【設定及び解約の実績】

野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型

|  | 計算期間 | 設定口数 | 解約口数 | 発行済み口数 |
|--|------|------|------|--------|
|--|------|------|------|--------|

|        |                         |               |               |               |
|--------|-------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 第1計算期間 | 2013年 9月12日～2014年 9月 8日 | 664,849,801   | 98,191,649    | 566,658,152   |
| 第2計算期間 | 2014年 9月 9日～2015年 9月 7日 | 1,605,724,941 | 536,415,481   | 1,635,967,612 |
| 第3計算期間 | 2015年 9月 8日～2016年 9月 6日 | 1,024,082,214 | 461,295,091   | 2,198,754,735 |
| 第4計算期間 | 2016年 9月 7日～2017年 9月 6日 | 2,316,145,480 | 791,558,944   | 3,723,341,271 |
| 第5計算期間 | 2017年 9月 7日～2018年 9月 6日 | 2,702,679,152 | 969,694,777   | 5,456,325,646 |
| 第6計算期間 | 2018年 9月 7日～2019年 9月 6日 | 3,211,652,592 | 1,585,250,907 | 7,082,727,331 |

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（2019年9月30日現在）

### ■ 基準価額・純資産の推移（日次：設定来）



### ■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

|         |     |
|---------|-----|
| 2019年9月 | 0 円 |
| 2018年9月 | 0 円 |
| 2017年9月 | 0 円 |
| 2016年9月 | 0 円 |
| 2015年9月 | 0 円 |
| 設定来累計   | 0 円 |

### ■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

| 銘柄                        | 投資比率（%） |
|---------------------------|---------|
| 国内株式マザーファンド               | 17.1    |
| 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド         | 16.6    |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド  | 10.8    |
| 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド         | 10.8    |
| 新興国債券マザーファンド              | 10.9    |
| J-REITインデックス マザーファンド      | 17.1    |
| 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド | 16.7    |

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                | 業種     | 投資比率（%） |
|----|-------------------|--------|---------|
| 1  | トヨタ自動車            | 輸送用機器  | 0.6     |
| 2  | ソニー               | 電気機器   | 0.3     |
| 3  | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 0.3     |
| 4  | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 0.3     |
| 5  | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 0.2     |

・「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                | 業種                   | 投資比率（%） |
|----|-------------------|----------------------|---------|
| 1  | MICROSOFT CORP    | ソフトウェア               | 0.4     |
| 2  | APPLE INC         | コンピュータ・周辺機器          | 0.4     |
| 3  | AMAZON.COM INC    | インターネット販売・通信販売       | 0.3     |
| 4  | FACEBOOK INC-A    | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 0.2     |
| 5  | ALPHABET INC-CL C | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 0.2     |

・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                | 種類   | 投資比率（%） |
|----|-------------------|------|---------|
| 1  | 国庫債券 利付（10年）第350回 | 国債証券 | 0.1     |
| 2  | 国庫債券 利付（10年）第334回 | 国債証券 | 0.1     |
| 3  | 国庫債券 利付（5年）第130回  | 国債証券 | 0.1     |
| 4  | 国庫債券 利付（5年）第126回  | 国債証券 | 0.1     |
| 5  | 国庫債券 利付（5年）第129回  | 国債証券 | 0.1     |

## ・「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

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

## ・「新興国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                    | 種類   | 投資比率 (%) |
|----|-----------------------|------|----------|
| 1  | RUSSIAN FEDERATION    | 国債証券 | 0.3      |
| 2  | REPUBLIC OF COLOMBIA  | 国債証券 | 0.2      |
| 3  | UNITED MEXICAN STATES | 国債証券 | 0.1      |
| 4  | TURKEY GLOBAL         | 国債証券 | 0.1      |
| 5  | UNITED MEXICAN STATES | 国債証券 | 0.1      |

## ・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                     | 種類   | 投資比率 (%) |
|----|------------------------|------|----------|
| 1  | 日本ビルファンド投資法人 投資証券      | 投資証券 | 1.2      |
| 2  | ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券  | 投資証券 | 1.1      |
| 3  | 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券 | 投資証券 | 0.9      |
| 4  | オリックス不動産投資法人 投資証券      | 投資証券 | 0.7      |
| 5  | ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券   | 投資証券 | 0.7      |

## ・「海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                       | 種類   | 投資比率 (%) |
|----|--------------------------|------|----------|
| 1  | PROLOGIS INC             | 投資証券 | 0.7      |
| 2  | EQUINIX INC              | 投資証券 | 0.6      |
| 3  | SIMON PROPERTY GROUP INC | 投資証券 | 0.6      |
| 4  | PUBLIC STORAGE           | 投資証券 | 0.5      |
| 5  | WELLTOWER INC            | 投資証券 | 0.5      |

## ■ 年間収益率の推移 (暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2010年から2012年は対象指数（合成指数）の年間収益率。（出所：MSCI他）
- ・2013年は設定日（2013年9月12日）から年末までのファンドの収益率。
- ・2019年は年初から運用実績作成基準日までのファンドの収益率。

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

- ・申込期間中の各営業日に、受益権の募集が行なわれます。
- ・取得申込の受付については、午後3時までに、取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日の申込み分とします。
- ・販売会社の営業日であっても、下記の条件に該当する日（「申込不可日」といいます。）には、原則とし

て取得の申込みができません。

○申込日当日あるいは申込日の翌営業日が、「ニューヨーク証券取引所」または「ニューヨークの銀行」の休業日と同日の場合

申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・販売会社の定める期日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。
- ・販売の単位は、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円単位とします。

#### 積立方式

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

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

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、委託者に1万口単位、1口単位または1円単位で一部解約の実行を請求することができます。
- ・受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
- ・一部解約の実行の請求の受け付けについては、午後3時までに、解約請求のお申込みが行なわれかつ、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。

- ・販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として受益権の一部解約の実行の請求の受付をいたしません。（申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。）
- ・換金価額は、解約申込みの受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額を差し引いた価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口解約には制限を設ける場合があります。
- ・解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

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

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

<基準価額の計算方法>

基準価額とは、計算日において、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法

により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

| 対象                | 評価方法  |
|-------------------|---|
| 株式                | 原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> 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 <sup>1</sup> における以下のいずれかの価額で評価します。 <sup>2</sup><br>日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)<br>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)<br>価格情報会社の提供する価額 |
| REIT<br>(不動産投資信託) | 原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> 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(2013年9月12日設定)。

## (4) 【計算期間】

原則として、毎年9月7日から翌年9月6日までとします。

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

ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

## (5) 【その他】

## (a) ファンドの繰上償還条項

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

## (b) 信託期間の終了

( )委託者は、上記「(a)ファンドの繰上償還条項」に従い信託期間を終了させるには、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知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。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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ないます。

( )上記( )から( )までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記( )から( )までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。

( )委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

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

## (c) 運用報告書

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

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

- ( )上記( )の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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っても、当該併合にかかると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ます。
- ( )委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

(i) 関係法人との契約の更新に関する手続

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

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

##### 収益分配金に対する請求権

###### 収益分配金の支払い開始日

収益分配金は、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、）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。販売会社でお受取り下さい。

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

###### 収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

##### 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、）に、原則として償還日(償還日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までに支払いを開始します。

###### 償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

##### 換金(解約)請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2018年9月7日から2019年9月6日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第5期<br>(2018年 9月 6日現在) | 第6期<br>(2019年 9月 6日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                        |                        |
| 流動資産            |                        |                        |
| コール・ローン         | 41,247,548             | 80,581,239             |
| 親投資信託受益証券       | 7,460,326,261          | 10,410,395,416         |
| 派生商品評価勘定        | 82,403                 | -                      |
| 流動資産合計          | 7,501,656,212          | 10,490,976,655         |
| <b>負債の部</b>     |                        |                        |
| 流動負債            |                        |                        |
| 派生商品評価勘定        | 2,544,591              | 10,018,664             |
| 未払解約金           | 7,940,425              | 41,869,271             |
| 未払受託者報酬         | 1,491,037              | 2,019,284              |
| 未払委託者報酬         | 17,146,846             | 23,221,721             |
| 未払利息            | 63                     | 134                    |
| その他未払費用         | 111,763                | 151,382                |
| 流動負債合計          | 29,234,725             | 77,280,456             |
| <b>負債合計</b>     |                        |                        |
|                 | 29,234,725             | 77,280,456             |
| <b>純資産の部</b>    |                        |                        |
| 元本等             |                        |                        |
| 元本              | 5,456,325,646          | 7,082,727,331          |
| 剰余金             |                        |                        |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 2,016,095,841          | 3,330,968,868          |
| (分配準備積立金)       | 369,436,393            | 917,619,501            |
| 元本等合計           | 7,472,421,487          | 10,413,696,199         |
| <b>純資産合計</b>    |                        |                        |
|                 | 7,472,421,487          | 10,413,696,199         |
| <b>負債純資産合計</b>  |                        |                        |
|                 | 7,501,656,212          | 10,490,976,655         |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|   | 第5期                 |                     | 第6期                 |                     |
|---|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
|   | 自<br>2017年<br>9月 7日 | 至<br>2018年<br>9月 6日 | 自<br>2018年<br>9月 7日 | 至<br>2019年<br>9月 6日 |
| 営業収益                                      |                     |                     |                     |                     |
| 有価証券売買等損益                                 | 283,335,531         |                     | 710,512,535         |                     |
| 為替差損益                                     | 30,012,681          |                     | 10,564,276          |                     |
| 営業収益合計                                    | 253,322,850         |                     | 721,076,811         |                     |
| 営業費用                                      |                     |                     |                     |                     |
| 支払利息                                      | 14,849              |                     | 24,013              |                     |
| 受託者報酬                                     | 2,711,545           |                     | 3,753,899           |                     |
| 委託者報酬                                     | 31,182,675          |                     | 43,169,778          |                     |
| その他費用                                     | 214,042             |                     | 292,219             |                     |
| 営業費用合計                                    | 34,123,111          |                     | 47,239,909          |                     |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 219,199,739         |                     | 673,836,902         |                     |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 219,199,739         |                     | 673,836,902         |                     |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           | 219,199,739         |                     | 673,836,902         |                     |
| 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（ ） | 28,377,012          |                     | 45,471,231          |                     |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 1,177,254,691       |                     | 2,016,095,841       |                     |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 962,042,557         |                     | 1,270,281,281       |                     |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 962,042,557         |                     | 1,270,281,281       |                     |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 314,024,134         |                     | 583,773,925         |                     |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 314,024,134         |                     | 583,773,925         |                     |
| 分配金                                       | -                   |                     | -                   |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           | 2,016,095,841       |                     | 3,330,968,868       |                     |

## (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<br>基準価額で評価しております。<br>為替予約取引<br>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。   |
| 2.費用・収益の計上基準              | 有価証券売買等損益<br>約定日基準で計上しております。<br>為替差損益<br>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<br>足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。 |
| 4.その他                     | 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年9月7日から2019年9月6日までとなっております。  |

(貸借対照表に関する注記)

| 第5期<br>2018年9月6日現在  | 第6期<br>2019年9月6日現在  |
|---|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>5,456,325,646口  | 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>7,082,727,331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<br>1口当たり純資産額 1.3695円<br>(10,000口当たり純資産額) (13,695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<br>1口当たり純資産額 1.4703円<br>(10,000口当たり純資産額) (14,703円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第5期<br>自 2017年 9月 7日<br>至 2018年 9月 6日  | 第6期<br>自 2018年 9月 7日<br>至 2019年 9月 6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>155,738,857円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填<br/>後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>35,083,870円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>1,646,659,448円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>178,613,666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>2,016,095,841円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>5,456,325,646口</td> </tr> </tbody> </table> | 項目                                    |                |  | 費用控除後の配当等収益額 | A | 155,738,857円 | 費用控除後・繰越欠損金補填<br>後の有価証券売買等損益額 | B | 35,083,870円 | 収益調整金額 | C | 1,646,659,448円 | 分配準備積立金額 | D | 178,613,666円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 2,016,095,841円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 5,456,325,646口 | <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>243,720,667円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填<br/>後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>384,645,004円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,413,349,367円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>289,253,830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>3,330,968,868円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>7,082,727,331口</td> </tr> </tbody> </table> | 項目 |  |  | 費用控除後の配当等収益額 | A | 243,720,667円 | 費用控除後・繰越欠損金補填<br>後の有価証券売買等損益額 | B | 384,645,004円 | 収益調整金額 | C | 2,413,349,367円 | 分配準備積立金額 | D | 289,253,830円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,330,968,868円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 7,082,727,331口 |
| 項目   |                                       |                |  |              |   |              |                               |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |   |    |  |  |              |   |              |                               |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |
| 費用控除後の配当等収益額   | A                                     | 155,738,857円   |  |              |   |              |                               |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |   |    |  |  |              |   |              |                               |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |
| 費用控除後・繰越欠損金補填<br>後の有価証券売買等損益額  | B                                     | 35,083,870円    |  |              |   |              |                               |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |   |    |  |  |              |   |              |                               |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |
| 収益調整金額   | C                                     | 1,646,659,448円 |  |              |   |              |                               |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |   |    |  |  |              |   |              |                               |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |
| 分配準備積立金額   | D                                     | 178,613,666円   |  |              |   |              |                               |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |   |    |  |  |              |   |              |                               |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |
| 当ファンドの分配対象収益額  | E=A+B+C+D                             | 2,016,095,841円 |  |              |   |              |                               |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |   |    |  |  |              |   |              |                               |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |
| 当ファンドの期末残存口数   | F                                     | 5,456,325,646口 |  |              |   |              |                               |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |   |    |  |  |              |   |              |                               |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |
| 項目   |                                       |                |  |              |   |              |                               |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |   |    |  |  |              |   |              |                               |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |
| 費用控除後の配当等収益額   | A                                     | 243,720,667円   |  |              |   |              |                               |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |   |    |  |  |              |   |              |                               |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |
| 費用控除後・繰越欠損金補填<br>後の有価証券売買等損益額  | B                                     | 384,645,004円   |  |              |   |              |                               |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |   |    |  |  |              |   |              |                               |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |
| 収益調整金額   | C                                     | 2,413,349,367円 |  |              |   |              |                               |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |   |    |  |  |              |   |              |                               |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |
| 分配準備積立金額   | D                                     | 289,253,830円   |  |              |   |              |                               |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |   |    |  |  |              |   |              |                               |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |
| 当ファンドの分配対象収益額  | E=A+B+C+D                             | 3,330,968,868円 |  |              |   |              |                               |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |   |    |  |  |              |   |              |                               |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |
| 当ファンドの期末残存口数   | F                                     | 7,082,727,331口 |  |              |   |              |                               |   |             |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |   |    |  |  |              |   |              |                               |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |

|                   |                       |        |                   |                       |        |
|-------------------|-----------------------|--------|-------------------|-----------------------|--------|
| 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 3,694円 | 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 4,702円 |
| 10,000口当たり分配金額    | H                     | 0円     | 10,000口当たり分配金額    | H                     | 0円     |
| 収益分配金金額           | $I=F \times H/10,000$ | 0円     | 収益分配金金額           | $I=F \times H/10,000$ | 0円     |

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

| 第5期<br>自 2017年 9月 7日<br>至 2018年 9月 6日  | 第6期<br>自 2018年 9月 7日<br>至 2019年 9月 6日  |
|--|--|
| <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>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>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p> | <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p> |

## (2)金融商品の時価等に関する事項

| 第5期<br>2018年 9月 6日現在  | 第6期<br>2019年 9月 6日現在                                      |
|---|---|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>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<br/>親投資信託受益証券<br/>（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<br/>デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3<br/>デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>同左</p> <p>2. 時価の算定方法<br/>同左</p> |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第5期<br>自 2017年 9月 7日<br>至 2018年 9月 6日                                 | 第6期<br>自 2018年 9月 7日<br>至 2019年 9月 6日 |
|---|---------------------------------------|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。 | 同左                                    |

（その他の注記）

1 元本の移動

| 第5期<br>自 2017年 9月 7日<br>至 2018年 9月 6日 | 第6期<br>自 2018年 9月 7日<br>至 2019年 9月 6日 |
|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 期首元本額 3,723,341,271円                  | 期首元本額 5,456,325,646円                  |
| 期中追加設定元本額 2,702,679,152円              | 期中追加設定元本額 3,211,652,592円              |
| 期中一部解約元本額 969,694,777円                | 期中一部解約元本額 1,585,250,907円              |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類        | 第5期<br>自 2017年 9月 7日<br>至 2018年 9月 6日 | 第6期<br>自 2018年 9月 7日<br>至 2019年 9月 6日 |
|-----------|---------------------------------------|---------------------------------------|
|           | 損益に含まれた評価差額（円）                        | 損益に含まれた評価差額（円）                        |
| 親投資信託受益証券 | 265,024,413                           | 658,936,171                           |

|    |             |             |
|----|-------------|-------------|
| 合計 | 265,024,413 | 658,936,171 |
|----|-------------|-------------|

## 3 デリバティブ取引関係

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

| 種類        | 第5期(2018年 9月 6日現在) |       |             |           | 第6期(2019年 9月 6日現在) |       |               |            |
|-----------|--------------------|-------|-------------|-----------|--------------------|-------|---------------|------------|
|           | 契約額等(円)            |       | 時価(円)       | 評価損益(円)   | 契約額等(円)            |       | 時価(円)         | 評価損益(円)    |
|           |                    | うち1年超 |             |           |                    | うち1年超 |               |            |
| 市場取引以外の取引 |                    |       |             |           |                    |       |               |            |
| 為替予約取引    |                    |       |             |           |                    |       |               |            |
| 売建        | 820,103,567        | -     | 822,565,755 | 2,462,188 | 1,146,034,226      | -     | 1,156,052,890 | 10,018,664 |
| 米ドル       | 820,103,567        | -     | 822,565,755 | 2,462,188 | 1,146,034,226      | -     | 1,156,052,890 | 10,018,664 |
| 合計        | 820,103,567        | -     | 822,565,755 | 2,462,188 | 1,146,034,226      | -     | 1,156,052,890 | 10,018,664 |

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2019年9月6日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2019年9月6日現在)

(単位:円)

| 種類 | 通貨  | 銘柄          | 券面総額          | 評価額           | 備考 |
|----|-----|-------------|---------------|---------------|----|
|    | 日本円 | 国内株式マザーファンド | 1,136,248,997 | 1,744,823,959 |    |

|           |                                |                        |                |                |
|-----------|--------------------------------|------------------------|----------------|----------------|
| 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  | 836,082,856            | 1,138,995,674  |                |
|           | J - R E I T インデックス マザーファンド     | 673,147,874            | 1,746,549,473  |                |
|           | 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド              | 888,541,821            | 1,747,584,053  |                |
|           | 新興国債券マザーファンド                   | 608,652,963            | 1,162,101,102  |                |
|           | 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド              | 937,425,045            | 1,135,971,669  |                |
|           | 海外 R E I T インデックス為替ヘッジ型マザーファンド | 1,101,816,585          | 1,734,369,486  |                |
|           | 小計                             | 銘柄数：7<br>組入時価比率：100.0% | 6,181,916,141  | 10,410,395,416 |
| 合計        |                                |                        | 10,410,395,416 |                |

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

### (参考)

当ファンドは「国内株式マザーファンド」、「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」、「国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「J - R E I T インデックス マザーファンド」および「海外 R E I T インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」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)

(2019年 9月 6日現在)

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| 資産の部        |                 |
| 流動資産        |                 |
| コール・ローン     | 69,800,911,155  |
| 株式          | 390,459,905,575 |
| 派生商品評価勘定    | 127,109,453     |
| 未収入金        | 34,676,729      |
| 未収配当金       | 200,729,231     |
| 未収利息        | 5,314,163       |
| その他未収収益     | 37,941,093      |
| 差入委託証拠金     | 196,181,000     |
| 流動資産合計      | 460,862,768,399 |
| 資産合計        | 460,862,768,399 |
| 負債の部        |                 |
| 流動負債        |                 |
| 未払金         | 1,356,723,912   |
| 未払解約金       | 501,664,973     |
| 未払利息        | 116,137         |
| 有価証券貸借取引受入金 | 59,665,769,690  |

(2019年 9月 6日現在)

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 流動負債合計          | 61,524,274,712  |
| 負債合計            | 61,524,274,712  |
| 純資産の部           |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 260,061,369,573 |
| 剰余金             |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 139,277,124,114 |
| 元本等合計           | 399,338,493,687 |
| 純資産合計           | 399,338,493,687 |
| 負債純資産合計         | 460,862,768,399 |

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

(貸借対照表に関する注記)

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| 2019年 9月 6日現在              |                 |
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |                 |
| 1口当たり純資産額                  | 1.5356円         |
| (10,000口当たり純資産額)           | (15,356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 |                 |
|                            | 57,927,519,530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 2018年 9月 7日<br>至 2019年 9月 6日 |   |
|--------------------------------|---|
| 1.金融商品に対する取組方針                 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。   |
| 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク        | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>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。<br>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。<br>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。   |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制               | 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。<br>市場リスクの管理<br>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。<br>信用リスクの管理<br>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。<br>流動性リスクの管理<br>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

| 2019年 9月 6日現在     |   |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ<br>ん。  |
| 2.時価の算定方法         | 株式<br>(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。<br>派生商品評価勘定<br>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。<br>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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<br>ます。 |

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2019年 9月 6日現在                    |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 期首                               | 2018年 9月 7日      |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 232,261,270,335円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 55,921,020,426円  |
| 同期中における一部解約元本額                   | 28,120,921,188円  |

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 期末元本額                              | 260,061,369,573円 |
| 期末元本額の内訳*                          |                  |
| バランスセレクト30                         | 177,999,974円     |
| バランスセレクト50                         | 403,271,217円     |
| バランスセレクト70                         | 506,606,675円     |
| 野村世界6資産分散投信（安定コース）                 | 2,720,034,622円   |
| 野村世界6資産分散投信（分配コース）                 | 3,898,539,864円   |
| 野村世界6資産分散投信（成長コース）                 | 8,208,624,950円   |
| 野村資産設計ファンド2015                     | 55,157,011円      |
| 野村資産設計ファンド2020                     | 60,832,548円      |
| 野村資産設計ファンド2025                     | 96,467,328円      |
| 野村資産設計ファンド2030                     | 113,731,547円     |
| 野村資産設計ファンド2035                     | 87,589,053円      |
| 野村資産設計ファンド2040                     | 193,968,035円     |
| 野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）            | 98,963,277,981円  |
| のむらっぴ・ファンド（保守型）                    | 3,079,560,632円   |
| のむらっぴ・ファンド（普通型）                    | 8,441,251,640円   |
| のむらっぴ・ファンド（積極型）                    | 2,203,767,481円   |
| 野村資産設計ファンド2045                     | 29,755,759円      |
| 野村インデックスファンド・TOPIX                 | 2,142,261,758円   |
| マイ・ロード                             | 4,103,001,086円   |
| ネクストコア                             | 122,618,607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      | 1,136,248,997円   |
| 野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）            | 2,005,703,963円   |
| 野村世界6資産分散投信（配分変更コース）               | 706,120,598円     |
| 野村資産設計ファンド2050                     | 48,743,999円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型 | 15,333,586円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型 | 6,419,811円       |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型 | 4,728,090円       |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型 | 3,012,190円       |
| のむらっぴ・ファンド（やや保守型）                  | 323,259,137円     |
| のむらっぴ・ファンド（やや積極型）                  | 287,191,087円     |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                  | 6,294,460円       |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                  | 4,399,127円       |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                  | 16,288,169円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                  | 4,535,319円       |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                  | 21,587,782円      |
| 野村6資産均等バランス                        | 756,191,930円     |
| 世界6資産分散ファンド                        | 152,240,594円     |
| ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式             | 410,890,609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）   | 494,119,825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）   | 366,170,617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）   | 760,692,889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）   | 833,680,710円     |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）   | 4,748,757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） | 10,871,228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）   | 2,577,065円       |
| 野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）       | 3,666,913,844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)   | 18,503,901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)   | 150,990,543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)    | 114,725,506円    |
| 野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)      | 46,700,330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)  | 112,547,048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)  | 292,927,455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)  | 4,927,564,954円  |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)             | 700,318,388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)      | 564,600,630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) | 2,874,185,620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)    | 304,927,089円    |
| TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)          | 617,639円        |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け)                | 7,684,967円      |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け)                | 33,700,281円     |
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け)                | 45,044,781円     |
| 国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)           | 125,815,010円    |
| マイバランス30(確定拠出年金向け)                  | 5,447,204,613円  |
| マイバランス50(確定拠出年金向け)                  | 16,199,068,914円 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け)                  | 20,924,229,999円 |
| 野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)    | 32,733,898,749円 |
| マイバランスDC30                          | 3,501,508,701円  |
| マイバランスDC50                          | 4,989,056,872円  |
| マイバランスDC70                          | 4,650,360,273円  |
| 野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX            | 10,340,154,610円 |
| 野村DC運用戦略ファンド                        | 1,212,871,710円  |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド)                  | 54,981,097円     |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け)               | 736,770,412円    |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け)               | 471,117,871円    |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け)               | 370,380,319円    |
| 野村世界6資産分散投信(DC)安定コース                | 4,185,350円      |
| 野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース              | 2,496,738円      |
| 野村世界6資産分散投信(DC)成長コース                | 29,376,838円     |
| 野村資産設計ファンド(DC)2030                  | 4,018,007円      |
| 野村資産設計ファンド(DC)2040                  | 2,916,682円      |
| 野村資産設計ファンド(DC)2050                  | 4,038,955円      |
| マイターゲット2035(確定拠出年金向け)               | 179,867,030円    |
| マイターゲット2045(確定拠出年金向け)               | 115,995,904円    |
| マイターゲット2055(確定拠出年金向け)               | 45,016,167円     |
| マイターゲット2060(確定拠出年金向け)               | 63,717,469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(2019年9月6日現在)

| 種類   | 通貨    | 銘柄             | 株式数       | 評価額              |             | 備考                       |
|------|-------|----------------|-----------|------------------|-------------|--------------------------|
|      |       |                |           | 単価               | 金額          |                          |
| 株式   | 日本円   | 極洋             | 7,800     | 2,799.00         | 21,832,200  |                          |
|      |       | 日本水産           | 241,000   | 604.00           | 145,564,000 | 貸付有価証券<br>33,500株        |
|      |       | マルハニチロ         | 34,800    | 2,701.00         | 93,994,800  | 貸付有価証券<br>4,000株         |
|      |       | カネコ種苗          | 7,300     | 1,141.00         | 8,329,300   | 貸付有価証券<br>800株           |
|      |       | サカタのタネ         | 28,700    | 3,680.00         | 105,616,000 | 貸付有価証券<br>3,900株         |
|      |       | ホクト            | 20,200    | 1,908.00         | 38,541,600  |                          |
|      |       | ホクリヨウ          | 3,300     | 600.00           | 1,980,000   |                          |
|      |       | 住石ホールディングス     | 51,900    | 132.00           | 6,850,800   | 貸付有価証券<br>1,300株         |
|      |       | 日鉄鉱業           | 5,500     | 3,880.00         | 21,340,000  |                          |
|      |       | 三井松島ホールディングス   | 10,100    | 1,197.00         | 12,089,700  | 貸付有価証券<br>1,200株         |
|      |       | 国際石油開発帝石       | 967,000   | 906.60           | 876,682,200 |                          |
|      |       | 石油資源開発         | 34,600    | 2,606.00         | 90,167,600  | 貸付有価証券<br>300株           |
|      |       | K & Oエナジーグループ  | 11,700    | 1,349.00         | 15,783,300  | 貸付有価証券<br>1,400株         |
|      |       | ヒノキヤグループ       | 6,000     | 1,867.00         | 11,202,000  | 貸付有価証券<br>700株           |
|      |       | ショーボンドホールディングス | 34,400    | 3,660.00         | 125,904,000 | 貸付有価証券<br>17,500株        |
|      |       | ミライト・ホールディングス  | 67,800    | 1,560.00         | 105,768,000 | 貸付有価証券<br>43,200株        |
|      |       | タマホーム          | 11,600    | 1,474.00         | 17,098,400  | 貸付有価証券<br>7,700株（2,300株） |
|      |       | サンヨーホームズ       | 3,500     | 631.00           | 2,208,500   | 貸付有価証券<br>500株           |
|      |       | 日本アクア          | 9,600     | 627.00           | 6,019,200   | 貸付有価証券<br>5,000株（200株）   |
|      |       | ファーストコーポレーション  | 7,400     | 575.00           | 4,255,000   | 貸付有価証券<br>4,800株（100株）   |
| ベステラ | 4,600 | 1,290.00       | 5,934,000 | 貸付有価証券<br>1,900株 |             |                          |

|                  |         |          |             |                            |
|------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| TATERU           | 48,900  | 178.00   | 8,704,200   | 貸付有価証券<br>32,600株(10,900株) |
| スペースバリューホールディングス | 29,400  | 460.00   | 13,524,000  | 貸付有価証券<br>400株             |
| ダイセキ環境ソリューション    | 4,600   | 661.00   | 3,040,600   | 貸付有価証券<br>500株             |
| 第一カッター興業         | 3,000   | 1,563.00 | 4,689,000   | 貸付有価証券<br>400株             |
| 安藤・間             | 154,600 | 705.00   | 108,993,000 | 貸付有価証券<br>19,100株          |
| 東急建設             | 70,600  | 745.00   | 52,597,000  | 貸付有価証券<br>100株             |
| コムシスホールディングス     | 85,500  | 2,934.00 | 250,857,000 | 貸付有価証券<br>10,800株          |
| ミサワホーム           | 19,000  | 1,069.00 | 20,311,000  |                            |
| ビーアールホールディングス    | 26,300  | 350.00   | 9,205,000   | 貸付有価証券<br>4,100株           |
| 高松コンストラクショングループ  | 15,000  | 2,294.00 | 34,410,000  |                            |
| 東建コーポレーション       | 7,400   | 6,310.00 | 46,694,000  | 貸付有価証券<br>1,600株           |
| ソネック             | 2,500   | 873.00   | 2,182,500   | 貸付有価証券<br>100株             |
| ヤマウラ             | 9,300   | 846.00   | 7,867,800   | 貸付有価証券<br>900株             |
| 大成建設             | 198,000 | 3,770.00 | 746,460,000 |                            |
| 大林組              | 596,400 | 996.00   | 594,014,400 | 貸付有価証券<br>32,900株          |
| 清水建設             | 608,300 | 905.00   | 550,511,500 | 貸付有価証券<br>75,700株          |
| 飛島建設             | 17,000  | 1,146.00 | 19,482,000  | 貸付有価証券<br>100株             |
| 長谷工コーポレーション      | 248,600 | 1,155.00 | 287,133,000 | 貸付有価証券<br>300株             |
| 松井建設             | 21,900  | 692.00   | 15,154,800  |                            |
| 銭高組              | 2,400   | 3,820.00 | 9,168,000   |                            |
| 鹿島建設             | 466,100 | 1,314.00 | 612,455,400 | 貸付有価証券<br>57,000株          |
| 不動テトラ            | 13,600  | 1,126.00 | 15,313,600  |                            |
| 大末建設             | 7,000   | 922.00   | 6,454,000   |                            |
| 鉄建建設             | 12,100  | 2,593.00 | 31,375,300  |                            |

|               |         |           |             |                        |
|---------------|---------|-----------|-------------|------------------------|
| 西松建設          | 42,900  | 1,876.00  | 80,480,400  |                        |
| 三井住友建設        | 143,400 | 524.00    | 75,141,600  | 貸付有価証券<br>500株         |
| 大豊建設          | 13,500  | 2,695.00  | 36,382,500  |                        |
| 前田建設工業        | 141,800 | 850.00    | 120,530,000 | 貸付有価証券<br>17,300株      |
| 佐田建設          | 12,800  | 386.00    | 4,940,800   |                        |
| ナカノフード建設      | 15,200  | 431.00    | 6,551,200   | 貸付有価証券<br>1,800株       |
| 奥村組           | 32,700  | 2,797.00  | 91,461,900  | 貸付有価証券<br>200株         |
| 東鉄工業          | 23,900  | 3,065.00  | 73,253,500  | 貸付有価証券<br>2,900株       |
| イチケン          | 3,600   | 1,610.00  | 5,796,000   |                        |
| 富士ピー・エス       | 8,200   | 483.00    | 3,960,600   | 貸付有価証券<br>900株         |
| 浅沼組           | 6,700   | 3,455.00  | 23,148,500  |                        |
| 戸田建設          | 231,100 | 574.00    | 132,651,400 | 貸付有価証券<br>30,900株      |
| 熊谷組           | 28,400  | 2,970.00  | 84,348,000  | 貸付有価証券<br>3,400株       |
| 青木あすなろ建設      | 9,800   | 1,209.00  | 11,848,200  | 貸付有価証券<br>1,000株（400株） |
| 北野建設          | 4,100   | 2,333.00  | 9,565,300   | 貸付有価証券<br>100株         |
| 植木組           | 2,500   | 2,329.00  | 5,822,500   | 貸付有価証券<br>1,400株       |
| 矢作建設工業        | 27,000  | 662.00    | 17,874,000  | 貸付有価証券<br>300株（100株）   |
| ピーエス三菱        | 20,900  | 668.00    | 13,961,200  | 貸付有価証券<br>2,500株       |
| 日本ハウスホールディングス | 38,000  | 464.00    | 17,632,000  | 貸付有価証券<br>7,300株       |
| 大東建託          | 70,800  | 13,655.00 | 966,774,000 | 貸付有価証券<br>10,100株      |
| 新日本建設         | 23,700  | 734.00    | 17,395,800  | 貸付有価証券<br>2,800株       |
| N I P P O     | 52,600  | 1,849.00  | 97,257,400  | 貸付有価証券<br>6,500株       |
| 東亜道路工業        | 3,700   | 3,215.00  | 11,895,500  |                        |
| 前田道路          | 59,000  | 2,386.00  | 140,774,000 | 貸付有価証券                 |

|           |         |          |               |                                 |
|-----------|---------|----------|---------------|---------------------------------|
|           |         |          |               | 3,800株                          |
| 日本道路      | 5,400   | 6,040.00 | 32,616,000    | 貸付有価証券<br>600株                  |
| 東亜建設工業    | 17,400  | 1,266.00 | 22,028,400    |                                 |
| 日本国土開発    | 32,500  | 530.00   | 17,225,000    | 貸付有価証券<br>20,900株               |
| 若築建設      | 10,000  | 1,485.00 | 14,850,000    |                                 |
| 東洋建設      | 72,800  | 422.00   | 30,721,600    | 貸付有価証券<br>200株                  |
| 五洋建設      | 236,400 | 557.00   | 131,674,800   | 貸付有価証券<br>30,400株               |
| 世紀東急工業    | 29,000  | 672.00   | 19,488,000    | 貸付有価証券<br>400株                  |
| 福田組       | 6,400   | 3,850.00 | 24,640,000    | 貸付有価証券<br>700株                  |
| 住友林業      | 140,900 | 1,355.00 | 190,919,500   | 貸付有価証券<br>100株                  |
| 日本基礎技術    | 20,400  | 309.00   | 6,303,600     | 貸付有価証券<br>2,500株                |
| 巴コーポレーション | 24,700  | 392.00   | 9,682,400     | 貸付有価証券<br>200株(200株)            |
| 大和ハウス工業   | 550,700 | 3,369.00 | 1,855,308,300 | 貸付有価証券<br>67,300株               |
| ライト工業     | 38,200  | 1,361.00 | 51,990,200    | 貸付有価証券<br>4,600株                |
| 積水ハウス     | 609,000 | 1,983.00 | 1,207,647,000 | 貸付有価証券<br>407,200株(57,600<br>株) |
| 日特建設      | 16,900  | 624.00   | 10,545,600    |                                 |
| 北陸電気工事    | 9,600   | 860.00   | 8,256,000     | 貸付有価証券<br>1,500株                |
| ユアテック     | 31,800  | 652.00   | 20,733,600    | 貸付有価証券<br>3,900株                |
| 四電工       | 3,000   | 2,697.00 | 8,091,000     |                                 |
| 中電工       | 25,600  | 2,250.00 | 57,600,000    | 貸付有価証券<br>3,100株                |
| 関電工       | 90,500  | 911.00   | 82,445,500    | 貸付有価証券<br>900株                  |
| きんでん      | 132,200 | 1,539.00 | 203,455,800   | 貸付有価証券<br>16,600株               |
| 東京エネシス    | 20,500  | 860.00   | 17,630,000    | 貸付有価証券<br>2,300株                |

|              |         |          |             |                          |
|--------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| トーエネック       | 5,600   | 3,140.00 | 17,584,000  |                          |
| 住友電設         | 13,700  | 1,979.00 | 27,112,300  |                          |
| 日本電設工業       | 33,900  | 2,096.00 | 71,054,400  | 貸付有価証券<br>4,300株         |
| 協和エクシオ       | 77,900  | 2,555.00 | 199,034,500 |                          |
| 新日本空調        | 16,100  | 1,714.00 | 27,595,400  | 貸付有価証券<br>2,000株         |
| 九電工          | 39,200  | 3,275.00 | 128,380,000 |                          |
| 三機工業         | 44,900  | 1,244.00 | 55,855,600  | 貸付有価証券<br>5,600株         |
| 日揮           | 171,300 | 1,294.00 | 221,662,200 | 貸付有価証券<br>55,800株        |
| 中外炉工業        | 5,600   | 1,425.00 | 7,980,000   |                          |
| ヤマト          | 17,800  | 674.00   | 11,997,200  |                          |
| 太平電業         | 13,500  | 2,351.00 | 31,738,500  | 貸付有価証券<br>1,600株         |
| 高砂熱学工業       | 48,300  | 1,724.00 | 83,269,200  | 貸付有価証券<br>6,000株         |
| 三晃金属工業       | 2,400   | 2,291.00 | 5,498,400   |                          |
| 朝日工業社        | 4,100   | 2,859.00 | 11,721,900  | 貸付有価証券<br>500株           |
| 明星工業         | 36,000  | 709.00   | 25,524,000  | 貸付有価証券<br>4,400株         |
| 大気社          | 27,100  | 3,080.00 | 83,468,000  | 貸付有価証券<br>3,300株         |
| ダイダン         | 13,300  | 2,006.00 | 26,679,800  | 貸付有価証券<br>1,600株         |
| 日比谷総合設備      | 17,900  | 1,818.00 | 32,542,200  |                          |
| 東芝プラントシステム   | 43,100  | 1,724.00 | 74,304,400  | 貸付有価証券<br>5,200株         |
| OSJBホールディングス | 87,800  | 228.00   | 20,018,400  | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| レイズネクスト      | 35,700  | 1,152.00 | 41,126,400  | 貸付有価証券<br>4,400株         |
| 日本製粉         | 56,500  | 1,641.00 | 92,716,500  | 貸付有価証券<br>7,100株         |
| 日清製粉グループ本社   | 201,300 | 1,959.00 | 394,346,700 | 貸付有価証券<br>24,600株        |
| 日東富士製粉       | 1,300   | 6,390.00 | 8,307,000   |                          |
| 昭和産業         | 16,400  | 3,060.00 | 50,184,000  | 貸付有価証券<br>2,600株（2,600株） |

|            |         |          |             |                         |
|------------|---------|----------|-------------|-------------------------|
| 鳥越製粉       | 15,800  | 810.00   | 12,798,000  | 貸付有価証券<br>1,900株        |
| 中部飼料       | 21,800  | 1,104.00 | 24,067,200  |                         |
| フィード・ワン    | 119,600 | 155.00   | 18,538,000  | 貸付有価証券<br>15,300株       |
| 東洋精糖       | 2,700   | 1,021.00 | 2,756,700   |                         |
| 日本甜菜製糖     | 10,100  | 1,794.00 | 18,119,400  |                         |
| 三井製糖       | 14,100  | 2,193.00 | 30,921,300  | 貸付有価証券<br>1,700株        |
| 塩水港精糖      | 19,300  | 204.00   | 3,937,200   |                         |
| 日新製糖       | 8,400   | 1,913.00 | 16,069,200  |                         |
| 森永製菓       | 44,800  | 5,100.00 | 228,480,000 | 貸付有価証券<br>200株          |
| 中村屋        | 4,600   | 4,165.00 | 19,159,000  | 貸付有価証券<br>500株          |
| 江崎グリコ      | 53,600  | 4,660.00 | 249,776,000 | 貸付有価証券<br>3,000株        |
| 名糖産業       | 8,600   | 1,263.00 | 10,861,800  | 貸付有価証券<br>3,400株        |
| 井村屋グループ    | 7,600   | 2,043.00 | 15,526,800  | 貸付有価証券<br>1,100株        |
| 不二家        | 9,900   | 1,961.00 | 19,413,900  | 貸付有価証券<br>1,200株        |
| 山崎製パン      | 133,500 | 1,811.00 | 241,768,500 | 貸付有価証券<br>56,700株（500株） |
| 第一屋製パン     | 3,100   | 923.00   | 2,861,300   | 貸付有価証券<br>300株          |
| モロゾフ       | 3,000   | 4,645.00 | 13,935,000  | 貸付有価証券<br>300株          |
| 亀田製菓       | 11,100  | 4,670.00 | 51,837,000  | 貸付有価証券<br>1,300株        |
| 寿スピリッツ     | 18,900  | 6,570.00 | 124,173,000 | 貸付有価証券<br>2,600株        |
| カルビー       | 81,200  | 3,170.00 | 257,404,000 | 貸付有価証券<br>800株          |
| 森永乳業       | 35,700  | 4,380.00 | 156,366,000 | 貸付有価証券<br>900株          |
| 六甲バター      | 11,800  | 1,616.00 | 19,068,800  | 貸付有価証券<br>1,500株        |
| ヤクルト本社     | 132,000 | 6,010.00 | 793,320,000 |                         |
| 明治ホールディングス | 126,200 | 7,390.00 | 932,618,000 | 貸付有価証券                  |

|                          |         |          |               |                              |
|--------------------------|---------|----------|---------------|------------------------------|
|                          |         |          |               | 1,900株                       |
| 雪印メグミルク                  | 42,900  | 2,390.00 | 102,531,000   |                              |
| プリマハム                    | 25,100  | 2,123.00 | 53,287,300    | 貸付有価証券<br>3,200株             |
| 日本ハム                     | 73,800  | 4,055.00 | 299,259,000   | 貸付有価証券<br>3,100株             |
| 林兼産業                     | 5,900   | 562.00   | 3,315,800     | 貸付有価証券<br>300株               |
| 丸大食品                     | 19,000  | 2,175.00 | 41,325,000    | 貸付有価証券<br>12,600株            |
| S Foods                  | 16,000  | 2,979.00 | 47,664,000    | 貸付有価証券<br>3,400株(100株)       |
| 伊藤ハム米久ホールディングス           | 114,700 | 634.00   | 72,719,800    | 貸付有価証券<br>14,700株            |
| サッポロホールディングス             | 60,800  | 2,517.00 | 153,033,600   | 貸付有価証券<br>40,500株            |
| アサヒグループホールディングス          | 373,100 | 5,080.00 | 1,895,348,000 | 貸付有価証券<br>148,700株(2,600株)   |
| キリンホールディングス              | 755,500 | 2,092.50 | 1,580,883,750 | 貸付有価証券<br>505,000株(107,800株) |
| 宝ホールディングス                | 133,400 | 1,041.00 | 138,869,400   | 貸付有価証券<br>16,600株            |
| オエノンホールディングス             | 47,000  | 374.00   | 17,578,000    | 貸付有価証券<br>6,200株             |
| 養命酒製造                    | 5,500   | 1,895.00 | 10,422,500    |                              |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 125,000 | 2,311.00 | 288,875,000   | 貸付有価証券<br>44,400株(2,100株)    |
| サントリー食品インターナショナル         | 119,200 | 4,700.00 | 560,240,000   | 貸付有価証券<br>45,500株            |
| ダイドーグループホールディングス         | 10,000  | 4,300.00 | 43,000,000    | 貸付有価証券<br>6,400株             |
| 伊藤園                      | 54,100  | 4,915.00 | 265,901,500   | 貸付有価証券<br>13,400株(1,900株)    |
| キーコーヒー                   | 17,500  | 2,139.00 | 37,432,500    | 貸付有価証券<br>2,100株             |
| ユニカフェ                    | 4,600   | 979.00   | 4,503,400     | 貸付有価証券<br>600株               |
| ジャパンフーズ                  | 2,500   | 1,186.00 | 2,965,000     | 貸付有価証券<br>900株               |
| 日清オイリオグループ               | 22,900  | 3,310.00 | 75,799,000    |                              |
| 不二製油グループ本社               | 43,400  | 2,905.00 | 126,077,000   | 貸付有価証券                       |

|                   |           |          |               |                            |
|-------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
|                   |           |          |               | 7,600株(1,100株)             |
| かどや製油             | 1,900     | 3,525.00 | 6,697,500     | 貸付有価証券<br>200株             |
| J-オイルミルズ          | 9,200     | 3,950.00 | 36,340,000    | 貸付有価証券<br>1,300株           |
| キッコーマン            | 117,500   | 4,775.00 | 561,062,500   | 貸付有価証券<br>14,300株          |
| 味の素               | 393,400   | 1,891.00 | 743,919,400   | 貸付有価証券<br>5,600株           |
| キューピー             | 99,200    | 2,478.00 | 245,817,600   | 貸付有価証券<br>40,700株          |
| ハウス食品グループ本社       | 66,600    | 3,985.00 | 265,401,000   |                            |
| カゴメ               | 71,400    | 2,715.00 | 193,851,000   | 貸付有価証券<br>15,800株(2,500株)  |
| 焼津水産化学工業          | 8,600     | 1,013.00 | 8,711,800     |                            |
| アリアケジャパン          | 16,300    | 8,230.00 | 134,149,000   | 貸付有価証券<br>1,900株           |
| ピエトロ              | 2,300     | 1,599.00 | 3,677,700     |                            |
| エバラ食品工業           | 4,300     | 2,031.00 | 8,733,300     |                            |
| やまみ               | 900       | 1,951.00 | 1,755,900     |                            |
| ニチレイ              | 92,500    | 2,373.00 | 219,502,500   | 貸付有価証券<br>300株             |
| 東洋水産              | 91,700    | 4,355.00 | 399,353,500   | 貸付有価証券<br>11,200株          |
| イトアンド             | 6,200     | 1,715.00 | 10,633,000    | 貸付有価証券<br>1,200株           |
| 大冷                | 2,000     | 2,029.00 | 4,058,000     |                            |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 4,900     | 836.00   | 4,096,400     | 貸付有価証券<br>3,300株(100株)     |
| 日清食品ホールディングス      | 75,700    | 7,480.00 | 566,236,000   | 貸付有価証券<br>9,200株           |
| 永谷園ホールディングス       | 9,500     | 2,019.00 | 19,180,500    |                            |
| 一正蒲鉾              | 6,900     | 1,078.00 | 7,438,200     | 貸付有価証券<br>800株             |
| フジッコ              | 19,300    | 1,891.00 | 36,496,300    |                            |
| ロック・フィールド         | 19,200    | 1,340.00 | 25,728,000    | 貸付有価証券<br>12,700株          |
| 日本たばこ産業           | 1,028,600 | 2,203.50 | 2,266,520,100 | 貸付有価証券<br>685,300株(2,300株) |
| ケンコーマヨネーズ         | 10,000    | 2,123.00 | 21,230,000    | 貸付有価証券<br>1,900株           |

|                |           |          |               |                           |
|----------------|-----------|----------|---------------|---------------------------|
| わらべや日洋ホールディングス | 11,700    | 1,700.00 | 19,890,000    | 貸付有価証券<br>2,000株          |
| なとり            | 9,900     | 1,563.00 | 15,473,700    | 貸付有価証券<br>1,200株          |
| イフジ産業          | 3,100     | 713.00   | 2,210,300     |                           |
| ピックルスコーポレーション  | 4,200     | 2,337.00 | 9,815,400     | 貸付有価証券<br>200株            |
| 北の達人コーポレーション   | 70,000    | 746.00   | 52,220,000    | 貸付有価証券<br>34,400株(5,200株) |
| ユーグレナ          | 76,000    | 882.00   | 67,032,000    | 貸付有価証券<br>30,200株         |
| ミヨシ油脂          | 6,800     | 1,078.00 | 7,330,400     | 貸付有価証券<br>800株            |
| 理研ビタミン         | 8,400     | 3,340.00 | 28,056,000    | 貸付有価証券<br>500株            |
| 片倉工業           | 25,200    | 1,257.00 | 31,676,400    | 貸付有価証券<br>14,500株         |
| グンゼ            | 11,700    | 4,385.00 | 51,304,500    |                           |
| 東洋紡            | 73,600    | 1,388.00 | 102,156,800   | 貸付有価証券<br>28,500株         |
| ユニチカ           | 50,900    | 317.00   | 16,135,300    | 貸付有価証券<br>9,600株          |
| 富士紡ホールディングス    | 9,000     | 2,541.00 | 22,869,000    | 貸付有価証券<br>1,100株          |
| 倉敷紡績           | 16,600    | 2,031.00 | 33,714,600    |                           |
| シキボウ           | 9,100     | 897.00   | 8,162,700     |                           |
| 日本毛織           | 57,200    | 929.00   | 53,138,800    | 貸付有価証券<br>8,600株          |
| ダイトウボウ         | 28,100    | 81.00    | 2,276,100     | 貸付有価証券<br>4,500株(100株)    |
| トーア紡コーポレーション   | 6,900     | 485.00   | 3,346,500     | 貸付有価証券<br>800株            |
| ダイドーリミテッド      | 20,800    | 269.00   | 5,595,200     | 貸付有価証券<br>600株(100株)      |
| 帝国繊維           | 19,500    | 1,684.00 | 32,838,000    | 貸付有価証券<br>2,300株          |
| 帝人             | 141,800   | 1,955.00 | 277,219,000   | 貸付有価証券<br>17,300株         |
| 東レ             | 1,348,500 | 760.40   | 1,025,399,400 | 貸付有価証券<br>3,000株          |
| サカイオーボックス      | 4,300     | 1,617.00 | 6,953,100     |                           |

|                |         |           |             |                          |
|----------------|---------|-----------|-------------|--------------------------|
| 住江織物           | 5,100   | 2,937.00  | 14,978,700  | 貸付有価証券<br>600株           |
| 日本フェルト         | 9,800   | 456.00    | 4,468,800   |                          |
| イチカワ           | 2,500   | 1,367.00  | 3,417,500   | 貸付有価証券<br>200株           |
| 日東製網           | 2,000   | 1,394.00  | 2,788,000   | 貸付有価証券<br>200株           |
| アツギ            | 14,300  | 817.00    | 11,683,100  | 貸付有価証券<br>1,700株         |
| ダイニック          | 7,000   | 672.00    | 4,704,000   | 貸付有価証券<br>700株           |
| セーレン           | 42,700  | 1,222.00  | 52,179,400  | 貸付有価証券<br>100株           |
| ソトー            | 6,900   | 978.00    | 6,748,200   | 貸付有価証券<br>200株           |
| 東海染工           | 2,400   | 1,130.00  | 2,712,000   |                          |
| 小松マテーレ         | 28,500  | 744.00    | 21,204,000  | 貸付有価証券<br>3,400株         |
| ワコールホールディングス   | 49,100  | 2,529.00  | 124,173,900 | 貸付有価証券<br>400株           |
| ホギメディカル        | 21,600  | 2,905.00  | 62,748,000  |                          |
| レナウン           | 50,200  | 108.00    | 5,421,600   | 貸付有価証券<br>27,500株（800株）  |
| クラウディアホールディングス | 4,300   | 490.00    | 2,107,000   | 貸付有価証券<br>500株           |
| T S Iホールディングス  | 64,100  | 541.00    | 34,678,100  | 貸付有価証券<br>14,000株        |
| マツオカコーポレーション   | 5,500   | 2,035.00  | 11,192,500  | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| ワールド           | 22,700  | 2,319.00  | 52,641,300  |                          |
| 三陽商会           | 9,000   | 1,310.00  | 11,790,000  | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| ナイガイ           | 6,300   | 341.00    | 2,148,300   | 貸付有価証券<br>700株           |
| オンワードホールディングス  | 104,400 | 510.00    | 53,244,000  | 貸付有価証券<br>15,800株        |
| ルックホールディングス    | 5,900   | 1,015.00  | 5,988,500   | 貸付有価証券<br>700株           |
| ゴールドウイン        | 15,800  | 15,890.00 | 251,062,000 | 貸付有価証券<br>8,600株（7,000株） |
| デサント           | 42,400  | 1,432.00  | 60,716,800  | 貸付有価証券<br>600株           |

|              |           |          |               |                             |
|--------------|-----------|----------|---------------|-----------------------------|
| キング          | 9,200     | 531.00   | 4,885,200     | 貸付有価証券<br>100株              |
| ヤマトインターナショナル | 10,600    | 399.00   | 4,229,400     | 貸付有価証券<br>2,200株            |
| 特種東海製紙       | 11,000    | 3,660.00 | 40,260,000    | 貸付有価証券<br>1,400株            |
| 王子ホールディングス   | 782,600   | 503.00   | 393,647,800   | 貸付有価証券<br>1,600株            |
| 日本製紙         | 83,300    | 1,791.00 | 149,190,300   | 貸付有価証券<br>5,500株（3,000株）    |
| 三菱製紙         | 28,300    | 485.00   | 13,725,500    |                             |
| 北越コーポレーション   | 115,300   | 546.00   | 62,953,800    | 貸付有価証券<br>200株              |
| 中越パルプ工業      | 7,400     | 1,488.00 | 11,011,200    |                             |
| 巴川製紙所        | 5,700     | 811.00   | 4,622,700     | 貸付有価証券<br>300株              |
| 大王製紙         | 84,700    | 1,349.00 | 114,260,300   | 貸付有価証券<br>37,300株（8,000株）   |
| 阿波製紙         | 4,500     | 399.00   | 1,795,500     |                             |
| レンゴー         | 179,200   | 774.00   | 138,700,800   | 貸付有価証券<br>4,100株            |
| トーモク         | 10,700    | 1,490.00 | 15,943,000    | 貸付有価証券<br>1,300株            |
| ザ・パック        | 13,200    | 3,380.00 | 44,616,000    | 貸付有価証券<br>1,600株            |
| クラレ          | 273,800   | 1,255.00 | 343,619,000   | 貸付有価証券<br>182,700株（42,300株） |
| 旭化成          | 1,236,600 | 983.90   | 1,216,690,740 | 貸付有価証券<br>154,400株          |
| 共和レザー        | 10,800    | 722.00   | 7,797,600     | 貸付有価証券<br>1,300株            |
| 昭和電工         | 123,700   | 2,809.00 | 347,473,300   | 貸付有価証券<br>79,800株           |
| 住友化学         | 1,368,300 | 482.00   | 659,520,600   |                             |
| 住友精化         | 8,500     | 3,265.00 | 27,752,500    |                             |
| 日産化学         | 106,000   | 4,500.00 | 477,000,000   | 貸付有価証券<br>13,000株           |
| ラサ工業         | 6,100     | 1,193.00 | 7,277,300     | 貸付有価証券<br>1,600株（900株）      |
| クレハ          | 16,100    | 5,750.00 | 92,575,000    | 貸付有価証券<br>1,900株            |

|            |         |           |               |                   |
|------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 多木化学       | 5,100   | 4,420.00  | 22,542,000    | 貸付有価証券<br>3,300株  |
| テイカ        | 14,200  | 1,873.00  | 26,596,600    | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 石原産業       | 33,400  | 863.00    | 28,824,200    | 貸付有価証券<br>400株    |
| 片倉コープアグリ   | 5,000   | 1,044.00  | 5,220,000     | 貸付有価証券<br>100株    |
| 日本曹達       | 27,400  | 2,492.00  | 68,280,800    | 貸付有価証券<br>600株    |
| 東ソー        | 268,700 | 1,391.00  | 373,761,700   | 貸付有価証券<br>200株    |
| トクヤマ       | 50,100  | 2,279.00  | 114,177,900   | 貸付有価証券<br>6,100株  |
| セントラル硝子    | 37,900  | 2,264.00  | 85,805,600    | 貸付有価証券<br>4,900株  |
| 東亜合成       | 109,100 | 1,049.00  | 114,445,900   | 貸付有価証券<br>13,400株 |
| 大阪ソーダ      | 19,100  | 2,434.00  | 46,489,400    |                   |
| 関東電化工業     | 41,200  | 745.00    | 30,694,000    | 貸付有価証券<br>6,000株  |
| デンカ        | 68,300  | 2,838.00  | 193,835,400   |                   |
| 信越化学工業     | 306,300 | 11,170.00 | 3,421,371,000 | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| 日本カーバイド工業  | 5,900   | 1,191.00  | 7,026,900     |                   |
| 堺化学工業      | 11,600  | 2,352.00  | 27,283,200    | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 第一稀元素化学工業  | 18,800  | 820.00    | 15,416,000    |                   |
| エア・ウォーター   | 142,300 | 1,823.00  | 259,412,900   | 貸付有価証券<br>17,400株 |
| 大陽日酸       | 143,200 | 2,106.00  | 301,579,200   |                   |
| 日本化学工業     | 5,900   | 2,208.00  | 13,027,200    | 貸付有価証券<br>300株    |
| 東邦アセチレン    | 2,600   | 1,220.00  | 3,172,000     |                   |
| 日本パーカライジング | 95,000  | 1,155.00  | 109,725,000   |                   |
| 高圧ガス工業     | 27,600  | 772.00    | 21,307,200    |                   |
| チタン工業      | 2,200   | 2,628.00  | 5,781,600     | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| 四国化成工業     | 29,200  | 1,053.00  | 30,747,600    |                   |
| 戸田工業       | 3,700   | 2,035.00  | 7,529,500     | 貸付有価証券<br>2,000株  |

|                |           |          |             |                         |
|----------------|-----------|----------|-------------|-------------------------|
| ステラ ケミファ       | 10,200    | 2,639.00 | 26,917,800  | 貸付有価証券<br>600株          |
| 保土谷化学工業        | 6,000     | 2,778.00 | 16,668,000  | 貸付有価証券<br>200株          |
| 日本触媒           | 29,200    | 6,190.00 | 180,748,000 | 貸付有価証券<br>4,500株(400株)  |
| 大日精化工業         | 14,400    | 2,959.00 | 42,609,600  | 貸付有価証券<br>1,700株        |
| カネカ            | 45,000    | 3,195.00 | 143,775,000 |                         |
| 三菱瓦斯化学         | 176,700   | 1,303.00 | 230,240,100 |                         |
| 三井化学           | 157,800   | 2,301.00 | 363,097,800 |                         |
| J S R          | 174,400   | 1,768.00 | 308,339,200 | 貸付有価証券<br>21,300株       |
| 東京応化工業         | 29,800    | 3,920.00 | 116,816,000 | 貸付有価証券<br>8,200株        |
| 大阪有機化学工業       | 16,100    | 960.00   | 15,456,000  | 貸付有価証券<br>1,900株        |
| 三菱ケミカルホールディングス | 1,162,000 | 778.80   | 904,965,600 |                         |
| K Hネオケム        | 30,600    | 2,081.00 | 63,678,600  | 貸付有価証券<br>7,300株        |
| ダイセル           | 256,100   | 842.00   | 215,636,200 |                         |
| 住友ベークライト       | 30,100    | 3,925.00 | 118,142,500 | 貸付有価証券<br>3,600株        |
| 積水化学工業         | 373,800   | 1,586.00 | 592,846,800 | 貸付有価証券<br>46,400株       |
| 日本ゼオン          | 156,800   | 1,263.00 | 198,038,400 | 貸付有価証券<br>20,900株       |
| アイカ工業          | 52,100    | 2,982.00 | 155,362,200 | 貸付有価証券<br>6,300株        |
| 宇部興産           | 87,800    | 2,079.00 | 182,536,200 |                         |
| 積水樹脂           | 28,700    | 1,981.00 | 56,854,700  | 貸付有価証券<br>3,500株        |
| タキロンシーアイ       | 37,600    | 614.00   | 23,086,400  |                         |
| 旭有機材           | 12,000    | 1,246.00 | 14,952,000  |                         |
| 日立化成           | 80,400    | 3,455.00 | 277,782,000 | 貸付有価証券<br>28,100株(300株) |
| ニチバン           | 9,100     | 1,516.00 | 13,795,600  | 貸付有価証券<br>4,900株        |
| リケンテクノス        | 47,400    | 460.00   | 21,804,000  | 貸付有価証券<br>5,700株        |

|               |         |          |               |                             |
|---------------|---------|----------|---------------|-----------------------------|
| 大倉工業          | 8,200   | 1,533.00 | 12,570,600    | 貸付有価証券<br>1,000株            |
| 積水化成工業        | 25,900  | 703.00   | 18,207,700    | 貸付有価証券<br>3,200株            |
| 群栄化学工業        | 4,500   | 2,231.00 | 10,039,500    |                             |
| タイガースポリマー     | 9,100   | 529.00   | 4,813,900     | 貸付有価証券<br>200株              |
| ミライアル         | 5,000   | 1,318.00 | 6,590,000     | 貸付有価証券<br>1,200株            |
| ダイキアクシス       | 6,200   | 728.00   | 4,513,600     | 貸付有価証券<br>700株              |
| ダイキョーニシカワ     | 36,600  | 734.00   | 26,864,400    |                             |
| 竹本容器          | 6,200   | 851.00   | 5,276,200     | 貸付有価証券<br>800株              |
| 森六ホールディングス    | 9,300   | 2,437.00 | 22,664,100    |                             |
| 日本化薬          | 107,600 | 1,206.00 | 129,765,600   | 貸付有価証券<br>13,500株           |
| カーリットホールディングス | 18,600  | 547.00   | 10,174,200    |                             |
| 日本精化          | 14,000  | 1,105.00 | 15,470,000    |                             |
| 扶桑化学工業        | 17,600  | 2,318.00 | 40,796,800    | 貸付有価証券<br>2,100株            |
| トリケミカル研究所     | 3,900   | 6,190.00 | 24,141,000    | 貸付有価証券<br>2,100株            |
| A D E K A     | 85,700  | 1,288.00 | 110,381,600   |                             |
| 日油            | 65,500  | 3,465.00 | 226,957,500   | 貸付有価証券<br>8,100株            |
| 新日本理化         | 30,800  | 181.00   | 5,574,800     | 貸付有価証券<br>4,000株            |
| ハリマ化成グループ     | 14,400  | 1,179.00 | 16,977,600    |                             |
| 花王            | 425,000 | 7,715.00 | 3,278,875,000 | 貸付有価証券<br>281,000株（38,500株） |
| 第一工業製薬        | 6,500   | 2,660.00 | 17,290,000    | 貸付有価証券<br>800株              |
| 石原ケミカル        | 4,400   | 1,603.00 | 7,053,200     | 貸付有価証券<br>800株              |
| 日華化学          | 5,900   | 771.00   | 4,548,900     | 貸付有価証券<br>2,800株            |
| ニイタカ          | 2,700   | 1,440.00 | 3,888,000     | 貸付有価証券<br>300株              |

|                 |         |           |               |                             |
|-----------------|---------|-----------|---------------|-----------------------------|
| 三洋化成工業          | 11,700  | 4,825.00  | 56,452,500    |                             |
| 有機合成薬品工業        | 13,300  | 222.00    | 2,952,600     | 貸付有価証券<br>100株              |
| 大日本塗料           | 19,600  | 1,049.00  | 20,560,400    |                             |
| 日本ペイントホールディングス  | 143,400 | 5,040.00  | 722,736,000   | 貸付有価証券<br>38,800株           |
| 関西ペイント          | 195,300 | 2,268.00  | 442,940,400   | 貸付有価証券<br>34,600株           |
| 神東塗料            | 13,700  | 161.00    | 2,205,700     | 貸付有価証券<br>300株              |
| 中国塗料            | 57,100  | 847.00    | 48,363,700    | 貸付有価証券<br>7,600株            |
| 日本特殊塗料          | 13,000  | 1,024.00  | 13,312,000    |                             |
| 藤倉化成            | 23,400  | 525.00    | 12,285,000    |                             |
| 太陽ホールディングス      | 14,300  | 3,370.00  | 48,191,000    |                             |
| D I C           | 73,400  | 2,840.00  | 208,456,000   | 貸付有価証券<br>48,800株（17,700株）  |
| サカタインクス         | 37,900  | 1,001.00  | 37,937,900    | 貸付有価証券<br>4,800株            |
| 東洋インキＳＣホールディングス | 36,700  | 2,268.00  | 83,235,600    | 貸付有価証券<br>4,800株（300株）      |
| T & K T O K A   | 13,500  | 908.00    | 12,258,000    | 貸付有価証券<br>1,400株            |
| 富士フイルムホールディングス  | 368,700 | 4,643.00  | 1,711,874,100 | 貸付有価証券<br>2,800株            |
| 資生堂             | 352,700 | 8,658.00  | 3,053,676,600 | 貸付有価証券<br>235,600株（34,800株） |
| ライオン            | 230,800 | 1,994.00  | 460,215,200   | 貸付有価証券<br>117,900株（2,100株）  |
| 高砂香料工業          | 12,200  | 2,620.00  | 31,964,000    | 貸付有価証券<br>1,500株            |
| マンダム            | 39,900  | 2,571.00  | 102,582,900   |                             |
| ミルボン            | 23,700  | 4,995.00  | 118,381,500   | 貸付有価証券<br>2,800株            |
| ファンケル           | 79,000  | 2,604.00  | 205,716,000   |                             |
| コーセー            | 30,100  | 17,810.00 | 536,081,000   | 貸付有価証券<br>4,900株            |
| コタ              | 9,300   | 1,162.00  | 10,806,600    |                             |
| シーボン            | 2,100   | 2,349.00  | 4,932,900     |                             |
| ポーラ・オルビスホール     | 75,800  | 2,437.00  | 184,724,600   | 貸付有価証券                      |

|              |        |          |             |                        |
|--------------|--------|----------|-------------|------------------------|
| ディングス        |        |          |             | 10,800株                |
| ノエビアホールディングス | 16,900 | 5,450.00 | 92,105,000  | 貸付有価証券<br>2,000株       |
| アジュバンコスメジャパン | 4,000  | 926.00   | 3,704,000   | 貸付有価証券<br>500株         |
| エステー         | 12,700 | 1,539.00 | 19,545,300  | 貸付有価証券<br>1,500株       |
| アグロ カネショウ    | 5,500  | 1,393.00 | 7,661,500   | 貸付有価証券<br>800株         |
| コニシ          | 31,400 | 1,473.00 | 46,252,200  | 貸付有価証券<br>4,100株       |
| 長谷川香料        | 23,500 | 2,050.00 | 48,175,000  | 貸付有価証券<br>2,900株       |
| 星光 P M C     | 10,200 | 751.00   | 7,660,200   | 貸付有価証券<br>1,800株       |
| 小林製薬         | 49,700 | 7,890.00 | 392,133,000 | 貸付有価証券<br>6,400株（200株） |
| 荒川化学工業       | 15,900 | 1,351.00 | 21,480,900  | 貸付有価証券<br>2,000株       |
| メック          | 12,200 | 1,442.00 | 17,592,400  | 貸付有価証券<br>1,800株       |
| 日本高純度化学      | 4,900  | 2,404.00 | 11,779,600  | 貸付有価証券<br>500株         |
| タカラバイオ       | 46,400 | 2,339.00 | 108,529,600 | 貸付有価証券<br>100株         |
| J C U        | 23,000 | 1,878.00 | 43,194,000  | 貸付有価証券<br>2,800株       |
| 新田ゼラチン       | 11,100 | 647.00   | 7,181,700   |                        |
| O A T アグリオ   | 3,100  | 1,319.00 | 4,088,900   | 貸付有価証券<br>400株         |
| デクセリアルズ      | 45,700 | 727.00   | 33,223,900  | 貸付有価証券<br>100株         |
| アース製薬        | 13,400 | 5,020.00 | 67,268,000  | 貸付有価証券<br>1,900株       |
| 北興化学工業       | 18,200 | 458.00   | 8,335,600   | 貸付有価証券<br>2,200株       |
| 大成ラミック       | 5,800  | 2,745.00 | 15,921,000  |                        |
| クミアイ化学工業     | 73,400 | 917.00   | 67,307,800  | 貸付有価証券<br>13,200株      |
| 日本農薬         | 31,600 | 435.00   | 13,746,000  |                        |
| アキレス         | 12,900 | 1,660.00 | 21,414,000  | 貸付有価証券<br>600株         |

|                     |           |          |               |                                 |
|---------------------|-----------|----------|---------------|---------------------------------|
| 有沢製作所               | 28,000    | 983.00   | 27,524,000    | 貸付有価証券<br>4,300株                |
| 日東電工                | 122,500   | 5,225.00 | 640,062,500   |                                 |
| レック                 | 18,900    | 978.00   | 18,484,200    | 貸付有価証券<br>2,700株                |
| 三光合成                | 20,300    | 343.00   | 6,962,900     |                                 |
| きもと                 | 30,200    | 175.00   | 5,285,000     | 貸付有価証券<br>700株                  |
| 藤森工業                | 15,900    | 2,943.00 | 46,793,700    |                                 |
| 前澤化成工業              | 12,100    | 1,118.00 | 13,527,800    | 貸付有価証券<br>7,700株                |
| 未来工業                | 9,500     | 1,866.00 | 17,727,000    | 貸付有価証券<br>1,300株                |
| ウェーブロックホール<br>ディングス | 4,900     | 723.00   | 3,542,700     | 貸付有価証券<br>800株                  |
| J S P               | 10,400    | 1,736.00 | 18,054,400    | 貸付有価証券<br>200株                  |
| エフピコ                | 19,500    | 6,730.00 | 131,235,000   |                                 |
| 天馬                  | 11,800    | 1,942.00 | 22,915,600    |                                 |
| 信越ポリマー              | 31,900    | 721.00   | 22,999,900    |                                 |
| 東リ                  | 44,200    | 243.00   | 10,740,600    | 貸付有価証券<br>1,300株                |
| ニフコ                 | 71,100    | 2,457.00 | 174,692,700   | 貸付有価証券<br>1,400株                |
| バルカー                | 14,400    | 2,224.00 | 32,025,600    |                                 |
| ユニ・チャーム             | 342,100   | 3,284.00 | 1,123,456,400 | 貸付有価証券<br>97,400株(1,700株)       |
| ショーエイコーポレー<br>ション   | 1,400     | 738.00   | 1,033,200     | 貸付有価証券<br>100株                  |
| 協和キリン               | 178,500   | 1,986.00 | 354,501,000   | 貸付有価証券<br>119,100株(31,200<br>株) |
| 武田薬品工業              | 1,549,500 | 3,690.00 | 5,717,655,000 | 貸付有価証券<br>1,200株                |
| アステラス製薬             | 1,561,200 | 1,510.00 | 2,357,412,000 | 貸付有価証券<br>200,400株              |
| 大日本住友製薬             | 131,600   | 1,800.00 | 236,880,000   | 貸付有価証券<br>16,100株               |
| 塩野義製薬               | 226,900   | 5,752.00 | 1,305,128,800 | 貸付有価証券<br>27,700株               |
| 田辺三菱製薬              | 185,600   | 1,171.00 | 217,337,600   |                                 |

|           |         |          |               |                                 |
|-----------|---------|----------|---------------|---------------------------------|
| わかもと製薬    | 21,100  | 244.00   | 5,148,400     | 貸付有価証券<br>2,900株(100株)          |
| あすか製薬     | 21,900  | 1,029.00 | 22,535,100    |                                 |
| 日本新薬      | 46,500  | 8,720.00 | 405,480,000   |                                 |
| ビオフェルミン製薬 | 3,000   | 2,104.00 | 6,312,000     |                                 |
| 中外製薬      | 185,000 | 7,780.00 | 1,439,300,000 | 貸付有価証券<br>123,600株(19,300<br>株) |
| 科研製薬      | 30,400  | 5,030.00 | 152,912,000   | 貸付有価証券<br>3,900株                |
| エーザイ      | 212,400 | 5,288.00 | 1,123,171,200 | 貸付有価証券<br>25,900株               |
| ロート製薬     | 91,100  | 2,655.00 | 241,870,500   | 貸付有価証券<br>800株                  |
| 小野薬品工業    | 419,200 | 1,945.50 | 815,553,600   | 貸付有価証券<br>51,800株               |
| 久光製薬      | 52,400  | 4,385.00 | 229,774,000   | 貸付有価証券<br>7,800株                |
| 持田製薬      | 26,900  | 4,020.00 | 108,138,000   |                                 |
| 参天製薬      | 330,500 | 1,793.00 | 592,586,500   | 貸付有価証券<br>41,300株               |
| 扶桑薬品工業    | 6,200   | 1,902.00 | 11,792,400    | 貸付有価証券<br>700株                  |
| 日本ケミファ    | 2,300   | 2,786.00 | 6,407,800     | 貸付有価証券<br>1,300株                |
| ツムラ       | 55,000  | 2,933.00 | 161,315,000   | 貸付有価証券<br>7,200株                |
| 日医工       | 46,700  | 1,181.00 | 55,152,700    | 貸付有価証券<br>5,600株                |
| キッセイ薬品工業  | 31,400  | 2,457.00 | 77,149,800    |                                 |
| 生化学工業     | 34,400  | 1,081.00 | 37,186,400    | 貸付有価証券<br>400株                  |
| 栄研化学      | 31,200  | 1,633.00 | 50,949,600    |                                 |
| 日水製薬      | 7,500   | 1,181.00 | 8,857,500     |                                 |
| 鳥居薬品      | 11,100  | 2,816.00 | 31,257,600    | 貸付有価証券<br>1,300株                |
| JCRファーマ   | 12,500  | 7,850.00 | 98,125,000    |                                 |
| 東和薬品      | 25,500  | 2,368.00 | 60,384,000    | 貸付有価証券<br>1,200株                |
| 富士製薬工業    | 12,100  | 1,280.00 | 15,488,000    | 貸付有価証券<br>1,100株                |

|                  |           |          |               |                             |
|------------------|-----------|----------|---------------|-----------------------------|
| 沢井製薬             | 36,400    | 5,550.00 | 202,020,000   | 貸付有価証券<br>4,400株            |
| ゼリア新薬工業          | 35,100    | 1,850.00 | 64,935,000    | 貸付有価証券<br>300株              |
| 第一三共             | 507,900   | 7,048.00 | 3,579,679,200 | 貸付有価証券<br>62,200株           |
| キョーリン製薬ホールディングス  | 39,200    | 1,744.00 | 68,364,800    |                             |
| 大幸薬品             | 7,900     | 2,288.00 | 18,075,200    |                             |
| ダイト              | 10,300    | 3,005.00 | 30,951,500    | 貸付有価証券<br>1,200株            |
| 大塚ホールディングス       | 338,100   | 4,429.00 | 1,497,444,900 | 貸付有価証券<br>218,700株（44,700株） |
| 大正製薬ホールディングス     | 37,500    | 7,360.00 | 276,000,000   |                             |
| ペプチドリーム          | 89,800    | 5,470.00 | 491,206,000   | 貸付有価証券<br>18,400株（4,600株）   |
| 日本コークス工業         | 149,900   | 83.00    | 12,441,700    | 貸付有価証券<br>20,600株           |
| ニチレキ             | 22,700    | 1,035.00 | 23,494,500    |                             |
| ユシロ化学工業          | 9,200     | 1,285.00 | 11,822,000    |                             |
| ピーピー・カストロール      | 6,300     | 1,345.00 | 8,473,500     | 貸付有価証券<br>700株              |
| 富士石油             | 43,100    | 233.00   | 10,042,300    | 貸付有価証券<br>5,400株            |
| MORESCO          | 6,400     | 1,308.00 | 8,371,200     | 貸付有価証券<br>700株              |
| 出光興産             | 204,900   | 2,918.00 | 597,898,200   |                             |
| JXTGホールディングス     | 2,936,200 | 454.30   | 1,333,915,660 |                             |
| コスモエネルギーホールディングス | 51,400    | 1,991.00 | 102,337,400   | 貸付有価証券<br>34,300株           |
| 横浜ゴム             | 102,800   | 2,080.00 | 213,824,000   | 貸付有価証券<br>68,600株（20,800株）  |
| TOYO TIRE        | 101,900   | 1,345.00 | 137,055,500   | 貸付有価証券<br>37,300株           |
| ブリヂストン           | 545,500   | 4,096.00 | 2,234,368,000 | 貸付有価証券<br>364,200株          |
| 住友ゴム工業           | 159,400   | 1,231.00 | 196,221,400   | 貸付有価証券<br>63,800株           |
| 藤倉コンポジット         | 15,500    | 399.00   | 6,184,500     |                             |

|                    |         |          |             |                                 |
|--------------------|---------|----------|-------------|---------------------------------|
| オカモト               | 11,900  | 3,990.00 | 47,481,000  |                                 |
| フコク                | 7,800   | 667.00   | 5,202,600   | 貸付有価証券<br>100株                  |
| ニッタ                | 20,000  | 2,744.00 | 54,880,000  |                                 |
| 住友理工               | 34,400  | 785.00   | 27,004,000  |                                 |
| 三ツ星ベルト             | 23,400  | 1,722.00 | 40,294,800  |                                 |
| バンドー化学             | 33,800  | 833.00   | 28,155,400  | 貸付有価証券<br>100株                  |
| 日東紡績               | 26,400  | 2,963.00 | 78,223,200  | 貸付有価証券<br>3,700株                |
| A G C              | 175,500 | 3,185.00 | 558,967,500 | 貸付有価証券<br>117,100株（30,400<br>株） |
| 日本板硝子              | 84,900  | 638.00   | 54,166,200  | 貸付有価証券<br>12,500株（6,000株）       |
| 石塚硝子               | 3,000   | 1,910.00 | 5,730,000   |                                 |
| 日本山村硝子             | 7,400   | 1,241.00 | 9,183,400   |                                 |
| 日本電気硝子             | 71,300  | 2,308.00 | 164,560,400 | 貸付有価証券<br>16,100株               |
| オハラ                | 7,000   | 1,346.00 | 9,422,000   | 貸付有価証券<br>3,600株（800株）          |
| 住友大阪セメント           | 35,800  | 4,495.00 | 160,921,000 | 貸付有価証券<br>4,300株                |
| 太平洋セメント            | 112,100 | 2,762.00 | 309,620,200 | 貸付有価証券<br>13,700株               |
| 日本ヒューム             | 17,800  | 655.00   | 11,659,000  |                                 |
| 日本コンクリート工業         | 38,200  | 240.00   | 9,168,000   | 貸付有価証券<br>300株                  |
| 三谷セキサン             | 8,300   | 2,887.00 | 23,962,100  |                                 |
| アジアパイルホールディ<br>ングス | 25,100  | 491.00   | 12,324,100  |                                 |
| 東海カーボン             | 185,900 | 1,088.00 | 202,259,200 | 貸付有価証券<br>106,900株              |
| 日本カーボン             | 9,100   | 3,765.00 | 34,261,500  | 貸付有価証券<br>6,100株                |
| 東洋炭素               | 10,400  | 2,185.00 | 22,724,000  | 貸付有価証券<br>2,000株（600株）          |
| ノリタケカンパニーリミ<br>テド  | 10,600  | 3,830.00 | 40,598,000  |                                 |
| T O T O            | 136,500 | 3,920.00 | 535,080,000 | 貸付有価証券<br>16,900株               |

|                       |         |          |               |                   |
|-----------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 日本碍子                  | 216,600 | 1,468.00 | 317,968,800   |                   |
| 日本特殊陶業                | 149,700 | 1,877.00 | 280,986,900   | 貸付有価証券<br>18,300株 |
| ダントーホールディングス          | 13,200  | 109.00   | 1,438,800     | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| MARUWA                | 6,100   | 6,380.00 | 38,918,000    | 貸付有価証券<br>700株    |
| 品川リフラクトリーズ            | 4,700   | 2,619.00 | 12,309,300    | 貸付有価証券<br>600株    |
| 黒崎播磨                  | 3,500   | 5,480.00 | 19,180,000    | 貸付有価証券<br>400株    |
| ヨータイ                  | 15,500  | 576.00   | 8,928,000     |                   |
| イソライト工業               | 9,100   | 423.00   | 3,849,300     | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| 東京窯業                  | 22,600  | 287.00   | 6,486,200     | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| ニッカトー                 | 8,000   | 672.00   | 5,376,000     | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| フジインコーポレーテッド          | 15,800  | 2,470.00 | 39,026,000    | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| クニミネ工業                | 8,000   | 881.00   | 7,048,000     | 貸付有価証券<br>200株    |
| エーアンドエーマテリアル          | 3,400   | 973.00   | 3,308,200     | 貸付有価証券<br>500株    |
| ニチアス                  | 48,600  | 1,801.00 | 87,528,600    | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| ニチハ                   | 24,700  | 2,683.00 | 66,270,100    |                   |
| 日本製鉄                  | 815,600 | 1,494.00 | 1,218,506,400 | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 神戸製鋼所                 | 321,200 | 562.00   | 180,514,400   | 貸付有価証券<br>39,300株 |
| 中山製鋼所                 | 24,300  | 441.00   | 10,716,300    |                   |
| 合同製鐵                  | 8,500   | 2,101.00 | 17,858,500    |                   |
| ジェイ エフ イー<br>ホールディングス | 474,000 | 1,271.00 | 602,454,000   | 貸付有価証券<br>500株    |
| 東京製鐵                  | 94,000  | 831.00   | 78,114,000    | 貸付有価証券<br>11,400株 |
| 共英製鋼                  | 19,800  | 1,890.00 | 37,422,000    | 貸付有価証券<br>3,200株  |
| 大和工業                  | 37,300  | 2,668.00 | 99,516,400    | 貸付有価証券<br>400株    |

|                |         |          |             |                           |
|----------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| 東京鐵鋼           | 7,200   | 1,225.00 | 8,820,000   |                           |
| 大阪製鐵           | 11,600  | 1,335.00 | 15,486,000  | 貸付有価証券<br>1,400株          |
| 淀川製鋼所          | 23,700  | 1,822.00 | 43,181,400  | 貸付有価証券<br>2,800株          |
| 丸一鋼管           | 62,200  | 2,598.00 | 161,595,600 | 貸付有価証券<br>7,600株          |
| モリ工業           | 5,300   | 1,765.00 | 9,354,500   |                           |
| 大同特殊鋼          | 28,700  | 4,085.00 | 117,239,500 | 貸付有価証券<br>4,000株          |
| 日本高周波鋼業        | 6,500   | 405.00   | 2,632,500   | 貸付有価証券<br>300株            |
| 日本冶金工業         | 145,200 | 222.00   | 32,234,400  | 貸付有価証券<br>96,900株（100株）   |
| 山陽特殊製鋼         | 22,100  | 1,418.00 | 31,337,800  | 貸付有価証券<br>2,000株（1,800株）  |
| 愛知製鋼           | 9,900   | 3,090.00 | 30,591,000  |                           |
| 日立金属           | 189,100 | 1,191.00 | 225,218,100 | 貸付有価証券<br>25,900株         |
| 日本金属           | 4,100   | 777.00   | 3,185,700   |                           |
| 大平洋金属          | 11,900  | 2,172.00 | 25,846,800  | 貸付有価証券<br>4,600株（100株）    |
| 新日本電工          | 113,100 | 161.00   | 18,209,100  | 貸付有価証券<br>65,400株（2,100株） |
| 栗本鐵工所          | 8,900   | 1,401.00 | 12,468,900  |                           |
| 虹技             | 2,600   | 1,231.00 | 3,200,600   |                           |
| 日本鑄鉄管          | 1,800   | 981.00   | 1,765,800   | 貸付有価証券<br>1,200株（1,000株）  |
| 三菱製鋼           | 13,000  | 1,085.00 | 14,105,000  |                           |
| 日亜鋼業           | 25,700  | 277.00   | 7,118,900   | 貸付有価証券<br>1,200株（100株）    |
| 日本精線           | 2,500   | 2,438.00 | 6,095,000   |                           |
| エンビプロ・ホールディングス | 6,600   | 586.00   | 3,867,600   | 貸付有価証券<br>3,300株（600株）    |
| シンニッタン         | 27,300  | 425.00   | 11,602,500  | 貸付有価証券<br>3,300株          |
| 新家工業           | 4,000   | 1,343.00 | 5,372,000   | 貸付有価証券<br>400株            |
| 大紀アルミニウム工業所    | 28,800  | 704.00   | 20,275,200  | 貸付有価証券<br>9,200株          |
| 日本輕金属ホールディング   | 478,300 | 187.00   | 89,442,100  | 貸付有価証券                    |

|                |         |          |             |                   |
|----------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| グス             |         |          |             | 600株              |
| 三井金属鉱業         | 47,400  | 2,358.00 | 111,769,200 | 貸付有価証券<br>900株    |
| 東邦亜鉛           | 9,700   | 1,976.00 | 19,167,200  |                   |
| 三菱マテリアル        | 115,900 | 2,615.00 | 303,078,500 |                   |
| 住友金属鉱山         | 240,400 | 3,220.00 | 774,088,000 | 貸付有価証券<br>29,400株 |
| DOWAホールディングス   | 41,000  | 3,425.00 | 140,425,000 | 貸付有価証券<br>400株    |
| 古河機械金属         | 29,000  | 1,322.00 | 38,338,000  |                   |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 20,300  | 1,606.00 | 32,601,800  | 貸付有価証券<br>5,700株  |
| 東邦チタニウム        | 31,400  | 801.00   | 25,151,400  | 貸付有価証券<br>6,100株  |
| UACJ           | 26,600  | 1,681.00 | 44,714,600  | 貸付有価証券<br>13,000株 |
| CKサンエツ         | 3,300   | 2,843.00 | 9,381,900   | 貸付有価証券<br>300株    |
| 古河電気工業         | 50,600  | 2,375.00 | 120,175,000 |                   |
| 住友電気工業         | 656,200 | 1,290.50 | 846,826,100 |                   |
| フジクラ           | 211,900 | 355.00   | 75,224,500  | 貸付有価証券<br>600株    |
| 昭和電線ホールディングス   | 20,400  | 769.00   | 15,687,600  | 貸付有価証券<br>100株    |
| 東京特殊電線         | 2,300   | 1,804.00 | 4,149,200   |                   |
| タツタ電線          | 34,800  | 446.00   | 15,520,800  |                   |
| カナレ電気          | 2,900   | 1,735.00 | 5,031,500   | 貸付有価証券<br>500株    |
| 平河ヒューテック       | 7,300   | 1,055.00 | 7,701,500   | 貸付有価証券<br>800株    |
| リョービ           | 21,600  | 1,652.00 | 35,683,200  | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| アーレスティ         | 21,600  | 533.00   | 11,512,800  |                   |
| アサヒホールディングス    | 32,900  | 2,282.00 | 75,077,800  |                   |
| 稲葉製作所          | 9,900   | 1,378.00 | 13,642,200  | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 宮地エンジニアリンググループ | 5,300   | 1,467.00 | 7,775,100   | 貸付有価証券<br>400株    |
| トーカロ           | 45,300  | 838.00   | 37,961,400  | 貸付有価証券<br>100株    |
| アルファC o        | 6,200   | 1,177.00 | 7,297,400   |                   |

|                  |         |          |             |                    |
|------------------|---------|----------|-------------|--------------------|
| SUMCO            | 210,100 | 1,450.00 | 304,645,000 | 貸付有価証券<br>140,200株 |
| 川田テクノロジーズ        | 3,900   | 6,310.00 | 24,609,000  |                    |
| RS Technologies  | 4,900   | 3,295.00 | 16,145,500  | 貸付有価証券<br>600株     |
| 信和               | 9,300   | 971.00   | 9,030,300   |                    |
| 東洋製罐グループホールディングス | 111,800 | 1,604.00 | 179,327,200 |                    |
| ホッカンホールディングス     | 8,900   | 1,511.00 | 13,447,900  |                    |
| コロナ              | 9,700   | 994.00   | 9,641,800   |                    |
| 横河ブリッジホールディングス   | 32,600  | 1,511.00 | 49,258,600  |                    |
| 駒井ハルテック          | 3,300   | 1,451.00 | 4,788,300   | 貸付有価証券<br>300株     |
| 高田機工             | 1,600   | 2,444.00 | 3,910,400   |                    |
| 三和ホールディングス       | 181,300 | 1,180.00 | 213,934,000 |                    |
| 文化シャッター          | 51,700  | 894.00   | 46,219,800  | 貸付有価証券<br>8,400株   |
| 三協立山             | 24,300  | 1,155.00 | 28,066,500  | 貸付有価証券<br>2,900株   |
| アルインコ            | 13,900  | 925.00   | 12,857,500  |                    |
| 東洋シャッター          | 4,200   | 667.00   | 2,801,400   | 貸付有価証券<br>700株     |
| LIXILグループ        | 259,000 | 1,765.00 | 457,135,000 | 貸付有価証券<br>33,300株  |
| 日本フィルコン          | 13,400  | 480.00   | 6,432,000   | 貸付有価証券<br>1,700株   |
| ノーリツ             | 36,400  | 1,203.00 | 43,789,200  | 貸付有価証券<br>4,700株   |
| 長府製作所            | 17,800  | 2,160.00 | 38,448,000  | 貸付有価証券<br>2,100株   |
| リンナイ             | 31,300  | 6,900.00 | 215,970,000 | 貸付有価証券<br>3,800株   |
| ダイニチ工業           | 9,500   | 616.00   | 5,852,000   |                    |
| 日東精工             | 24,200  | 531.00   | 12,850,200  | 貸付有価証券<br>2,900株   |
| 三洋工業             | 2,300   | 1,784.00 | 4,103,200   |                    |
| 岡部               | 35,600  | 807.00   | 28,729,200  | 貸付有価証券<br>4,300株   |
| ジーテクト            | 19,400  | 1,531.00 | 29,701,400  | 貸付有価証券             |

|             |         |          |             |                          |
|-------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
|             |         |          |             | 200株                     |
| 中国工業        | 2,600   | 586.00   | 1,523,600   |                          |
| 東プレ         | 32,700  | 1,646.00 | 53,824,200  |                          |
| 高周波熱錬       | 33,800  | 814.00   | 27,513,200  | 貸付有価証券<br>400株           |
| 東京製綱        | 10,800  | 927.00   | 10,011,600  |                          |
| サンコール       | 9,900   | 464.00   | 4,593,600   | 貸付有価証券<br>1,400株         |
| モリテック スチール  | 13,700  | 335.00   | 4,589,500   | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| パイオラックス     | 28,100  | 1,743.00 | 48,978,300  | 貸付有価証券<br>3,400株         |
| エイチワン       | 17,200  | 643.00   | 11,059,600  | 貸付有価証券<br>800株           |
| 日本発條        | 174,800 | 787.00   | 137,567,600 | 貸付有価証券<br>35,600株        |
| 中央発條        | 2,100   | 2,776.00 | 5,829,600   |                          |
| アドバネクス      | 2,300   | 1,665.00 | 3,829,500   |                          |
| 立川ブラインド工業   | 7,700   | 1,376.00 | 10,595,200  | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| 三益半導体工業     | 15,600  | 1,798.00 | 28,048,800  | 貸付有価証券<br>2,100株         |
| 日本ドライケミカル   | 4,700   | 1,113.00 | 5,231,100   | 貸付有価証券<br>2,600株         |
| 日本製鋼所       | 53,200  | 2,079.00 | 110,602,800 | 貸付有価証券<br>6,500株         |
| 三浦工業        | 75,900  | 3,040.00 | 230,736,000 | 貸付有価証券<br>7,800株(7,700株) |
| タクマ         | 64,000  | 1,188.00 | 76,032,000  |                          |
| ツガミ         | 39,400  | 893.00   | 35,184,200  | 貸付有価証券<br>25,100株        |
| オークマ        | 22,300  | 5,370.00 | 119,751,000 | 貸付有価証券<br>2,700株         |
| 東芝機械        | 19,800  | 2,125.00 | 42,075,000  | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| アマダホールディングス | 263,700 | 1,148.00 | 302,727,600 | 貸付有価証券<br>33,100株        |
| アイダエンジニアリング | 47,400  | 805.00   | 38,157,000  |                          |
| 滝澤鉄工所       | 5,400   | 1,261.00 | 6,809,400   |                          |
| F U J I     | 70,100  | 1,485.00 | 104,098,500 |                          |
| 牧野フライス製作所   | 20,600  | 4,535.00 | 93,421,000  | 貸付有価証券                   |

|              |         |           |             |                            |
|--------------|---------|-----------|-------------|----------------------------|
|              |         |           |             | 2,500株                     |
| オーエスジー       | 81,100  | 2,037.00  | 165,200,700 | 貸付有価証券<br>22,700株(5,600株)  |
| ダイジェット工業     | 2,000   | 1,429.00  | 2,858,000   |                            |
| 旭ダイヤモンド工業    | 46,000  | 612.00    | 28,152,000  | 貸付有価証券<br>100株             |
| D M G 森精機    | 111,000 | 1,460.00  | 162,060,000 | 貸付有価証券<br>74,100株(17,400株) |
| ソディック        | 41,200  | 760.00    | 31,312,000  | 貸付有価証券<br>6,700株           |
| ディスコ         | 23,800  | 20,840.00 | 495,992,000 | 貸付有価証券<br>1,100株           |
| 日東工器         | 9,600   | 2,063.00  | 19,804,800  |                            |
| 日進工具         | 5,200   | 1,867.00  | 9,708,400   |                            |
| パンチ工業        | 12,200  | 471.00    | 5,746,200   |                            |
| 富士ダイス        | 7,700   | 574.00    | 4,419,800   |                            |
| 豊和工業         | 9,700   | 751.00    | 7,284,700   | 貸付有価証券<br>2,800株           |
| O K K        | 7,200   | 700.00    | 5,040,000   |                            |
| 東洋機械金属       | 12,500  | 556.00    | 6,950,000   |                            |
| 津田駒工業        | 3,400   | 1,272.00  | 4,324,800   | 貸付有価証券<br>2,200株(1,800株)   |
| エンシュウ        | 4,600   | 1,064.00  | 4,894,400   | 貸付有価証券<br>300株             |
| 島精機製作所       | 24,200  | 2,506.00  | 60,645,200  | 貸付有価証券<br>2,000株           |
| オプトラ         | 19,600  | 3,195.00  | 62,622,000  | 貸付有価証券<br>900株             |
| N C ホールディングス | 5,700   | 453.00    | 2,582,100   |                            |
| イワキポンプ       | 7,400   | 929.00    | 6,874,600   | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| フリー          | 14,000  | 921.00    | 12,894,000  | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| ヤマシンフィルタ     | 30,500  | 704.00    | 21,472,000  | 貸付有価証券<br>20,300株(5,200株)  |
| 日阪製作所        | 21,600  | 823.00    | 17,776,800  | 貸付有価証券<br>500株             |
| やまびこ         | 34,000  | 1,019.00  | 34,646,000  | 貸付有価証券<br>4,100株           |
| 平田機工         | 8,300   | 6,610.00  | 54,863,000  | 貸付有価証券<br>2,300株           |

|                      |         |           |               |                           |
|----------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| ペガサスミシン製造            | 16,400  | 499.00    | 8,183,600     |                           |
| マルマエ                 | 7,200   | 860.00    | 6,192,000     | 貸付有価証券<br>4,600株（3,300株）  |
| タツモ                  | 8,200   | 1,090.00  | 8,938,000     | 貸付有価証券<br>5,400株          |
| ナブテスコ                | 103,400 | 3,245.00  | 335,533,000   | 貸付有価証券<br>68,900株（1,400株） |
| 三井海洋開発               | 18,600  | 2,474.00  | 46,016,400    | 貸付有価証券<br>2,200株          |
| レオン自動機               | 17,200  | 1,485.00  | 25,542,000    | 貸付有価証券<br>2,100株          |
| S M C                | 52,000  | 42,200.00 | 2,194,400,000 | 貸付有価証券<br>6,300株          |
| ヤマハモーターロボティクスホールディング | 13,300  | 415.00    | 5,519,500     | 貸付有価証券<br>8,400株          |
| ホソカワミクロン             | 6,200   | 3,725.00  | 23,095,000    |                           |
| ユニオンツール              | 6,500   | 3,190.00  | 20,735,000    | 貸付有価証券<br>700株            |
| オイレス工業               | 24,600  | 1,516.00  | 37,293,600    |                           |
| 日精エー・エス・ビー機械         | 5,900   | 3,140.00  | 18,526,000    | 貸付有価証券<br>3,000株（400株）    |
| サトーホールディングス          | 21,200  | 2,671.00  | 56,625,200    |                           |
| 技研製作所                | 15,400  | 3,325.00  | 51,205,000    | 貸付有価証券<br>1,900株          |
| 日本エアテック              | 5,500   | 573.00    | 3,151,500     | 貸付有価証券<br>700株            |
| カワタ                  | 4,800   | 933.00    | 4,478,400     | 貸付有価証券<br>600株            |
| 日精樹脂工業               | 14,700  | 983.00    | 14,450,100    |                           |
| オカダアイヨン              | 6,000   | 1,145.00  | 6,870,000     | 貸付有価証券<br>200株            |
| ワイエイシイホールディングス       | 7,000   | 690.00    | 4,830,000     | 貸付有価証券<br>2,900株          |
| 小松製作所                | 803,600 | 2,333.00  | 1,874,798,800 | 貸付有価証券<br>300株            |
| 住友重機械工業              | 101,600 | 3,120.00  | 316,992,000   |                           |
| 日立建機                 | 71,100  | 2,357.00  | 167,582,700   | 貸付有価証券<br>8,600株          |
| 日工                   | 4,800   | 3,170.00  | 15,216,000    |                           |
| 巴工業                  | 7,500   | 2,290.00  | 17,175,000    | 貸付有価証券<br>900株            |

|                  |         |          |               |                                 |
|------------------|---------|----------|---------------|---------------------------------|
| 井関農機             | 17,700  | 1,362.00 | 24,107,400    | 貸付有価証券<br>2,100株                |
| TOWA             | 15,200  | 745.00   | 11,324,000    | 貸付有価証券<br>8,300株(200株)          |
| 丸山製作所            | 3,900   | 1,152.00 | 4,492,800     | 貸付有価証券<br>100株                  |
| 北川鉄工所            | 8,000   | 1,863.00 | 14,904,000    |                                 |
| ローツェ             | 7,800   | 2,367.00 | 18,462,600    | 貸付有価証券<br>5,200株(200株)          |
| タカキタ             | 6,200   | 523.00   | 3,242,600     | 貸付有価証券<br>3,600株                |
| クボタ              | 950,900 | 1,563.50 | 1,486,732,150 | 貸付有価証券<br>631,600株(74,700<br>株) |
| 荏原実業             | 4,400   | 1,931.00 | 8,496,400     | 貸付有価証券<br>500株                  |
| 三菱化工機            | 6,100   | 1,731.00 | 10,559,100    |                                 |
| 月島機械             | 35,200  | 1,285.00 | 45,232,000    | 貸付有価証券<br>4,500株                |
| 帝国電機製作所          | 12,400  | 1,118.00 | 13,863,200    |                                 |
| 東京機械製作所          | 6,700   | 364.00   | 2,438,800     | 貸付有価証券<br>800株                  |
| 新東工業             | 42,100  | 920.00   | 38,732,000    | 貸付有価証券<br>28,100株               |
| 澁谷工業             | 15,500  | 2,632.00 | 40,796,000    | 貸付有価証券<br>1,800株                |
| アイチ コーポレーショ<br>ン | 30,600  | 652.00   | 19,951,200    | 貸付有価証券<br>3,800株                |
| 小森コーポレーション       | 45,000  | 1,081.00 | 48,645,000    | 貸付有価証券<br>1,900株                |
| 鶴見製作所            | 13,800  | 1,967.00 | 27,144,600    | 貸付有価証券<br>1,600株                |
| 住友精密工業           | 2,900   | 2,903.00 | 8,418,700     |                                 |
| 日本ギア工業           | 5,300   | 487.00   | 2,581,100     | 貸付有価証券<br>2,900株                |
| 酒井重工業            | 3,300   | 2,625.00 | 8,662,500     | 貸付有価証券<br>1,800株                |
| 荏原製作所            | 78,700  | 2,623.00 | 206,430,100   | 貸付有価証券<br>24,800株(9,900株)       |
| 石井鐵工所            | 2,700   | 1,990.00 | 5,373,000     |                                 |
| 西島製作所            | 18,100  | 1,028.00 | 18,606,800    | 貸付有価証券<br>2,200株                |

|                 |         |           |               |                        |
|-----------------|---------|-----------|---------------|------------------------|
| 北越工業            | 18,300  | 1,214.00  | 22,216,200    |                        |
| ダイキン工業          | 242,300 | 14,075.00 | 3,410,372,500 | 貸付有価証券<br>31,900株      |
| オルガノ            | 6,400   | 4,275.00  | 27,360,000    | 貸付有価証券<br>100株         |
| トーヨーカネツ         | 6,700   | 1,774.00  | 11,885,800    |                        |
| 栗田工業            | 96,000  | 2,826.00  | 271,296,000   | 貸付有価証券<br>11,700株      |
| 椿本チエイン          | 23,200  | 3,245.00  | 75,284,000    |                        |
| 大同工業            | 8,400   | 784.00    | 6,585,600     | 貸付有価証券<br>600株         |
| 木村化工機           | 14,800  | 359.00    | 5,313,200     |                        |
| アネスト岩田          | 27,600  | 889.00    | 24,536,400    |                        |
| ダイフク            | 97,700  | 5,140.00  | 502,178,000   | 貸付有価証券<br>36,300株      |
| サムコ             | 4,900   | 806.00    | 3,949,400     | 貸付有価証券<br>600株         |
| 加藤製作所           | 9,100   | 1,723.00  | 15,679,300    |                        |
| 油研工業            | 3,000   | 1,572.00  | 4,716,000     |                        |
| タダノ             | 85,600  | 978.00    | 83,716,800    | 貸付有価証券<br>38,400株      |
| フジテック           | 64,500  | 1,266.00  | 81,657,000    | 貸付有価証券<br>7,800株       |
| C K D           | 49,400  | 1,176.00  | 58,094,400    | 貸付有価証券<br>7,500株       |
| キトー             | 13,400  | 1,475.00  | 19,765,000    |                        |
| 平和              | 49,500  | 2,088.00  | 103,356,000   | 貸付有価証券<br>33,000株      |
| 理想科学工業          | 15,700  | 1,783.00  | 27,993,100    | 貸付有価証券<br>400株         |
| SANKYO          | 44,400  | 3,635.00  | 161,394,000   |                        |
| 日本金銭機械          | 19,600  | 948.00    | 18,580,800    | 貸付有価証券<br>3,200株（900株） |
| マースグループホールディングス | 11,300  | 1,854.00  | 20,950,200    |                        |
| 福島工業            | 10,900  | 3,035.00  | 33,081,500    |                        |
| オーイズミ           | 7,400   | 415.00    | 3,071,000     |                        |
| ダイコク電機          | 8,100   | 1,476.00  | 11,955,600    | 貸付有価証券<br>4,300株       |
| 竹内製作所           | 29,700  | 1,585.00  | 47,074,500    | 貸付有価証券                 |

|               |         |          |             |                           |
|---------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
|               |         |          |             | 5,500株                    |
| アマノ           | 50,700  | 3,230.00 | 163,761,000 |                           |
| JUKI          | 24,700  | 856.00   | 21,143,200  | 貸付有価証券<br>3,700株          |
| サンデンホールディングス  | 21,700  | 521.00   | 11,305,700  | 貸付有価証券<br>11,200株(3,200株) |
| 蛇の目ミシン工業      | 16,100  | 379.00   | 6,101,900   |                           |
| マックス          | 27,100  | 1,715.00 | 46,476,500  | 貸付有価証券<br>100株            |
| グローリー         | 49,200  | 2,913.00 | 143,319,600 | 貸付有価証券<br>1,100株          |
| 新晃工業          | 16,500  | 1,684.00 | 27,786,000  | 貸付有価証券<br>2,000株          |
| 大和冷機工業        | 25,600  | 1,052.00 | 26,931,200  | 貸付有価証券<br>3,100株          |
| セガサミーホールディングス | 176,000 | 1,489.00 | 262,064,000 | 貸付有価証券<br>100株            |
| 日本ピストンリング     | 6,500   | 1,231.00 | 8,001,500   |                           |
| リケン           | 8,200   | 3,645.00 | 29,889,000  | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| T P R         | 23,900  | 1,682.00 | 40,199,800  |                           |
| ツバキ・ナカシマ      | 36,200  | 1,629.00 | 58,969,800  | 貸付有価証券<br>4,900株          |
| ホシザキ          | 51,900  | 7,610.00 | 394,959,000 | 貸付有価証券<br>6,700株          |
| 大豊工業          | 14,500  | 769.00   | 11,150,500  |                           |
| 日本精工          | 364,500 | 903.00   | 329,143,500 | 貸付有価証券<br>44,600株         |
| N T N         | 381,400 | 299.00   | 114,038,600 | 貸付有価証券<br>5,400株          |
| ジェイテクト        | 170,200 | 1,186.00 | 201,857,200 | 貸付有価証券<br>100株            |
| 不二越           | 16,500  | 4,440.00 | 73,260,000  | 貸付有価証券<br>6,200株          |
| 日本トムソン        | 52,700  | 429.00   | 22,608,300  | 貸付有価証券<br>6,400株          |
| T H K         | 103,300 | 2,651.00 | 273,848,300 | 貸付有価証券<br>68,900株         |
| ユーシン精機        | 13,700  | 999.00   | 13,686,300  |                           |
| 前澤給装工業        | 6,900   | 1,880.00 | 12,972,000  | 貸付有価証券<br>100株            |

|              |           |          |               |                            |
|--------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| イーグル工業       | 21,900    | 984.00   | 21,549,600    |                            |
| 前澤工業         | 11,800    | 326.00   | 3,846,800     | 貸付有価証券<br>1,400株           |
| 日本ピラー工業      | 17,900    | 1,122.00 | 20,083,800    |                            |
| キッツ          | 71,900    | 677.00   | 48,676,300    | 貸付有価証券<br>9,000株           |
| マキタ          | 216,000   | 3,135.00 | 677,160,000   |                            |
| 日立造船         | 140,700   | 319.00   | 44,883,300    | 貸付有価証券<br>5,800株           |
| 三菱重工業        | 297,400   | 4,109.00 | 1,222,016,600 |                            |
| I H I        | 136,400   | 2,245.00 | 306,218,000   | 貸付有価証券<br>16,600株          |
| スター精密        | 27,700    | 1,470.00 | 40,719,000    | 貸付有価証券<br>6,200株           |
| 日清紡ホールディングス  | 118,300   | 805.00   | 95,231,500    | 貸付有価証券<br>78,700株（23,100株） |
| イビデン         | 108,700   | 2,127.00 | 231,204,900   |                            |
| コニカミノルタ      | 387,800   | 764.00   | 296,279,200   |                            |
| ブラザー工業       | 231,200   | 1,881.00 | 434,887,200   | 貸付有価証券<br>28,200株          |
| ミネベアミツミ      | 329,500   | 1,740.00 | 573,330,000   | 貸付有価証券<br>40,300株          |
| 日立製作所        | 799,000   | 3,923.00 | 3,134,477,000 |                            |
| 三菱電機         | 1,774,800 | 1,333.50 | 2,366,695,800 |                            |
| 富士電機         | 115,200   | 3,160.00 | 364,032,000   | 貸付有価証券<br>200株             |
| 東洋電機製造       | 7,000     | 1,536.00 | 10,752,000    | 貸付有価証券<br>800株             |
| 安川電機         | 205,700   | 3,780.00 | 777,546,000   | 貸付有価証券<br>123,900株         |
| シンフォニアテクノロジー | 24,600    | 1,149.00 | 28,265,400    |                            |
| 明電舎          | 35,100    | 1,755.00 | 61,600,500    |                            |
| オリジン         | 4,800     | 1,373.00 | 6,590,400     |                            |
| 山洋電気         | 8,600     | 4,420.00 | 38,012,000    | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| デンヨー         | 16,400    | 1,579.00 | 25,895,600    |                            |
| 東芝テック        | 22,200    | 3,060.00 | 67,932,000    |                            |
| 芝浦メカトロニクス    | 3,100     | 2,893.00 | 8,968,300     |                            |
| マブチモーター      | 49,100    | 3,840.00 | 188,544,000   | 貸付有価証券                     |

|                       |         |           |               |                         |
|-----------------------|---------|-----------|---------------|-------------------------|
|                       |         |           |               | 11,500株                 |
| 日本電産                  | 213,600 | 13,975.00 | 2,985,060,000 | 貸付有価証券<br>27,400株       |
| ユー・エム・シー・エレ<br>クトロニクス | 9,600   | 776.00    | 7,449,600     | 貸付有価証券<br>3,300株        |
| トレックス・セミコンダ<br>クター    | 7,900   | 1,128.00  | 8,911,200     | 貸付有価証券<br>900株          |
| 東光高岳                  | 9,000   | 1,093.00  | 9,837,000     |                         |
| ダブル・スコープ              | 24,200  | 632.00    | 15,294,400    | 貸付有価証券<br>11,400株（100株） |
| ダイヘン                  | 19,400  | 3,170.00  | 61,498,000    | 貸付有価証券<br>2,300株        |
| ヤーマン                  | 25,700  | 786.00    | 20,200,200    | 貸付有価証券<br>17,100株（300株） |
| JVCケンウッド              | 135,600 | 305.00    | 41,358,000    |                         |
| ミマキエンジニアリング           | 15,900  | 509.00    | 8,093,100     | 貸付有価証券<br>1,700株        |
| 第一精工                  | 6,500   | 2,232.00  | 14,508,000    | 貸付有価証券<br>4,200株        |
| 日新電機                  | 41,600  | 1,316.00  | 54,745,600    | 貸付有価証券<br>5,000株        |
| 大崎電気工業                | 35,300  | 648.00    | 22,874,400    |                         |
| オムロン                  | 188,600 | 5,660.00  | 1,067,476,000 | 貸付有価証券<br>23,000株       |
| 日東工業                  | 28,400  | 1,953.00  | 55,465,200    | 貸付有価証券<br>100株          |
| I D E C               | 23,800  | 1,838.00  | 43,744,400    | 貸付有価証券<br>2,900株        |
| 正興電機製作所               | 4,200   | 710.00    | 2,982,000     |                         |
| 不二電機工業                | 1,900   | 1,187.00  | 2,255,300     | 貸付有価証券<br>1,200株        |
| ジーエス・ユアサ コー<br>ポレーション | 63,800  | 1,811.00  | 115,541,800   |                         |
| サクサホールディングス           | 4,500   | 1,764.00  | 7,938,000     | 貸付有価証券<br>500株          |
| メルコホールディングス           | 7,400   | 2,791.00  | 20,653,400    | 貸付有価証券<br>300株（300株）    |
| テクノメディカ               | 4,000   | 2,000.00  | 8,000,000     | 貸付有価証券<br>1,100株        |
| 日本電気                  | 229,700 | 4,630.00  | 1,063,511,000 |                         |
| 富士通                   | 171,100 | 8,595.00  | 1,470,604,500 | 貸付有価証券                  |

|              |           |          |               |                             |
|--------------|-----------|----------|---------------|-----------------------------|
|              |           |          |               | 700株                        |
| 沖電気工業        | 76,900    | 1,424.00 | 109,505,600   |                             |
| 岩崎通信機        | 8,300     | 771.00   | 6,399,300     | 貸付有価証券<br>100株              |
| 電気興業         | 9,300     | 2,881.00 | 26,793,300    | 貸付有価証券<br>100株              |
| サンケン電気       | 20,700    | 1,974.00 | 40,861,800    | 貸付有価証券<br>3,200株            |
| ナカヨ          | 3,400     | 1,575.00 | 5,355,000     |                             |
| アイホン         | 10,000    | 1,577.00 | 15,770,000    |                             |
| ルネサスエレクトロニクス | 844,500   | 689.00   | 581,860,500   | 貸付有価証券<br>107,600株          |
| セイコーエプソン     | 220,200   | 1,446.00 | 318,409,200   | 貸付有価証券<br>27,700株           |
| ワコム          | 128,500   | 335.00   | 43,047,500    | 貸付有価証券<br>800株              |
| アルバック        | 35,400    | 4,600.00 | 162,840,000   | 貸付有価証券<br>23,500株(800株)     |
| アクセル         | 7,400     | 630.00   | 4,662,000     | 貸付有価証券<br>1,600株(700株)      |
| E I Z O      | 16,300    | 3,615.00 | 58,924,500    | 貸付有価証券<br>1,900株            |
| ジャパンディスプレイ   | 419,600   | 67.00    | 28,113,200    | 貸付有価証券<br>277,500株(13,900株) |
| 日本信号         | 45,200    | 1,192.00 | 53,878,400    | 貸付有価証券<br>200株              |
| 京三製作所        | 38,100    | 352.00   | 13,411,200    | 貸付有価証券<br>700株              |
| 能美防災         | 23,500    | 2,150.00 | 50,525,000    |                             |
| ホーチキ         | 11,300    | 1,381.00 | 15,605,300    |                             |
| 星和電機         | 9,500     | 502.00   | 4,769,000     | 貸付有価証券<br>1,400株            |
| エレコム         | 16,800    | 4,270.00 | 71,736,000    | 貸付有価証券<br>9,200株            |
| パナソニック       | 2,027,600 | 850.30   | 1,724,068,280 | 貸付有価証券<br>900株              |
| シャープ         | 176,000   | 1,186.00 | 208,736,000   | 貸付有価証券<br>117,500株          |
| アンリツ         | 114,200   | 1,991.00 | 227,372,200   | 貸付有価証券<br>62,400株(1,600株)   |
| 富士通ゼネラル      | 54,200    | 1,780.00 | 96,476,000    | 貸付有価証券                      |

|                     |           |           |               |                           |
|---------------------|-----------|-----------|---------------|---------------------------|
|                     |           |           |               | 23,700株(12,400株)          |
| ソニー                 | 1,191,200 | 6,360.00  | 7,576,032,000 | 貸付有価証券<br>147,500株        |
| T D K               | 92,800    | 9,240.00  | 857,472,000   |                           |
| 帝国通信工業              | 7,800     | 1,064.00  | 8,299,200     |                           |
| タムラ製作所              | 68,400    | 565.00    | 38,646,000    | 貸付有価証券<br>8,300株          |
| アルプスアルパイン           | 184,800   | 1,943.00  | 359,066,400   |                           |
| 池上通信機               | 5,600     | 1,025.00  | 5,740,000     | 貸付有価証券<br>100株            |
| 日本電波工業              | 16,000    | 441.00    | 7,056,000     | 貸付有価証券<br>5,300株          |
| 鈴木                  | 9,500     | 612.00    | 5,814,000     | 貸付有価証券<br>1,700株          |
| 日本トリム               | 3,300     | 4,470.00  | 14,751,000    |                           |
| ローランド ディー .<br>ジー . | 9,800     | 1,952.00  | 19,129,600    | 貸付有価証券<br>1,100株          |
| フォスター電機             | 20,100    | 1,799.00  | 36,159,900    | 貸付有価証券<br>100株            |
| S M K               | 5,000     | 2,674.00  | 13,370,000    | 貸付有価証券<br>2,700株          |
| ヨコオ                 | 12,600    | 2,715.00  | 34,209,000    | 貸付有価証券<br>200株            |
| ティアック               | 12,800    | 191.00    | 2,444,800     | 貸付有価証券<br>7,200株(300株)    |
| ホシデン                | 52,200    | 1,013.00  | 52,878,600    | 貸付有価証券<br>6,300株          |
| ヒロセ電機               | 25,400    | 12,860.00 | 326,644,000   | 貸付有価証券<br>3,300株          |
| 日本航空電子工業            | 40,700    | 1,439.00  | 58,567,300    | 貸付有価証券<br>600株            |
| T O A               | 19,000    | 1,229.00  | 23,351,000    |                           |
| マクセルホールディング<br>ス    | 38,200    | 1,530.00  | 58,446,000    | 貸付有価証券<br>11,200株(3,300株) |
| 古野電気                | 22,800    | 895.00    | 20,406,000    | 貸付有価証券<br>3,100株          |
| ユニデンホールディング<br>ス    | 5,200     | 1,768.00  | 9,193,600     |                           |
| スミダコーポレーション         | 13,600    | 1,004.00  | 13,654,400    |                           |
| アイコム                | 9,800     | 2,153.00  | 21,099,400    |                           |
| リオン                 | 8,100     | 2,270.00  | 18,387,000    |                           |

|             |         |           |               |                        |
|-------------|---------|-----------|---------------|------------------------|
| 本多通信工業      | 15,200  | 461.00    | 7,007,200     | 貸付有価証券<br>100株         |
| 船井電機        | 17,900  | 539.00    | 9,648,100     | 貸付有価証券<br>7,700株       |
| 横河電機        | 177,600 | 1,949.00  | 346,142,400   |                        |
| 新電元工業       | 6,300   | 3,170.00  | 19,971,000    |                        |
| アズビル        | 112,000 | 2,765.00  | 309,680,000   | 貸付有価証券<br>14,000株      |
| 東亜ディーケーケー   | 8,800   | 829.00    | 7,295,200     | 貸付有価証券<br>4,800株(200株) |
| 日本光電工業      | 78,200  | 2,945.00  | 230,299,000   |                        |
| チノー         | 6,100   | 1,319.00  | 8,045,900     |                        |
| 共和電業        | 18,600  | 406.00    | 7,551,600     | 貸付有価証券<br>2,200株       |
| 日本電子材料      | 7,000   | 498.00    | 3,486,000     | 貸付有価証券<br>800株         |
| 堀場製作所       | 35,200  | 5,750.00  | 202,400,000   | 貸付有価証券<br>8,800株       |
| アドバンテスト     | 121,000 | 4,610.00  | 557,810,000   | 貸付有価証券<br>200株         |
| 小野測器        | 7,400   | 492.00    | 3,640,800     | 貸付有価証券<br>1,000株       |
| エスベック       | 15,700  | 1,843.00  | 28,935,100    |                        |
| キーエンス       | 87,100  | 64,190.00 | 5,590,949,000 | 貸付有価証券<br>10,600株      |
| 日置電機        | 9,300   | 3,310.00  | 30,783,000    | 貸付有価証券<br>1,100株       |
| シスメックス      | 138,300 | 6,901.00  | 954,408,300   | 貸付有価証券<br>24,100株      |
| 日本マイクロニクス   | 30,900  | 813.00    | 25,121,700    | 貸付有価証券<br>4,300株       |
| メガチップス      | 14,000  | 1,635.00  | 22,890,000    | 貸付有価証券<br>6,300株       |
| OBARA GROUP | 9,200   | 3,520.00  | 32,384,000    | 貸付有価証券<br>1,100株       |
| 澤藤電機        | 2,100   | 1,630.00  | 3,423,000     |                        |
| 原田工業        | 7,200   | 829.00    | 5,968,800     | 貸付有価証券<br>4,000株       |
| コーセル        | 21,600  | 1,054.00  | 22,766,400    | 貸付有価証券<br>9,600株(800株) |
| イリソ電子工業     | 16,300  | 4,895.00  | 79,788,500    | 貸付有価証券                 |

|                  |         |           |               |                           |
|------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
|                  |         |           |               | 8,300株(500株)              |
| オブテックスグループ       | 29,100  | 1,513.00  | 44,028,300    | 貸付有価証券<br>3,900株          |
| 千代田インテグレ         | 8,200   | 1,986.00  | 16,285,200    | 貸付有価証券<br>900株            |
| アイ・オー・データ機器      | 6,500   | 862.00    | 5,603,000     | 貸付有価証券<br>700株            |
| レーザーテック          | 36,400  | 6,490.00  | 236,236,000   | 貸付有価証券<br>5,000株(200株)    |
| スタンレー電気          | 125,200 | 2,661.00  | 333,157,200   |                           |
| 岩崎電気             | 6,900   | 1,190.00  | 8,211,000     | 貸付有価証券<br>800株            |
| ウシオ電機            | 103,100 | 1,452.00  | 149,701,200   | 貸付有価証券<br>12,600株         |
| 岡谷電機産業           | 12,600  | 365.00    | 4,599,000     | 貸付有価証券<br>4,400株          |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 16,300  | 538.00    | 8,769,400     | 貸付有価証券<br>2,300株          |
| エノモト             | 4,900   | 895.00    | 4,385,500     |                           |
| 日本セラミック          | 18,000  | 2,719.00  | 48,942,000    | 貸付有価証券<br>4,300株          |
| 遠藤照明             | 9,000   | 651.00    | 5,859,000     | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| 古河電池             | 12,700  | 578.00    | 7,340,600     | 貸付有価証券<br>4,400株          |
| 双信電機             | 8,600   | 428.00    | 3,680,800     | 貸付有価証券<br>4,700株          |
| 山一電機             | 12,900  | 1,203.00  | 15,518,700    | 貸付有価証券<br>2,500株(1,500株)  |
| 図研               | 11,500  | 1,833.00  | 21,079,500    | 貸付有価証券<br>1,400株          |
| 日本電子             | 35,000  | 2,418.00  | 84,630,000    | 貸付有価証券<br>4,200株          |
| カシオ計算機           | 157,000 | 1,565.00  | 245,705,000   | 貸付有価証券<br>13,000株(1,000株) |
| ファナック            | 168,600 | 18,605.00 | 3,136,803,000 |                           |
| 日本シイエムケイ         | 45,200  | 532.00    | 24,046,400    | 貸付有価証券<br>19,500株         |
| エンプラス            | 8,000   | 3,270.00  | 26,160,000    |                           |
| 大真空              | 6,500   | 987.00    | 6,415,500     | 貸付有価証券<br>100株            |
| ローム              | 84,900  | 8,110.00  | 688,539,000   |                           |

|                     |         |           |               |                             |
|---------------------|---------|-----------|---------------|-----------------------------|
| 浜松ホトニクス             | 127,300 | 3,705.00  | 471,646,500   | 貸付有価証券<br>16,300株           |
| 三井ハイテック             | 19,600  | 1,375.00  | 26,950,000    | 貸付有価証券<br>9,000株（1,200株）    |
| 新光電気工業              | 59,600  | 895.00    | 53,342,000    |                             |
| 京セラ                 | 270,500 | 6,549.00  | 1,771,504,500 |                             |
| 太陽誘電                | 78,900  | 2,245.00  | 177,130,500   | 貸付有価証券<br>52,800株           |
| 村田製作所               | 558,600 | 4,794.00  | 2,677,928,400 | 貸付有価証券<br>68,300株           |
| 双葉電子工業              | 28,100  | 1,289.00  | 36,220,900    |                             |
| 北陸電気工業              | 6,600   | 971.00    | 6,408,600     | 貸付有価証券<br>800株              |
| ニチコン                | 55,900  | 919.00    | 51,372,100    | 貸付有価証券<br>3,700株            |
| 日本ケミコン              | 12,600  | 1,422.00  | 17,917,200    | 貸付有価証券<br>4,800株            |
| K O A               | 26,800  | 1,261.00  | 33,794,800    | 貸付有価証券<br>3,200株            |
| 市光工業                | 26,500  | 776.00    | 20,564,000    | 貸付有価証券<br>3,600株            |
| 小糸製作所               | 106,300 | 5,010.00  | 532,563,000   |                             |
| ミツバ                 | 32,700  | 563.00    | 18,410,100    | 貸付有価証券<br>5,600株            |
| S C R E E Nホールディングス | 30,800  | 6,360.00  | 195,888,000   | 貸付有価証券<br>5,700株            |
| キャノン電子              | 18,600  | 1,773.00  | 32,977,800    | 貸付有価証券<br>2,200株            |
| キャノン                | 955,400 | 2,792.00  | 2,667,476,800 | 貸付有価証券<br>637,900株（44,200株） |
| リコー                 | 533,600 | 960.00    | 512,256,000   | 貸付有価証券<br>70,900株           |
| 象印マホービン             | 52,000  | 1,343.00  | 69,836,000    | 貸付有価証券<br>34,700株           |
| M U T O Hホールディングス   | 2,400   | 1,610.00  | 3,864,000     |                             |
| 東京エレクトロン            | 118,300 | 20,005.00 | 2,366,591,500 | 貸付有価証券<br>14,400株           |
| トヨタ紡織               | 62,000  | 1,462.00  | 90,644,000    | 貸付有価証券<br>7,500株            |
| 芦森工業                | 3,700   | 1,301.00  | 4,813,700     | 貸付有価証券                      |

|                 |           |          |                |                           |
|-----------------|-----------|----------|----------------|---------------------------|
|                 |           |          |                | 1,000株                    |
| ユニプレス           | 34,400    | 1,707.00 | 58,720,800     | 貸付有価証券<br>4,200株          |
| 豊田自動織機          | 143,600   | 5,960.00 | 855,856,000    | 貸付有価証券<br>20,400株         |
| モリタホールディングス     | 31,000    | 1,658.00 | 51,398,000     | 貸付有価証券<br>3,700株          |
| 三櫻工業            | 22,500    | 485.00   | 10,912,500     | 貸付有価証券<br>8,400株          |
| デンソー            | 390,800   | 4,596.00 | 1,796,116,800  | 貸付有価証券<br>47,800株         |
| 東海理化電機製作所       | 46,700    | 1,734.00 | 80,977,800     | 貸付有価証券<br>1,700株          |
| 三井E & Sホールディングス | 64,100    | 836.00   | 53,587,600     | 貸付有価証券<br>17,200株(3,100株) |
| 川崎重工業           | 138,100   | 2,156.00 | 297,743,600    | 貸付有価証券<br>700株            |
| 名村造船所           | 53,300    | 247.00   | 13,165,100     | 貸付有価証券<br>6,600株          |
| サノヤスホールディングス    | 23,400    | 177.00   | 4,141,800      | 貸付有価証券<br>4,600株          |
| 日本車輛製造          | 6,500     | 2,270.00 | 14,755,000     | 貸付有価証券<br>3,100株          |
| 三菱ロジスネクスト       | 29,300    | 1,093.00 | 32,024,900     | 貸付有価証券<br>2,600株          |
| 近畿車輛            | 2,700     | 1,279.00 | 3,453,300      | 貸付有価証券<br>600株            |
| 日産自動車           | 2,093,200 | 674.00   | 1,410,816,800  | 貸付有価証券<br>7,500株          |
| いすゞ自動車          | 561,000   | 1,156.00 | 648,516,000    | 貸付有価証券<br>68,800株         |
| トヨタ自動車          | 1,977,900 | 7,030.00 | 13,904,637,000 | 貸付有価証券<br>900株            |
| 日野自動車           | 221,600   | 867.00   | 192,127,200    | 貸付有価証券<br>27,100株         |
| 三菱自動車工業         | 657,000   | 460.00   | 302,220,000    | 貸付有価証券<br>2,500株          |
| エフテック           | 12,400    | 703.00   | 8,717,200      |                           |
| レシップホールディングス    | 6,300     | 777.00   | 4,895,100      | 貸付有価証券<br>100株            |
| G M B           | 3,400     | 732.00   | 2,488,800      | 貸付有価証券<br>100株            |

|             |           |          |               |                            |
|-------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| ファルテック      | 3,100     | 707.00   | 2,191,700     |                            |
| 武蔵精密工業      | 43,100    | 1,301.00 | 56,073,100    |                            |
| 日産車体        | 34,700    | 945.00   | 32,791,500    | 貸付有価証券<br>4,400株           |
| 新明和工業       | 74,400    | 1,290.00 | 95,976,000    | 貸付有価証券<br>9,000株           |
| 極東開発工業      | 35,300    | 1,167.00 | 41,195,100    | 貸付有価証券<br>4,300株           |
| 日信工業        | 32,500    | 1,382.00 | 44,915,000    |                            |
| トピー工業       | 14,600    | 1,882.00 | 27,477,200    |                            |
| ティラド        | 6,400     | 1,756.00 | 11,238,400    |                            |
| タチエス        | 29,100    | 1,244.00 | 36,200,400    | 貸付有価証券<br>4,100株           |
| N O K       | 95,400    | 1,552.00 | 148,060,800   | 貸付有価証券<br>16,000株          |
| フタバ産業       | 49,400    | 718.00   | 35,469,200    | 貸付有価証券<br>11,100株          |
| K Y B       | 18,400    | 2,946.00 | 54,206,400    | 貸付有価証券<br>600株             |
| 大同メタル工業     | 28,800    | 610.00   | 17,568,000    |                            |
| プレス工業       | 88,000    | 449.00   | 39,512,000    |                            |
| ミクニ         | 22,500    | 303.00   | 6,817,500     |                            |
| 太平洋工業       | 37,200    | 1,454.00 | 54,088,800    | 貸付有価証券<br>4,500株           |
| ケーヒン        | 40,800    | 1,536.00 | 62,668,800    | 貸付有価証券<br>4,900株           |
| 河西工業        | 21,800    | 759.00   | 16,546,200    |                            |
| アイシン精機      | 146,100   | 3,300.00 | 482,130,000   |                            |
| マツダ         | 557,000   | 926.30   | 515,949,100   |                            |
| 今仙電機製作所     | 16,500    | 846.00   | 13,959,000    | 貸付有価証券<br>200株             |
| 本田技研工業      | 1,497,300 | 2,734.00 | 4,093,618,200 | 貸付有価証券<br>183,300株         |
| スズキ         | 324,700   | 4,196.00 | 1,362,441,200 | 貸付有価証券<br>44,500株          |
| S U B A R U | 551,000   | 2,935.00 | 1,617,185,000 |                            |
| 安永          | 8,600     | 1,355.00 | 11,653,000    | 貸付有価証券<br>5,600株           |
| ヤマハ発動機      | 231,400   | 1,790.00 | 414,206,000   | 貸付有価証券<br>154,500株(20,200) |

|            |         |           |               |                           |
|------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
|            |         |           |               | 株)                        |
| ショーワ       | 41,900  | 1,390.00  | 58,241,000    | 貸付有価証券<br>5,100株          |
| T B K      | 21,100  | 385.00    | 8,123,500     | 貸付有価証券<br>2,700株(100株)    |
| エクセディ      | 24,100  | 2,007.00  | 48,368,700    |                           |
| 豊田合成       | 57,300  | 2,058.00  | 117,923,400   |                           |
| 愛三工業       | 27,800  | 755.00    | 20,989,000    |                           |
| 盟和産業       | 2,700   | 1,023.00  | 2,762,100     | 貸付有価証券<br>300株            |
| 日本プラスト     | 13,900  | 673.00    | 9,354,700     |                           |
| ヨロズ        | 16,600  | 1,261.00  | 20,932,600    |                           |
| エフ・シー・シー   | 31,900  | 2,003.00  | 63,895,700    |                           |
| シマノ        | 66,400  | 15,490.00 | 1,028,536,000 | 貸付有価証券<br>15,200株(4,900株) |
| テイ・エス テック  | 41,200  | 2,954.00  | 121,704,800   |                           |
| ジャムコ       | 8,900   | 1,460.00  | 12,994,000    | 貸付有価証券<br>2,700株          |
| テルモ        | 502,200 | 3,116.00  | 1,564,855,200 | 貸付有価証券<br>77,400株(6,200株) |
| クリエートメディック | 5,900   | 903.00    | 5,327,700     | 貸付有価証券<br>700株            |
| 日機装        | 53,200  | 1,145.00  | 60,914,000    | 貸付有価証券<br>8,000株(700株)    |
| 島津製作所      | 228,400 | 2,649.00  | 605,031,600   | 貸付有価証券<br>28,200株         |
| J M S      | 16,400  | 607.00    | 9,954,800     |                           |
| クボテック      | 3,800   | 418.00    | 1,588,400     | 貸付有価証券<br>2,500株          |
| 長野計器       | 13,900  | 687.00    | 9,549,300     |                           |
| ブイ・テクノロジー  | 8,300   | 5,390.00  | 44,737,000    | 貸付有価証券<br>1,200株          |
| 東京計器       | 11,300  | 863.00    | 9,751,900     |                           |
| 愛知時計電機     | 2,300   | 3,870.00  | 8,901,000     |                           |
| インターアクション  | 9,500   | 1,973.00  | 18,743,500    | 貸付有価証券<br>4,900株          |
| オーバル       | 17,300  | 223.00    | 3,857,900     | 貸付有価証券<br>2,100株          |
| 東京精密       | 32,100  | 3,095.00  | 99,349,500    |                           |
| マニー        | 70,700  | 2,507.00  | 177,244,900   | 貸付有価証券                    |

|                   |           |          |               |                        |
|-------------------|-----------|----------|---------------|------------------------|
|                   |           |          |               | 16,200株（300株）          |
| ニコン               | 309,300   | 1,356.00 | 419,410,800   | 貸付有価証券<br>9,200株       |
| トプコン              | 95,300    | 1,309.00 | 124,747,700   | 貸付有価証券<br>11,700株      |
| オリンパス             | 1,057,600 | 1,395.00 | 1,475,352,000 | 貸付有価証券<br>151,600株     |
| 理研計器              | 15,600    | 1,880.00 | 29,328,000    | 貸付有価証券<br>1,500株       |
| タムロン              | 14,300    | 2,184.00 | 31,231,200    | 貸付有価証券<br>1,900株       |
| H O Y A           | 357,300   | 9,000.00 | 3,215,700,000 |                        |
| シード               | 7,500     | 857.00   | 6,427,500     | 貸付有価証券<br>1,100株       |
| ノーリツ鋼機            | 14,000    | 1,848.00 | 25,872,000    | 貸付有価証券<br>1,900株       |
| エー・アンド・デイ         | 16,200    | 672.00   | 10,886,400    | 貸付有価証券<br>1,900株       |
| 朝日インテック           | 150,600   | 2,460.00 | 370,476,000   | 貸付有価証券<br>30,700株      |
| シチズン時計            | 194,200   | 513.00   | 99,624,600    | 貸付有価証券<br>23,800株      |
| リズム時計工業           | 6,000     | 900.00   | 5,400,000     | 貸付有価証券<br>700株         |
| 大研医器              | 14,000    | 525.00   | 7,350,000     | 貸付有価証券<br>800株         |
| メニコン              | 24,300    | 3,925.00 | 95,377,500    | 貸付有価証券<br>16,000株      |
| シンシア              | 1,900     | 655.00   | 1,244,500     | 貸付有価証券<br>1,000株       |
| 松風                | 8,700     | 1,501.00 | 13,058,700    |                        |
| セイコーホールディングス      | 27,400    | 2,259.00 | 61,896,600    | 貸付有価証券<br>800株         |
| ニプロ               | 122,800   | 1,153.00 | 141,588,400   |                        |
| 中本パックス            | 5,000     | 1,387.00 | 6,935,000     | 貸付有価証券<br>200株         |
| スノーピーク            | 8,000     | 1,338.00 | 10,704,000    | 貸付有価証券<br>1,900株       |
| パラマウントベッドホールディングス | 20,400    | 3,990.00 | 81,396,000    | 貸付有価証券<br>300株         |
| トランザクション          | 11,300    | 1,118.00 | 12,633,400    | 貸付有価証券<br>2,000株（700株） |

|                 |         |          |               |                   |
|-----------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| SHO - B I       | 5,200   | 376.00   | 1,955,200     | 貸付有価証券<br>2,800株  |
| ニホンフラッシュ        | 7,600   | 2,443.00 | 18,566,800    | 貸付有価証券<br>300株    |
| 前田工織            | 19,600  | 1,399.00 | 27,420,400    | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 永大産業            | 23,200  | 315.00   | 7,308,000     | 貸付有価証券<br>400株    |
| アートネイチャー        | 19,000  | 630.00   | 11,970,000    |                   |
| バンダイナムコホールディングス | 183,500 | 6,400.00 | 1,174,400,000 | 貸付有価証券<br>30,200株 |
| アイフィスジャパン       | 4,500   | 716.00   | 3,222,000     | 貸付有価証券<br>600株    |
| 共立印刷            | 29,600  | 146.00   | 4,321,600     |                   |
| SHOEI           | 8,500   | 4,450.00 | 37,825,000    | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| フランスベッドホールディングス | 25,100  | 1,007.00 | 25,275,700    |                   |
| パイロットコーポレーション   | 31,000  | 3,695.00 | 114,545,000   | 貸付有価証券<br>3,700株  |
| 萩原工業            | 9,900   | 1,385.00 | 13,711,500    | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| トッパン・フォームズ      | 38,000  | 929.00   | 35,302,000    | 貸付有価証券<br>5,000株  |
| フジシールインターナショナル  | 39,800  | 2,782.00 | 110,723,600   | 貸付有価証券<br>4,800株  |
| タカラトミー          | 74,300  | 1,100.00 | 81,730,000    |                   |
| 廣濟堂             | 16,500  | 698.00   | 11,517,000    | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| エステールホールディングス   | 4,700   | 614.00   | 2,885,800     | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| アーク             | 67,700  | 89.00    | 6,025,300     | 貸付有価証券<br>8,800株  |
| タカノ             | 6,900   | 727.00   | 5,016,300     | 貸付有価証券<br>3,800株  |
| プロネクサス          | 15,200  | 1,040.00 | 15,808,000    | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| ホクシン            | 10,900  | 145.00   | 1,580,500     |                   |
| ウッドワン           | 6,000   | 1,031.00 | 6,186,000     |                   |
| 大建工業            | 13,400  | 1,813.00 | 24,294,200    | 貸付有価証券<br>1,600株  |

|             |         |           |               |                           |
|-------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| 凸版印刷        | 263,800 | 1,792.00  | 472,729,600   | 貸付有価証券<br>30,600株         |
| 大日本印刷       | 250,100 | 2,390.00  | 597,739,000   |                           |
| 共同印刷        | 5,500   | 2,630.00  | 14,465,000    |                           |
| N I S S H A | 36,400  | 973.00    | 35,417,200    | 貸付有価証券<br>10,600株         |
| 光村印刷        | 1,500   | 1,688.00  | 2,532,000     |                           |
| 宝印刷         | 8,600   | 1,595.00  | 13,717,000    | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| アシックス       | 146,500 | 1,489.00  | 218,138,500   | 貸付有価証券<br>97,800株         |
| ツツミ         | 5,500   | 1,910.00  | 10,505,000    |                           |
| 小松ウオール工業    | 5,400   | 1,891.00  | 10,211,400    |                           |
| ヤマハ         | 105,600 | 4,615.00  | 487,344,000   | 貸付有価証券<br>12,900株         |
| 河合楽器製作所     | 5,500   | 2,840.00  | 15,620,000    | 貸付有価証券<br>100株            |
| クリナップ       | 16,500  | 543.00    | 8,959,500     | 貸付有価証券<br>2,100株          |
| ピジョン        | 107,300 | 4,200.00  | 450,660,000   | 貸付有価証券<br>71,600株（9,200株） |
| 兼松サステック     | 1,100   | 1,763.00  | 1,939,300     |                           |
| キングジム       | 14,800  | 849.00    | 12,565,200    | 貸付有価証券<br>2,800株          |
| リンテック       | 42,200  | 2,046.00  | 86,341,200    | 貸付有価証券<br>500株            |
| イトーキ        | 37,700  | 400.00    | 15,080,000    | 貸付有価証券<br>4,900株          |
| 任天堂         | 101,600 | 41,450.00 | 4,211,320,000 | 貸付有価証券<br>9,300株          |
| 三菱鉛筆        | 29,200  | 1,684.00  | 49,172,800    | 貸付有価証券<br>3,500株          |
| タカラスタナード    | 36,700  | 1,678.00  | 61,582,600    | 貸付有価証券<br>4,500株          |
| コクヨ         | 85,100  | 1,396.00  | 118,799,600   | 貸付有価証券<br>11,500株         |
| ナカバヤシ       | 17,500  | 503.00    | 8,802,500     |                           |
| グローブライド     | 8,600   | 2,887.00  | 24,828,200    |                           |
| オカムラ        | 61,900  | 1,091.00  | 67,532,900    | 貸付有価証券<br>7,500株          |
| 美津濃         | 17,600  | 2,671.00  | 47,009,600    |                           |

|                |           |          |             |                            |
|----------------|-----------|----------|-------------|----------------------------|
| 東京電力ホールディングス   | 1,416,900 | 508.00   | 719,785,200 | 貸付有価証券<br>765,300株         |
| 中部電力           | 543,000   | 1,525.50 | 828,346,500 | 貸付有価証券<br>74,600株          |
| 関西電力           | 724,200   | 1,271.00 | 920,458,200 | 貸付有価証券<br>90,100株          |
| 中国電力           | 245,400   | 1,351.00 | 331,535,400 | 貸付有価証券<br>80,900株（27,100株） |
| 北陸電力           | 173,900   | 652.00   | 113,382,800 | 貸付有価証券<br>15,300株          |
| 東北電力           | 415,700   | 1,024.00 | 425,676,800 | 貸付有価証券<br>1,200株           |
| 四国電力           | 159,800   | 990.00   | 158,202,000 | 貸付有価証券<br>10,100株          |
| 九州電力           | 365,800   | 1,019.00 | 372,750,200 | 貸付有価証券<br>47,200株          |
| 北海道電力          | 166,100   | 544.00   | 90,358,400  | 貸付有価証券<br>20,600株          |
| 沖縄電力           | 32,900    | 1,614.00 | 53,100,600  |                            |
| 電源開発           | 141,200   | 2,402.00 | 339,162,400 |                            |
| エフオン           | 8,300     | 707.00   | 5,868,100   | 貸付有価証券<br>1,100株           |
| イーレックス         | 30,800    | 1,110.00 | 34,188,000  |                            |
| レノバ            | 29,200    | 831.00   | 24,265,200  | 貸付有価証券<br>12,100株          |
| 東京瓦斯           | 348,200   | 2,616.50 | 911,065,300 | 貸付有価証券<br>42,600株          |
| 大阪瓦斯           | 344,400   | 1,893.00 | 651,949,200 | 貸付有価証券<br>43,500株          |
| 東邦瓦斯           | 87,900    | 4,040.00 | 355,116,000 | 貸付有価証券<br>11,600株          |
| 北海道瓦斯          | 9,500     | 1,496.00 | 14,212,000  |                            |
| 広島ガス           | 36,500    | 327.00   | 11,935,500  | 貸付有価証券<br>3,900株           |
| 西部瓦斯           | 20,000    | 2,260.00 | 45,200,000  | 貸付有価証券<br>1,700株           |
| 静岡ガス           | 50,400    | 860.00   | 43,344,000  | 貸付有価証券<br>6,600株           |
| メタウォーター        | 8,600     | 3,580.00 | 30,788,000  |                            |
| S B S ホールディングス | 15,300    | 1,512.00 | 23,133,600  | 貸付有価証券<br>1,900株           |

|                |         |           |               |                         |
|----------------|---------|-----------|---------------|-------------------------|
| 東武鉄道           | 187,200 | 3,315.00  | 620,568,000   | 貸付有価証券<br>22,900株       |
| 相鉄ホールディングス     | 60,800  | 2,776.00  | 168,780,800   | 貸付有価証券<br>33,100株       |
| 東急             | 482,100 | 1,884.00  | 908,276,400   | 貸付有価証券<br>78,800株       |
| 京浜急行電鉄         | 243,100 | 1,927.00  | 468,453,700   | 貸付有価証券<br>30,000株       |
| 小田急電鉄          | 284,300 | 2,396.00  | 681,182,800   | 貸付有価証券<br>100株          |
| 京王電鉄           | 99,200  | 6,470.00  | 641,824,000   | 貸付有価証券<br>15,900株       |
| 京成電鉄           | 133,000 | 4,230.00  | 562,590,000   | 貸付有価証券<br>100株          |
| 富士急行           | 24,200  | 4,430.00  | 107,206,000   | 貸付有価証券<br>16,100株（100株） |
| 新京成電鉄          | 4,600   | 2,013.00  | 9,259,800     | 貸付有価証券<br>2,500株        |
| 東日本旅客鉄道        | 315,600 | 10,005.00 | 3,157,578,000 | 貸付有価証券<br>38,700株       |
| 西日本旅客鉄道        | 159,100 | 9,077.00  | 1,444,150,700 | 貸付有価証券<br>19,400株       |
| 東海旅客鉄道         | 158,900 | 20,790.00 | 3,303,531,000 | 貸付有価証券<br>500株（500株）    |
| 西武ホールディングス     | 219,800 | 1,800.00  | 395,640,000   | 貸付有価証券<br>27,600株       |
| 鴻池運輸           | 28,200  | 1,654.00  | 46,642,800    | 貸付有価証券<br>3,400株        |
| 西日本鉄道          | 49,200  | 2,385.00  | 117,342,000   | 貸付有価証券<br>30,800株       |
| ハマキョウレックス      | 13,600  | 3,580.00  | 48,688,000    |                         |
| サカイ引越センター      | 9,300   | 6,040.00  | 56,172,000    | 貸付有価証券<br>1,500株        |
| 近鉄グループホールディングス | 168,100 | 5,310.00  | 892,611,000   | 貸付有価証券<br>20,600株       |
| 阪急阪神ホールディングス   | 224,200 | 4,040.00  | 905,768,000   | 貸付有価証券<br>27,400株       |
| 南海電気鉄道         | 75,000  | 2,711.00  | 203,325,000   | 貸付有価証券<br>40,800株       |
| 京阪ホールディングス     | 74,800  | 4,465.00  | 333,982,000   | 貸付有価証券<br>9,100株        |
| 神戸電鉄           | 4,300   | 3,940.00  | 16,942,000    | 貸付有価証券                  |

|                  |         |          |             |                        |
|------------------|---------|----------|-------------|------------------------|
|                  |         |          |             | 2,800株                 |
| 名古屋鉄道            | 138,100 | 3,190.00 | 440,539,000 | 貸付有価証券<br>73,600株      |
| 山陽電気鉄道           | 12,900  | 2,065.00 | 26,638,500  | 貸付有価証券<br>8,600株       |
| 日本通運             | 64,800  | 5,460.00 | 353,808,000 | 貸付有価証券<br>8,000株       |
| ヤマトホールディングス      | 294,700 | 1,815.00 | 534,880,500 |                        |
| 山九               | 46,700  | 5,180.00 | 241,906,000 |                        |
| 丸運               | 9,600   | 258.00   | 2,476,800   | 貸付有価証券<br>1,100株       |
| 丸全昭和運輸           | 13,600  | 3,035.00 | 41,276,000  | 貸付有価証券<br>1,600株       |
| センコーグループホールディングス | 92,700  | 838.00   | 77,682,600  | 貸付有価証券<br>1,500株       |
| トナミホールディングス      | 4,000   | 4,160.00 | 16,640,000  |                        |
| ニッコンホールディングス     | 63,900  | 2,407.00 | 153,807,300 | 貸付有価証券<br>7,800株       |
| 日本石油輸送           | 2,000   | 2,862.00 | 5,724,000   |                        |
| 福山通運             | 21,500  | 3,580.00 | 76,970,000  |                        |
| セイノーホールディングス     | 125,900 | 1,338.00 | 168,454,200 | 貸付有価証券<br>100株         |
| エスライン            | 5,000   | 813.00   | 4,065,000   |                        |
| 神奈川中央交通          | 4,200   | 3,740.00 | 15,708,000  | 貸付有価証券<br>2,300株       |
| 日立物流             | 37,000  | 3,270.00 | 120,990,000 | 貸付有価証券<br>4,600株       |
| 丸和運輸機関           | 8,900   | 5,260.00 | 46,814,000  | 貸付有価証券<br>3,800株(100株) |
| C & F ロジホールディングス | 17,000  | 1,200.00 | 20,400,000  | 貸付有価証券<br>2,200株       |
| 九州旅客鉄道           | 141,100 | 3,190.00 | 450,109,000 |                        |
| S Gホールディングス      | 158,800 | 2,812.00 | 446,545,600 | 貸付有価証券<br>19,700株      |
| 日本郵船             | 140,600 | 1,701.00 | 239,160,600 | 貸付有価証券<br>700株         |
| 商船三井             | 99,700  | 2,708.00 | 269,987,600 |                        |
| 川崎汽船             | 51,800  | 1,227.00 | 63,558,600  | 貸付有価証券<br>34,500株      |
| N S ユナイテッド海運     | 9,200   | 2,242.00 | 20,626,400  | 貸付有価証券<br>1,300株       |

|               |         |          |               |                           |
|---------------|---------|----------|---------------|---------------------------|
| 明治海運          | 17,900  | 299.00   | 5,352,100     | 貸付有価証券<br>2,300株          |
| 飯野海運          | 79,600  | 327.00   | 26,029,200    | 貸付有価証券<br>200株            |
| 共栄タンカー        | 1,500   | 1,336.00 | 2,004,000     |                           |
| 乾汽船           | 15,100  | 944.00   | 14,254,400    | 貸付有価証券<br>2,500株          |
| 日本航空          | 307,700 | 3,306.00 | 1,017,256,200 | 貸付有価証券<br>19,300株         |
| A N Aホールディングス | 307,300 | 3,597.00 | 1,105,358,100 | 貸付有価証券<br>14,700株(1,900株) |
| パスコ           | 3,300   | 897.00   | 2,960,100     | 貸付有価証券<br>500株            |
| トランコム         | 4,700   | 5,710.00 | 26,837,000    |                           |
| 日新            | 14,500  | 1,463.00 | 21,213,500    |                           |
| 三菱倉庫          | 58,200  | 2,644.00 | 153,880,800   | 貸付有価証券<br>9,400株          |
| 三井倉庫ホールディングス  | 20,600  | 1,608.00 | 33,124,800    |                           |
| 住友倉庫          | 61,900  | 1,405.00 | 86,969,500    | 貸付有価証券<br>7,700株          |
| 澁澤倉庫          | 9,200   | 1,843.00 | 16,955,600    | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| 東陽倉庫          | 30,300  | 294.00   | 8,908,200     | 貸付有価証券<br>500株(200株)      |
| 日本トランスシティ     | 37,000  | 442.00   | 16,354,000    | 貸付有価証券<br>4,200株(100株)    |
| ケイヒン          | 3,200   | 1,198.00 | 3,833,600     |                           |
| 中央倉庫          | 10,200  | 997.00   | 10,169,400    | 貸付有価証券<br>400株            |
| 川西倉庫          | 3,400   | 1,043.00 | 3,546,200     | 貸付有価証券<br>1,800株          |
| 安田倉庫          | 13,800  | 912.00   | 12,585,600    | 貸付有価証券<br>100株            |
| ファイズ          | 3,000   | 749.00   | 2,247,000     | 貸付有価証券<br>1,500株(900株)    |
| 東洋埠頭          | 5,100   | 1,306.00 | 6,660,600     | 貸付有価証券<br>200株            |
| 宇徳            | 14,400  | 498.00   | 7,171,200     | 貸付有価証券<br>1,700株          |
| 上組            | 103,700 | 2,419.00 | 250,850,300   |                           |

|                  |         |          |             |                         |
|------------------|---------|----------|-------------|-------------------------|
| サンリツ             | 4,000   | 641.00   | 2,564,000   | 貸付有価証券<br>400株          |
| キムラユニティー         | 4,500   | 1,000.00 | 4,500,000   | 貸付有価証券<br>100株(100株)    |
| キューソー流通システム      | 4,200   | 1,760.00 | 7,392,000   | 貸付有価証券<br>700株          |
| 近鉄エクスプレス         | 31,700  | 1,442.00 | 45,711,400  |                         |
| 東海運              | 9,600   | 280.00   | 2,688,000   | 貸付有価証券<br>1,300株        |
| エーアイティー          | 10,900  | 894.00   | 9,744,600   | 貸付有価証券<br>1,400株        |
| 内外トランスライン        | 5,900   | 1,229.00 | 7,251,100   | 貸付有価証券<br>700株          |
| 日本コンセプト          | 5,300   | 1,321.00 | 7,001,300   | 貸付有価証券<br>800株          |
| NEC ネットエスアイ      | 19,200  | 2,813.00 | 54,009,600  | 貸付有価証券<br>2,300株        |
| クロスキャット          | 4,600   | 985.00   | 4,531,000   | 貸付有価証券<br>1,800株        |
| システナ             | 62,100  | 1,534.00 | 95,261,400  |                         |
| デジタルアーツ          | 9,300   | 7,700.00 | 71,610,000  |                         |
| 日鉄ソリューションズ       | 26,100  | 3,570.00 | 93,177,000  | 貸付有価証券<br>100株          |
| キューブシステム         | 9,300   | 750.00   | 6,975,000   | 貸付有価証券<br>5,000株        |
| エイジア             | 3,400   | 1,232.00 | 4,188,800   |                         |
| コア               | 7,400   | 1,307.00 | 9,671,800   | 貸付有価証券<br>1,200株        |
| ソリトンシステムズ        | 7,600   | 1,045.00 | 7,942,000   | 貸付有価証券<br>2,600株        |
| ソフトクリエイトホールディングス | 7,600   | 1,689.00 | 12,836,400  |                         |
| T I S            | 58,100  | 6,380.00 | 370,678,000 |                         |
| ネオス              | 7,000   | 744.00   | 5,208,000   | 貸付有価証券<br>4,600株(500株)  |
| 電算システム           | 6,600   | 2,811.00 | 18,552,600  | 貸付有価証券<br>800株          |
| グリー              | 120,100 | 466.00   | 55,966,600  | 貸付有価証券<br>17,300株(800株) |
| コーエーテクモホールディングス  | 35,600  | 2,227.00 | 79,281,200  | 貸付有価証券<br>4,300株        |

|                         |         |          |             |                            |
|-------------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 三菱総合研究所                 | 7,500   | 3,560.00 | 26,700,000  | 貸付有価証券<br>300株             |
| ボルテージ                   | 3,200   | 492.00   | 1,574,400   | 貸付有価証券<br>300株             |
| 電算                      | 1,900   | 2,020.00 | 3,838,000   | 貸付有価証券<br>200株             |
| A G S                   | 9,800   | 657.00   | 6,438,600   | 貸付有価証券<br>300株             |
| ファインデックス                | 14,700  | 1,005.00 | 14,773,500  | 貸付有価証券<br>4,600株（2,600株）   |
| ブレインパッド                 | 3,400   | 6,550.00 | 22,270,000  | 貸付有価証券<br>1,400株           |
| K L a b                 | 33,400  | 1,347.00 | 44,989,800  | 貸付有価証券<br>22,300株（900株）    |
| ポルトゥウィン・ピット<br>クルーホールディ | 23,100  | 1,203.00 | 27,789,300  | 貸付有価証券<br>2,800株           |
| イーブックイニシアティ<br>ブジャパン    | 2,800   | 1,774.00 | 4,967,200   | 貸付有価証券<br>1,800株           |
| ネクソン                    | 494,000 | 1,405.00 | 694,070,000 | 貸付有価証券<br>329,900株（4,100株） |
| アイスタイル                  | 44,700  | 738.00   | 32,988,600  | 貸付有価証券<br>29,800株（1,400株）  |
| エムアップ                   | 6,000   | 1,930.00 | 11,580,000  | 貸付有価証券<br>4,000株           |
| エイチーム                   | 12,000  | 1,121.00 | 13,452,000  | 貸付有価証券<br>7,900株（700株）     |
| エニグモ                    | 12,300  | 1,234.00 | 15,178,200  | 貸付有価証券<br>6,400株（4,800株）   |
| テクノスジャパン                | 14,600  | 500.00   | 7,300,000   | 貸付有価証券<br>200株             |
| e n i s h               | 7,700   | 1,189.00 | 9,155,300   | 貸付有価証券<br>5,100株（700株）     |
| コロプラ                    | 57,000  | 669.00   | 38,133,000  | 貸付有価証券<br>20,200株          |
| オルトプラス                  | 11,600  | 257.00   | 2,981,200   | 貸付有価証券<br>7,700株（1,600株）   |
| ブロードリーフ                 | 86,300  | 562.00   | 48,500,600  | 貸付有価証券<br>57,600株          |
| クロス・マーケティング<br>グループ     | 7,700   | 321.00   | 2,471,700   | 貸付有価証券<br>2,700株           |
| デジタルハーツホール<br>ディングス     | 7,900   | 940.00   | 7,426,000   | 貸付有価証券<br>2,000株           |

|                      |        |          |             |                          |
|----------------------|--------|----------|-------------|--------------------------|
| システム情報               | 8,800  | 1,032.00 | 9,081,600   | 貸付有価証券<br>3,600株（3,100株） |
| メディアドゥホールディングス       | 6,200  | 3,655.00 | 22,661,000  | 貸付有価証券<br>700株           |
| じげん                  | 24,600 | 581.00   | 14,292,600  | 貸付有価証券<br>4,500株         |
| ブイキューブ               | 10,700 | 410.00   | 4,387,000   | 貸付有価証券<br>7,100株（1,500株） |
| エンカレッジ・テクノロジー        | 2,300  | 750.00   | 1,725,000   |                          |
| サイバーリンクス             | 2,700  | 1,068.00 | 2,883,600   | 貸付有価証券<br>300株           |
| ディー・エル・イー            | 12,300 | 179.00   | 2,201,700   | 貸付有価証券<br>8,200株（3,500株） |
| フィクスターズ              | 18,500 | 1,520.00 | 28,120,000  | 貸付有価証券<br>5,500株         |
| CARTA HOLDINGS       | 8,400  | 950.00   | 7,980,000   | 貸付有価証券<br>2,700株         |
| オブティム                | 7,600  | 2,860.00 | 21,736,000  | 貸付有価証券<br>3,800株（1,500株） |
| セレス                  | 5,700  | 1,280.00 | 7,296,000   | 貸付有価証券<br>3,800株         |
| ティーガイア               | 12,400 | 2,112.00 | 26,188,800  |                          |
| セック                  | 2,800  | 3,065.00 | 8,582,000   | 貸付有価証券<br>600株           |
| 日本アジアグループ            | 18,400 | 316.00   | 5,814,400   |                          |
| 豆蔵ホールディングス           | 11,800 | 1,690.00 | 19,942,000  |                          |
| テクマトリックス             | 12,300 | 2,221.00 | 27,318,300  |                          |
| プロシップ                | 5,000  | 1,170.00 | 5,850,000   | 貸付有価証券<br>300株           |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 42,000 | 2,338.00 | 98,196,000  | 貸付有価証券<br>27,800株        |
| GMOペイメントゲートウェイ       | 28,700 | 7,970.00 | 228,739,000 | 貸付有価証券<br>13,500株（100株）  |
| ザッパラス                | 9,000  | 337.00   | 3,033,000   | 貸付有価証券<br>1,200株         |
| システムリサーチ             | 2,300  | 3,920.00 | 9,016,000   |                          |
| インターネットイニシアティブ       | 28,300 | 2,472.00 | 69,957,600  |                          |
| さくらインターネット           | 20,700 | 589.00   | 12,192,300  | 貸付有価証券<br>2,500株         |

|                       |        |          |            |                          |
|-----------------------|--------|----------|------------|--------------------------|
| ヴィンクス                 | 4,900  | 1,264.00 | 6,193,600  | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| GMOクラウド               | 3,200  | 2,584.00 | 8,268,800  | 貸付有価証券<br>2,100株         |
| SRAホールディングス           | 9,200  | 2,506.00 | 23,055,200 |                          |
| Minorityソリューションズ      | 3,400  | 1,804.00 | 6,133,600  | 貸付有価証券<br>100株(100株)     |
| システムインテグレータ           | 4,900  | 648.00   | 3,175,200  | 貸付有価証券<br>2,000株         |
| 朝日ネット                 | 14,100 | 695.00   | 9,799,500  |                          |
| eBASE                 | 10,400 | 986.00   | 10,254,400 |                          |
| アバント                  | 6,200  | 1,877.00 | 11,637,400 | 貸付有価証券<br>3,400株         |
| アドソル日進                | 6,100  | 2,156.00 | 13,151,600 |                          |
| フリービット                | 10,300 | 1,135.00 | 11,690,500 | 貸付有価証券<br>5,100株(3,600株) |
| コムチュア                 | 9,800  | 3,900.00 | 38,220,000 | 貸付有価証券<br>2,500株(100株)   |
| サイバーコム                | 3,100  | 1,671.00 | 5,180,100  | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| アステリア                 | 11,600 | 625.00   | 7,250,000  | 貸付有価証券<br>2,000株(600株)   |
| アイル                   | 3,100  | 1,758.00 | 5,449,800  |                          |
| マークラインズ               | 8,700  | 1,864.00 | 16,216,800 | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| メディカル・データ・ビジョン        | 13,200 | 1,077.00 | 14,216,400 | 貸付有価証券<br>2,600株         |
| gumi                  | 22,300 | 624.00   | 13,915,200 | 貸付有価証券<br>4,300株         |
| ショーケース                | 4,100  | 738.00   | 3,025,800  | 貸付有価証券<br>2,700株         |
| モバイルファクトリー            | 3,900  | 1,639.00 | 6,392,100  | 貸付有価証券<br>2,000株         |
| テラスカイ                 | 2,800  | 1,854.00 | 5,191,200  | 貸付有価証券<br>600株           |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 7,700  | 1,552.00 | 11,950,400 | 貸付有価証券<br>2,200株(800株)   |
| PCIホールディングス           | 3,500  | 2,032.00 | 7,112,000  |                          |
| パイブドHD                | 2,700  | 1,254.00 | 3,385,800  | 貸付有価証券<br>1,800株(1,400株) |
| アイピーシー                | 3,100  | 1,054.00 | 3,267,400  | 貸付有価証券                   |

|                             |        |          |             |                          |
|-----------------------------|--------|----------|-------------|--------------------------|
|                             |        |          |             | 1,200株                   |
| ネオジャパン                      | 3,300  | 1,015.00 | 3,349,500   | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| P R T I M E S               | 1,500  | 2,988.00 | 4,482,000   |                          |
| ランドコンピュータ                   | 2,600  | 1,008.00 | 2,620,800   |                          |
| ダブルスタンダード                   | 1,500  | 4,380.00 | 6,570,000   | 貸付有価証券<br>400株           |
| オープンドア                      | 8,600  | 2,140.00 | 18,404,000  | 貸付有価証券<br>4,600株         |
| マイネット                       | 5,600  | 489.00   | 2,738,400   | 貸付有価証券<br>600株           |
| アカツキ                        | 6,100  | 7,320.00 | 44,652,000  | 貸付有価証券<br>1,200株         |
| ベネフィットジャパン                  | 1,300  | 1,633.00 | 2,122,900   | 貸付有価証券<br>800株(700株)     |
| U b i c o mホールディングス         | 3,200  | 1,588.00 | 5,081,600   | 貸付有価証券<br>900株(300株)     |
| L I N E                     | 39,800 | 3,920.00 | 156,016,000 | 貸付有価証券<br>16,900株        |
| カナミックネットワーク                 | 10,600 | 598.00   | 6,338,800   |                          |
| ノムラシステムコーポレーション             | 3,800  | 383.00   | 1,455,400   | 貸付有価証券<br>600株           |
| チェンジ                        | 3,500  | 2,084.00 | 7,294,000   | 貸付有価証券<br>2,200株(1,000株) |
| シンクロ・フード                    | 7,400  | 472.00   | 3,492,800   | 貸付有価証券<br>2,100株         |
| オークネット                      | 10,700 | 1,231.00 | 13,171,700  | 貸付有価証券<br>1,700株         |
| セグエグループ                     | 1,400  | 1,337.00 | 1,871,800   | 貸付有価証券<br>100株           |
| エイトレッド                      | 1,800  | 1,753.00 | 3,155,400   | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| A O I T Y O H o l d i n g s | 17,600 | 626.00   | 11,017,600  | 貸付有価証券<br>2,300株         |
| マクロミル                       | 30,900 | 938.00   | 28,984,200  | 貸付有価証券<br>3,900株         |
| ビーグリー                       | 3,400  | 879.00   | 2,988,600   |                          |
| オロ                          | 4,600  | 2,583.00 | 11,881,800  | 貸付有価証券<br>2,600株(1,400株) |
| テモナ                         | 2,300  | 582.00   | 1,338,600   | 貸付有価証券<br>1,300株(1,300株) |
| ニーズウェル                      | 2,100  | 715.00   | 1,501,500   | 貸付有価証券                   |

|                       |           |           |             |                            |
|-----------------------|-----------|-----------|-------------|----------------------------|
|                       |           |           |             | 400株                       |
| サインポスト                | 2,700     | 2,227.00  | 6,012,900   | 貸付有価証券<br>1,800株(1,100株)   |
| ソルクシーズ                | 7,400     | 881.00    | 6,519,400   | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| フェイス                  | 6,900     | 734.00    | 5,064,600   |                            |
| プロトコーポレーション           | 15,600    | 1,164.00  | 18,158,400  |                            |
| ハイマックス                | 2,100     | 1,844.00  | 3,872,400   | 貸付有価証券<br>100株             |
| 野村総合研究所               | 332,300   | 2,180.00  | 724,414,000 | 貸付有価証券<br>40,500株          |
| サイバネットシステム            | 12,400    | 603.00    | 7,477,200   | 貸付有価証券<br>1,500株           |
| C Eホールディングス           | 5,000     | 1,022.00  | 5,110,000   | 貸付有価証券<br>2,800株           |
| 日本システム技術              | 2,800     | 1,189.00  | 3,329,200   | 貸付有価証券<br>300株             |
| インテージホールディングス         | 21,700    | 894.00    | 19,399,800  | 貸付有価証券<br>14,400株          |
| 東邦システムサイエンス           | 5,200     | 960.00    | 4,992,000   | 貸付有価証券<br>3,400株           |
| ソースネクスト               | 67,500    | 467.00    | 31,522,500  | 貸付有価証券<br>32,600株(16,800株) |
| インフォコム                | 19,000    | 2,520.00  | 47,880,000  |                            |
| F I G                 | 18,800    | 300.00    | 5,640,000   | 貸付有価証券<br>2,700株           |
| アルテリア・ネットワークス         | 19,300    | 1,434.00  | 27,676,200  | 貸付有価証券<br>200株             |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング | 3,900     | 1,698.00  | 6,622,200   | 貸付有価証券<br>400株             |
| フォーカスシステムズ            | 11,700    | 828.00    | 9,687,600   |                            |
| クレスコ                  | 5,300     | 3,390.00  | 17,967,000  | 貸付有価証券<br>700株             |
| フジ・メディア・ホールディングス      | 180,700   | 1,376.00  | 248,643,200 |                            |
| オービック                 | 60,400    | 12,200.00 | 736,880,000 |                            |
| ジャストシステム              | 24,800    | 3,630.00  | 90,024,000  |                            |
| T D Cソフト              | 15,200    | 720.00    | 10,944,000  |                            |
| ヤフー                   | 1,135,500 | 284.00    | 322,482,000 | 貸付有価証券<br>4,500株           |
| トレンドマイクロ              | 77,400    | 5,060.00  | 391,644,000 | 貸付有価証券                     |

|                          |        |          |             |                          |
|--------------------------|--------|----------|-------------|--------------------------|
|                          |        |          |             | 49,500株(6,800株)          |
| I Dホールディングス              | 6,600  | 1,193.00 | 7,873,800   | 貸付有価証券<br>1,200株         |
| 日本オラクル                   | 35,300 | 9,110.00 | 321,583,000 | 貸付有価証券<br>12,900株        |
| アルファシステムズ                | 5,400  | 2,602.00 | 14,050,800  | 貸付有価証券<br>600株           |
| フューチャー                   | 21,000 | 1,779.00 | 37,359,000  | 貸付有価証券<br>2,500株         |
| C A C H o l d i n g<br>s | 11,300 | 1,335.00 | 15,085,500  | 貸付有価証券<br>6,800株(1,500株) |
| ソフトバンク・テクノロ<br>ジー        | 7,400  | 2,016.00 | 14,918,400  | 貸付有価証券<br>2,400株         |
| トーセ                      | 4,700  | 812.00   | 3,816,400   | 貸付有価証券<br>500株           |
| オービックビジネスコン<br>サルタント     | 17,800 | 4,330.00 | 77,074,000  | 貸付有価証券<br>3,600株(1,300株) |
| 伊藤忠テクノソリュー<br>ションズ       | 79,300 | 3,015.00 | 239,089,500 | 貸付有価証券<br>9,700株         |
| アイティフォー                  | 21,100 | 844.00   | 17,808,400  | 貸付有価証券<br>2,500株         |
| 東計電算                     | 2,600  | 2,983.00 | 7,755,800   | 貸付有価証券<br>300株           |
| エックスネット                  | 3,200  | 929.00   | 2,972,800   |                          |
| 大塚商会                     | 94,200 | 3,955.00 | 372,561,000 | 貸付有価証券<br>19,900株(900株)  |
| サイボウズ                    | 20,400 | 1,047.00 | 21,358,800  | 貸付有価証券<br>2,600株         |
| ソフトブレーン                  | 10,200 | 584.00   | 5,956,800   | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| 電通国際情報サービス               | 10,800 | 3,395.00 | 36,666,000  | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| デジタルガレージ                 | 33,900 | 3,520.00 | 119,328,000 | 貸付有価証券<br>11,400株(800株)  |
| E Mシステムズ                 | 14,200 | 1,900.00 | 26,980,000  | 貸付有価証券<br>5,100株(2,500株) |
| ウェザーニューズ                 | 5,900  | 3,140.00 | 18,526,000  | 貸付有価証券<br>700株           |
| C I J                    | 12,900 | 820.00   | 10,578,000  | 貸付有価証券<br>1,600株         |
| 東洋ビジネスエンジニア<br>リング       | 1,700  | 2,619.00 | 4,452,300   | 貸付有価証券<br>200株           |

|                                      |         |          |             |                          |
|--------------------------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| 日本エンタープライズ                           | 17,700  | 171.00   | 3,026,700   | 貸付有価証券<br>2,200株         |
| WOWOW                                | 8,300   | 2,530.00 | 20,999,000  | 貸付有価証券<br>4,500株         |
| スカラ                                  | 12,200  | 1,007.00 | 12,285,400  | 貸付有価証券<br>1,600株（100株）   |
| インテリジェント ウェ<br>イブ                    | 6,500   | 802.00   | 5,213,000   | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| I M A G I C A G R O<br>U P           | 14,700  | 464.00   | 6,820,800   | 貸付有価証券<br>6,000株（2,400株） |
| ネットワンシステムズ                           | 61,600  | 2,960.00 | 182,336,000 | 貸付有価証券<br>300株           |
| システムソフト                              | 41,200  | 107.00   | 4,408,400   | 貸付有価証券<br>500株           |
| アルゴグラフィックス                           | 14,800  | 2,559.00 | 37,873,200  |                          |
| マーベラス                                | 26,600  | 803.00   | 21,359,800  | 貸付有価証券<br>9,000株（4,000株） |
| エイベックス                               | 29,800  | 1,248.00 | 37,190,400  | 貸付有価証券<br>3,600株         |
| 日本ユニシス                               | 54,400  | 3,385.00 | 184,144,000 |                          |
| 兼松エレクトロニクス                           | 9,500   | 2,974.00 | 28,253,000  | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| 東京放送ホールディング<br>ス                     | 115,500 | 1,687.00 | 194,848,500 | 貸付有価証券<br>15,300株        |
| 日本テレビホールディン<br>グス                    | 159,900 | 1,371.00 | 219,222,900 | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| 朝日放送グループホール<br>ディングス                 | 17,300  | 703.00   | 12,161,900  | 貸付有価証券<br>9,300株         |
| テレビ朝日ホールディン<br>グス                    | 47,800  | 1,655.00 | 79,109,000  | 貸付有価証券<br>26,000株        |
| スカパー J S A T ホール<br>ディングス            | 114,600 | 420.00   | 48,132,000  |                          |
| テレビ東京ホールディン<br>グス                    | 14,300  | 2,114.00 | 30,230,200  | 貸付有価証券<br>1,700株         |
| 日本 B S 放送                            | 5,900   | 1,055.00 | 6,224,500   | 貸付有価証券<br>800株           |
| ビジョン                                 | 5,400   | 4,790.00 | 25,866,000  | 貸付有価証券<br>2,700株         |
| スマートバリュー                             | 5,100   | 736.00   | 3,753,600   | 貸付有価証券<br>1,700株         |
| U S E N - N E X T H<br>O L D I N G S | 6,600   | 812.00   | 5,359,200   | 貸付有価証券<br>2,900株（500株）   |

|                          |           |           |               |                                 |
|--------------------------|-----------|-----------|---------------|---------------------------------|
| ワイヤレスゲート                 | 8,200     | 719.00    | 5,895,800     | 貸付有価証券<br>5,400株(800株)          |
| コネクシオ                    | 12,300    | 1,359.00  | 16,715,700    | 貸付有価証券<br>1,500株                |
| 日本通信                     | 152,500   | 188.00    | 28,670,000    | 貸付有価証券<br>101,800株(33,200<br>株) |
| ク Robbins                | 3,200     | 601.00    | 1,923,200     | 貸付有価証券<br>600株                  |
| 日本電信電話                   | 1,191,200 | 5,056.00  | 6,022,707,200 |                                 |
| K D D I                  | 1,427,700 | 2,821.50  | 4,028,255,550 |                                 |
| ソフトバンク                   | 1,846,500 | 1,500.00  | 2,769,750,000 | 貸付有価証券<br>343,000株              |
| 光通信                      | 20,500    | 24,630.00 | 504,915,000   |                                 |
| N T T ドコモ                | 1,102,700 | 2,684.00  | 2,959,646,800 | 貸付有価証券<br>139,000株              |
| エムティーアイ                  | 16,800    | 691.00    | 11,608,800    | 貸付有価証券<br>2,100株                |
| G M O インターネット            | 68,600    | 1,858.00  | 127,458,800   | 貸付有価証券<br>8,700株                |
| ファイバーゲート                 | 3,300     | 1,681.00  | 5,547,300     | 貸付有価証券<br>1,900株(600株)          |
| アйдママーケティング<br>コミュニケーション | 3,700     | 531.00    | 1,964,700     |                                 |
| K A D O K A W A          | 50,800    | 1,581.00  | 80,314,800    | 貸付有価証券<br>500株                  |
| 学研ホールディングス               | 5,800     | 5,250.00  | 30,450,000    | 貸付有価証券<br>700株                  |
| ゼンリン                     | 34,700    | 1,789.00  | 62,078,300    |                                 |
| 昭文社                      | 8,000     | 355.00    | 2,840,000     |                                 |
| インプレスホールディン<br>グス        | 14,400    | 141.00    | 2,030,400     | 貸付有価証券<br>2,400株                |
| アイネット                    | 9,800     | 1,347.00  | 13,200,600    | 貸付有価証券<br>600株                  |
| 松竹                       | 11,500    | 12,550.00 | 144,325,000   | 貸付有価証券<br>7,500株                |
| 東宝                       | 114,600   | 4,580.00  | 524,868,000   | 貸付有価証券<br>15,500株               |
| 東映                       | 7,300     | 15,000.00 | 109,500,000   | 貸付有価証券<br>4,000株                |
| エヌ・ティ・ティ・デー<br>タ         | 463,700   | 1,374.00  | 637,123,800   | 貸付有価証券<br>56,700株               |

|                      |           |          |               |                           |
|----------------------|-----------|----------|---------------|---------------------------|
| ピー・シー・エー             | 2,200     | 4,035.00 | 8,877,000     | 貸付有価証券<br>1,200株(900株)    |
| ビジネスブレイン太田昭和         | 3,000     | 2,506.00 | 7,518,000     | 貸付有価証券<br>100株            |
| D T S                | 38,900    | 2,232.00 | 86,824,800    | 貸付有価証券<br>200株            |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 81,000    | 4,135.00 | 334,935,000   | 貸付有価証券<br>9,900株          |
| シーイーシー               | 18,600    | 2,226.00 | 41,403,600    | 貸付有価証券<br>2,200株          |
| カプコン                 | 74,600    | 2,854.00 | 212,908,400   |                           |
| アイ・エス・ビー             | 3,400     | 1,534.00 | 5,215,600     | 貸付有価証券<br>400株            |
| ジャステック               | 11,100    | 1,065.00 | 11,821,500    | 貸付有価証券<br>1,300株          |
| S C S K              | 45,900    | 5,190.00 | 238,221,000   |                           |
| 日本システムウエア            | 5,700     | 2,442.00 | 13,919,400    |                           |
| アイネス                 | 22,100    | 1,083.00 | 23,934,300    |                           |
| T K C                | 14,700    | 4,475.00 | 65,782,500    |                           |
| 富士ソフト                | 22,300    | 4,545.00 | 101,353,500   | 貸付有価証券<br>2,800株          |
| N S D                | 28,600    | 3,150.00 | 90,090,000    | 貸付有価証券<br>7,800株          |
| コナミホールディングス          | 71,200    | 5,030.00 | 358,136,000   | 貸付有価証券<br>8,700株          |
| 福井コンピュータホールディングス     | 5,700     | 2,129.00 | 12,135,300    |                           |
| J B C Cホールディングス      | 13,700    | 1,545.00 | 21,166,500    |                           |
| ミロク情報サービス            | 17,300    | 2,781.00 | 48,111,300    | 貸付有価証券<br>10,900株(6,700株) |
| ソフトバンクグループ           | 1,381,900 | 4,668.00 | 6,450,709,200 |                           |
| ハウスイ                 | 1,400     | 793.00   | 1,110,200     | 貸付有価証券<br>100株            |
| 高千穂交易                | 6,700     | 1,070.00 | 7,169,000     | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| 伊藤忠食品                | 4,300     | 4,175.00 | 17,952,500    | 貸付有価証券<br>500株            |
| エレマテック               | 16,300    | 971.00   | 15,827,300    |                           |
| J A L U X            | 4,900     | 2,261.00 | 11,078,900    | 貸付有価証券<br>2,900株          |

|                         |         |          |             |                  |
|-------------------------|---------|----------|-------------|------------------|
| あらた                     | 12,900  | 3,690.00 | 47,601,000  |                  |
| トーメンデバイス                | 2,600   | 2,294.00 | 5,964,400   | 貸付有価証券<br>1,400株 |
| 東京エレクトロン デバ<br>イス       | 6,300   | 2,014.00 | 12,688,200  |                  |
| フィールズ                   | 15,300  | 486.00   | 7,435,800   | 貸付有価証券<br>1,900株 |
| 双日                      | 965,500 | 336.00   | 324,408,000 | 貸付有価証券<br>800株   |
| アルフレッサ ホール<br>ディングス     | 194,300 | 2,438.00 | 473,703,400 | 貸付有価証券<br>200株   |
| 横浜冷凍                    | 49,000  | 1,027.00 | 50,323,000  | 貸付有価証券<br>300株   |
| 神栄                      | 2,400   | 791.00   | 1,898,400   | 貸付有価証券<br>200株   |
| ラサ商事                    | 9,200   | 808.00   | 7,433,600   | 貸付有価証券<br>800株   |
| ラクーンホールディング<br>ス        | 8,400   | 631.00   | 5,300,400   | 貸付有価証券<br>1,000株 |
| アルコニックス                 | 18,500  | 1,177.00 | 21,774,500  | 貸付有価証券<br>1,000株 |
| 神戸物産                    | 30,200  | 5,220.00 | 157,644,000 | 貸付有価証券<br>9,900株 |
| あい ホールディングス             | 24,900  | 1,750.00 | 43,575,000  | 貸付有価証券<br>3,100株 |
| ディービーエックス               | 6,800   | 758.00   | 5,154,400   | 貸付有価証券<br>900株   |
| ダイワボウホールディン<br>グス       | 15,900  | 4,080.00 | 64,872,000  | 貸付有価証券<br>1,900株 |
| マクニカ・富士エレホー<br>ルディングス   | 48,500  | 1,440.00 | 69,840,000  |                  |
| ラクト・ジャパン                | 6,500   | 3,635.00 | 23,627,500  | 貸付有価証券<br>4,300株 |
| バイタルケーエスケー・<br>ホールディングス | 32,900  | 1,034.00 | 34,018,600  | 貸付有価証券<br>9,000株 |
| 八洲電機                    | 13,500  | 878.00   | 11,853,000  | 貸付有価証券<br>7,400株 |
| メディアスホールディン<br>グス       | 9,900   | 666.00   | 6,593,400   | 貸付有価証券<br>1,600株 |
| レスターホールディン<br>グス        | 19,200  | 1,749.00 | 33,580,800  | 貸付有価証券<br>500株   |
| ジューテックホールディ             | 4,000   | 926.00   | 3,704,000   |                  |

|                  |        |          |             |                        |
|------------------|--------|----------|-------------|------------------------|
| ングス              |        |          |             |                        |
| 大光               | 7,400  | 638.00   | 4,721,200   | 貸付有価証券<br>1,500株       |
| OCHIホールディングス     | 5,100  | 1,139.00 | 5,808,900   |                        |
| TOKAIホールディングス    | 92,400 | 992.00   | 91,660,800  | 貸付有価証券<br>2,300株       |
| 黒谷               | 4,000  | 429.00   | 1,716,000   | 貸付有価証券<br>2,600株       |
| Cominix          | 3,000  | 777.00   | 2,331,000   |                        |
| 三洋貿易             | 8,800  | 2,156.00 | 18,972,800  |                        |
| ビューティガレージ        | 2,800  | 1,875.00 | 5,250,000   | 貸付有価証券<br>400株         |
| ウイン・パートナーズ       | 11,300 | 1,059.00 | 11,966,700  | 貸付有価証券<br>800株         |
| ミタチ産業            | 5,200  | 657.00   | 3,416,400   | 貸付有価証券<br>700株         |
| シップヘルスケアホールディングス | 36,400 | 4,650.00 | 169,260,000 | 貸付有価証券<br>4,400株       |
| 明治電機工業           | 5,500  | 1,316.00 | 7,238,000   |                        |
| デリカフーズホールディングス   | 6,100  | 718.00   | 4,379,800   | 貸付有価証券<br>600株         |
| スターティアホールディングス   | 3,400  | 505.00   | 1,717,000   | 貸付有価証券<br>100株         |
| コメダホールディングス      | 40,600 | 1,961.00 | 79,616,600  | 貸付有価証券<br>7,100株(100株) |
| 富士興産             | 6,700  | 700.00   | 4,690,000   | 貸付有価証券<br>4,400株       |
| 協栄産業             | 2,100  | 1,317.00 | 2,765,700   |                        |
| 小野建              | 15,700 | 1,306.00 | 20,504,200  | 貸付有価証券<br>400株         |
| 南陽               | 3,600  | 1,515.00 | 5,454,000   | 貸付有価証券<br>400株         |
| 佐鳥電機             | 12,900 | 798.00   | 10,294,200  | 貸付有価証券<br>1,700株       |
| エコトレーディング        | 4,000  | 517.00   | 2,068,000   | 貸付有価証券<br>1,200株       |
| 伯東               | 12,000 | 1,118.00 | 13,416,000  | 貸付有価証券<br>1,400株       |
| コンドーテック          | 13,500 | 869.00   | 11,731,500  |                        |
| 中山福              | 10,000 | 492.00   | 4,920,000   |                        |

|                    |         |          |             |                           |
|--------------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| ナガイレーベン            | 25,300  | 2,161.00 | 54,673,300  | 貸付有価証券<br>3,700株          |
| 三菱食品               | 19,200  | 2,551.00 | 48,979,200  | 貸付有価証券<br>2,300株          |
| 松田産業               | 12,700  | 1,418.00 | 18,008,600  |                           |
| 第一興商               | 26,000  | 4,680.00 | 121,680,000 |                           |
| メディバルホールディング<br>グス | 188,600 | 2,304.00 | 434,534,400 |                           |
| S P K              | 3,700   | 2,363.00 | 8,743,100   |                           |
| 萩原電気ホールディング<br>グス  | 6,500   | 2,747.00 | 17,855,500  |                           |
| アズワン               | 12,500  | 8,930.00 | 111,625,000 | 貸付有価証券<br>1,500株          |
| スズデン               | 6,100   | 1,308.00 | 7,978,800   | 貸付有価証券<br>600株（500株）      |
| 尾家産業               | 5,600   | 1,128.00 | 6,316,800   | 貸付有価証券<br>500株            |
| シモジマ               | 10,700  | 1,051.00 | 11,245,700  | 貸付有価証券<br>1,300株          |
| ドウシシャ              | 16,500  | 1,750.00 | 28,875,000  |                           |
| 小津産業               | 3,800   | 1,754.00 | 6,665,200   | 貸付有価証券<br>400株            |
| 高速                 | 10,400  | 1,203.00 | 12,511,200  |                           |
| たけびし               | 6,100   | 1,264.00 | 7,710,400   |                           |
| リックス               | 3,900   | 1,478.00 | 5,764,200   | 貸付有価証券<br>200株            |
| 丸文                 | 15,500  | 545.00   | 8,447,500   |                           |
| ハビネット              | 14,600  | 1,248.00 | 18,220,800  | 貸付有価証券<br>200株            |
| 橋本総業ホールディング<br>グス  | 3,500   | 1,497.00 | 5,239,500   | 貸付有価証券<br>200株            |
| 日本ライフライン           | 51,800  | 1,690.00 | 87,542,000  | 貸付有価証券<br>26,100株（2,200株） |
| タカショー              | 8,500   | 454.00   | 3,859,000   | 貸付有価証券<br>300株            |
| エクセル               | 6,500   | 1,119.00 | 7,273,500   |                           |
| マルカ                | 6,200   | 1,915.00 | 11,873,000  | 貸付有価証券<br>600株            |
| I D O M            | 58,900  | 417.00   | 24,561,300  | 貸付有価証券<br>14,300株（3,900株） |
| 日本エム・ディ・エム         | 10,200  | 1,767.00 | 18,023,400  | 貸付有価証券                    |

|                  |           |          |               |                          |
|------------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
|                  |           |          |               | 900株                     |
| 進和               | 10,300    | 2,037.00 | 20,981,100    | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| エスケイジャパン         | 4,200     | 399.00   | 1,675,800     | 貸付有価証券<br>2,800株(1,200株) |
| ダイトロン            | 7,400     | 1,214.00 | 8,983,600     | 貸付有価証券<br>900株           |
| シークス             | 22,200    | 1,424.00 | 31,612,800    | 貸付有価証券<br>6,000株         |
| 田中商事             | 5,800     | 615.00   | 3,567,000     | 貸付有価証券<br>800株           |
| オーハシテクニカ         | 9,800     | 1,376.00 | 13,484,800    | 貸付有価証券<br>800株           |
| 白銅               | 5,600     | 1,295.00 | 7,252,000     |                          |
| 伊藤忠商事            | 1,222,700 | 2,190.00 | 2,677,713,000 |                          |
| 丸紅               | 1,723,800 | 695.70   | 1,199,247,660 |                          |
| 高島               | 2,800     | 1,526.00 | 4,272,800     |                          |
| 長瀬産業             | 98,300    | 1,450.00 | 142,535,000   | 貸付有価証券<br>12,000株        |
| 蝶理               | 11,200    | 1,645.00 | 18,424,000    | 貸付有価証券<br>200株           |
| 豊田通商             | 195,100   | 3,470.00 | 676,997,000   |                          |
| 三共生興             | 29,800    | 490.00   | 14,602,000    | 貸付有価証券<br>3,800株         |
| 兼松               | 69,800    | 1,215.00 | 84,807,000    | 貸付有価証券<br>200株           |
| ツカモトコーポレーショ<br>ン | 3,100     | 1,022.00 | 3,168,200     |                          |
| 三井物産             | 1,440,200 | 1,719.00 | 2,475,703,800 | 貸付有価証券<br>147,500株       |
| 日本紙パルプ商事         | 9,900     | 3,815.00 | 37,768,500    |                          |
| 日立ハイテクノロジーズ      | 53,100    | 5,860.00 | 311,166,000   |                          |
| カメイ              | 22,800    | 1,022.00 | 23,301,600    | 貸付有価証券<br>700株           |
| 東都水産             | 2,400     | 2,544.00 | 6,105,600     | 貸付有価証券<br>1,400株         |
| OUGホールディングス      | 2,800     | 2,685.00 | 7,518,000     | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| スターゼン            | 6,400     | 4,000.00 | 25,600,000    |                          |
| 山善               | 68,300    | 945.00   | 64,543,500    | 貸付有価証券<br>8,300株         |

|                     |           |          |               |                            |
|---------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| 椿本興業                | 3,900     | 3,275.00 | 12,772,500    |                            |
| 住友商事                | 1,033,900 | 1,655.50 | 1,711,621,450 | 貸付有価証券<br>126,500株         |
| 内田洋行                | 7,500     | 3,660.00 | 27,450,000    | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| 三菱商事                | 1,226,700 | 2,705.00 | 3,318,223,500 |                            |
| 第一実業                | 7,900     | 2,715.00 | 21,448,500    | 貸付有価証券<br>900株             |
| キャノンマーケティング<br>ジャパン | 50,000    | 2,140.00 | 107,000,000   | 貸付有価証券<br>13,000株          |
| 西華産業                | 9,900     | 1,264.00 | 12,513,600    |                            |
| 佐藤商事                | 15,600    | 792.00   | 12,355,200    | 貸付有価証券<br>1,900株           |
| 菱洋エレクトロ             | 17,700    | 1,798.00 | 31,824,600    | 貸付有価証券<br>2,100株           |
| 東京産業                | 17,400    | 467.00   | 8,125,800     |                            |
| ユアサ商事               | 17,900    | 2,957.00 | 52,930,300    | 貸付有価証券<br>2,100株           |
| 神鋼商事                | 3,900     | 2,221.00 | 8,661,900     |                            |
| 小林産業                | 10,400    | 270.00   | 2,808,000     | 貸付有価証券<br>1,700株           |
| 阪和興業                | 30,300    | 2,910.00 | 88,173,000    | 貸付有価証券<br>900株             |
| 正栄食品工業              | 11,300    | 3,020.00 | 34,126,000    | 貸付有価証券<br>7,500株           |
| カナデン                | 15,800    | 1,255.00 | 19,829,000    | 貸付有価証券<br>2,000株           |
| 菱電商事                | 13,800    | 1,605.00 | 22,149,000    |                            |
| フルサト工業              | 9,600     | 1,377.00 | 13,219,200    |                            |
| 岩谷産業                | 38,800    | 3,540.00 | 137,352,000   | 貸付有価証券<br>16,800株（11,900株） |
| すてきナイスグループ          | 7,400     | 627.00   | 4,639,800     | 貸付有価証券<br>4,000株           |
| 昭光通商                | 5,600     | 616.00   | 3,449,600     | 貸付有価証券<br>600株             |
| ニチモウ                | 2,700     | 1,780.00 | 4,806,000     |                            |
| 極東貿易                | 5,400     | 1,669.00 | 9,012,600     |                            |
| イワキ                 | 22,900    | 483.00   | 11,060,700    | 貸付有価証券<br>2,500株           |
| 三愛石油                | 46,900    | 988.00   | 46,337,200    | 貸付有価証券<br>5,700株           |

|                   |        |          |             |                            |
|-------------------|--------|----------|-------------|----------------------------|
| 稲畑産業              | 42,000 | 1,297.00 | 54,474,000  | 貸付有価証券<br>27,900株          |
| G S Iクレオス         | 4,600  | 1,003.00 | 4,613,800   |                            |
| 明和産業              | 16,100 | 569.00   | 9,160,900   | 貸付有価証券<br>10,700株          |
| クワザワ              | 6,200  | 398.00   | 2,467,600   | 貸付有価証券<br>700株             |
| ワキタ               | 37,300 | 1,036.00 | 38,642,800  | 貸付有価証券<br>4,600株           |
| 東邦ホールディングス        | 51,800 | 2,493.00 | 129,137,400 | 貸付有価証券<br>20,600株(12,300株) |
| サンゲツ              | 51,500 | 2,003.00 | 103,154,500 |                            |
| ミツウロコグループホールディングス | 23,200 | 931.00   | 21,599,200  | 貸付有価証券<br>3,100株           |
| シナネンホールディングス      | 7,200  | 1,709.00 | 12,304,800  | 貸付有価証券<br>100株             |
| 伊藤忠エネクス           | 38,600 | 833.00   | 32,153,800  | 貸付有価証券<br>800株             |
| サンリオ              | 54,000 | 2,016.00 | 108,864,000 | 貸付有価証券<br>2,000株           |
| サンワテクノス           | 10,600 | 775.00   | 8,215,000   |                            |
| リョーサン             | 19,300 | 2,690.00 | 51,917,000  |                            |
| 新光商事              | 16,400 | 1,874.00 | 30,733,600  | 貸付有価証券<br>2,500株           |
| トーヨー              | 7,900  | 1,725.00 | 13,627,500  | 貸付有価証券<br>900株             |
| 三信電気              | 12,000 | 1,527.00 | 18,324,000  |                            |
| 東陽テクニカ            | 20,100 | 1,045.00 | 21,004,500  |                            |
| モスフードサービス         | 22,900 | 2,344.00 | 53,677,600  | 貸付有価証券<br>12,500株          |
| 加賀電子              | 17,400 | 1,670.00 | 29,058,000  | 貸付有価証券<br>100株             |
| ソーダニッカ            | 18,000 | 515.00   | 9,270,000   | 貸付有価証券<br>100株             |
| 立花エレテック           | 12,900 | 1,524.00 | 19,659,600  |                            |
| フォーバル             | 7,600  | 928.00   | 7,052,800   | 貸付有価証券<br>900株             |
| P A L T A C       | 31,500 | 5,160.00 | 162,540,000 | 貸付有価証券<br>3,800株           |
| 三谷産業              | 20,400 | 286.00   | 5,834,400   | 貸付有価証券<br>3,400株           |

|                         |         |          |             |                           |
|-------------------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| 太平洋興発                   | 6,900   | 748.00   | 5,161,200   |                           |
| 西本Wismettac<br>ホールディングス | 3,200   | 3,245.00 | 10,384,000  |                           |
| ヤマシタヘルスケアホー<br>ルディングス   | 1,400   | 1,249.00 | 1,748,600   | 貸付有価証券<br>100株            |
| 国際紙パルプ商事                | 40,800  | 299.00   | 12,199,200  | 貸付有価証券<br>7,000株          |
| ヤマタネ                    | 8,800   | 1,294.00 | 11,387,200  |                           |
| 丸紅建材リース                 | 1,700   | 1,669.00 | 2,837,300   |                           |
| 日鉄物産                    | 12,500  | 4,085.00 | 51,062,500  |                           |
| 泉州電業                    | 5,400   | 2,572.00 | 13,888,800  | 貸付有価証券<br>700株            |
| トラスコ中山                  | 36,400  | 2,429.00 | 88,415,600  | 貸付有価証券<br>18,300株（2,300株） |
| オートバックスセブン              | 69,500  | 1,771.00 | 123,084,500 | 貸付有価証券<br>46,200株         |
| モリト                     | 12,700  | 779.00   | 9,893,300   | 貸付有価証券<br>2,500株          |
| 加藤産業                    | 27,300  | 3,115.00 | 85,039,500  | 貸付有価証券<br>3,000株          |
| 北恵                      | 3,300   | 919.00   | 3,032,700   | 貸付有価証券<br>400株            |
| イノテック                   | 10,400  | 874.00   | 9,089,600   | 貸付有価証券<br>1,200株          |
| イエローハット                 | 33,000  | 1,541.00 | 50,853,000  |                           |
| J Kホールディングス             | 15,800  | 492.00   | 7,773,600   | 貸付有価証券<br>1,700株          |
| 日伝                      | 14,500  | 1,950.00 | 28,275,000  | 貸付有価証券<br>7,900株          |
| 北沢産業                    | 13,100  | 261.00   | 3,419,100   | 貸付有価証券<br>1,800株（200株）    |
| 杉本商事                    | 9,400   | 1,879.00 | 17,662,600  |                           |
| 因幡電機産業                  | 24,900  | 4,640.00 | 115,536,000 |                           |
| 東テク                     | 5,800   | 2,014.00 | 11,681,200  |                           |
| ミスミグループ本社               | 218,900 | 2,443.00 | 534,772,700 | 貸付有価証券<br>29,300株         |
| アルテック                   | 13,900  | 202.00   | 2,807,800   | 貸付有価証券<br>2,700株          |
| タキヒヨー                   | 5,300   | 1,749.00 | 9,269,700   | 貸付有価証券<br>900株            |
| 蔵王産業                    | 2,800   | 1,363.00 | 3,816,400   |                           |

|                    |        |          |             |                           |
|--------------------|--------|----------|-------------|---------------------------|
| スズケン               | 79,700 | 5,670.00 | 451,899,000 |                           |
| ジェコス               | 12,000 | 840.00   | 10,080,000  |                           |
| グローセル              | 16,000 | 403.00   | 6,448,000   | 貸付有価証券<br>1,200株          |
| ローソン               | 44,200 | 5,310.00 | 234,702,000 | 貸付有価証券<br>29,500株         |
| サンエー               | 13,200 | 4,510.00 | 59,532,000  | 貸付有価証券<br>2,300株          |
| カワチ薬品              | 13,500 | 1,973.00 | 26,635,500  | 貸付有価証券<br>1,600株          |
| エービーシー・マート         | 27,300 | 6,810.00 | 185,913,000 | 貸付有価証券<br>9,300株          |
| ハードオフコーポレーション      | 6,900  | 705.00   | 4,864,500   |                           |
| アスクル               | 18,300 | 3,035.00 | 55,540,500  | 貸付有価証券<br>7,800株（400株）    |
| ゲオホールディングス         | 26,600 | 1,302.00 | 34,633,200  | 貸付有価証券<br>1,900株          |
| アダストリア             | 24,200 | 2,260.00 | 54,692,000  | 貸付有価証券<br>9,800株          |
| ジーフット              | 10,600 | 614.00   | 6,508,400   | 貸付有価証券<br>1,500株          |
| シー・ヴィ・エス・ベイ<br>エリア | 2,200  | 675.00   | 1,485,000   | 貸付有価証券<br>200株            |
| くら寿司               | 9,100  | 4,185.00 | 38,083,500  | 貸付有価証券<br>6,000株（2,600株）  |
| キャンドウ              | 8,300  | 1,611.00 | 13,371,300  | 貸付有価証券<br>1,700株          |
| パルグループホールディングス     | 8,900  | 3,375.00 | 30,037,500  | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| エディオン              | 74,100 | 1,021.00 | 75,656,100  | 貸付有価証券<br>18,000株（3,000株） |
| サーラコーポレーション        | 35,500 | 590.00   | 20,945,000  | 貸付有価証券<br>4,500株          |
| ワッツ                | 7,700  | 613.00   | 4,720,100   | 貸付有価証券<br>1,600株          |
| ハローズ               | 6,600  | 2,099.00 | 13,853,400  | 貸付有価証券<br>800株            |
| フジオフードシステム         | 7,400  | 2,732.00 | 20,216,800  | 貸付有価証券<br>800株            |
| あみやき亭              | 3,800  | 3,375.00 | 12,825,000  |                           |
| ひらまつ               | 34,800 | 340.00   | 11,832,000  | 貸付有価証券                    |

|                    |         |          |             |                             |
|--------------------|---------|----------|-------------|-----------------------------|
|                    |         |          |             | 4,200株                      |
| 大黒天物産              | 4,200   | 3,205.00 | 13,461,000  | 貸付有価証券<br>500株              |
| ハニーズホールディングス       | 15,400  | 1,421.00 | 21,883,400  | 貸付有価証券<br>1,800株            |
| ファーマライズホールディングス    | 4,100   | 554.00   | 2,271,400   | 貸付有価証券<br>500株              |
| アルペン               | 13,400  | 1,586.00 | 21,252,400  | 貸付有価証券<br>2,000株            |
| ハブ                 | 5,600   | 1,142.00 | 6,395,200   | 貸付有価証券<br>600株              |
| クオールホールディングス       | 25,700  | 1,404.00 | 36,082,800  |                             |
| ジンスホールディングス        | 9,200   | 6,280.00 | 57,776,000  | 貸付有価証券<br>1,100株            |
| ビックカメラ             | 103,700 | 1,020.00 | 105,774,000 | 貸付有価証券<br>61,900株           |
| D C Mホールディングス      | 94,300  | 1,028.00 | 96,940,400  | 貸付有価証券<br>62,900株           |
| ペッパーフードサービス        | 13,900  | 1,588.00 | 22,073,200  | 貸付有価証券<br>9,300株（2,900株）    |
| Monotaro           | 124,300 | 2,594.00 | 322,434,200 | 貸付有価証券<br>61,800株（12,500株）  |
| 東京一番フーズ            | 4,400   | 610.00   | 2,684,000   |                             |
| DDホールディングス         | 7,800   | 1,468.00 | 11,450,400  | 貸付有価証券<br>1,000株（200株）      |
| きちりホールディングス        | 4,700   | 717.00   | 3,369,900   | 貸付有価証券<br>800株              |
| アークランドサービスホールディングス | 12,800  | 1,909.00 | 24,435,200  | 貸付有価証券<br>1,800株            |
| J・フロントリテイリング       | 223,600 | 1,211.00 | 270,779,600 | 貸付有価証券<br>149,300株（15,300株） |
| ドトール・日レスホールディングス   | 30,700  | 2,031.00 | 62,351,700  | 貸付有価証券<br>3,900株            |
| マツモトキヨシホールディングス    | 72,300  | 3,900.00 | 281,970,000 | 貸付有価証券<br>9,300株            |
| ブロンコビリー            | 9,100   | 2,275.00 | 20,702,500  | 貸付有価証券<br>6,000株（400株）      |
| ZOZO               | 188,900 | 2,085.00 | 393,856,500 | 貸付有価証券<br>14,400株           |
| トレジャー・ファクト         | 5,100   | 1,263.00 | 6,441,300   | 貸付有価証券                      |

|                   |         |          |             |                          |
|-------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| リー                |         |          |             | 600株                     |
| 物語コーポレーション        | 4,300   | 9,570.00 | 41,151,000  | 貸付有価証券<br>500株           |
| ココカラファイン          | 19,700  | 5,860.00 | 115,442,000 |                          |
| 三越伊勢丹ホールディングス     | 327,100 | 803.00   | 262,661,300 | 貸付有価証券<br>600株           |
| H a m e e         | 5,300   | 782.00   | 4,144,600   | 貸付有価証券<br>3,500株         |
| ウエルシアホールディングス     | 46,200  | 5,390.00 | 249,018,000 | 貸付有価証券<br>30,800株        |
| クリエイティブSDホールディングス | 25,800  | 2,342.00 | 60,423,600  | 貸付有価証券<br>3,100株         |
| 丸善CHIホールディングス     | 20,400  | 372.00   | 7,588,800   | 貸付有価証券<br>2,600株         |
| ミサワ               | 3,100   | 441.00   | 1,367,100   | 貸付有価証券<br>1,300株(1,000株) |
| ティーライフ            | 2,300   | 833.00   | 1,915,900   | 貸付有価証券<br>900株           |
| エー・ピーカンパニー        | 3,300   | 525.00   | 1,732,500   | 貸付有価証券<br>1,700株         |
| チムニー              | 5,300   | 2,395.00 | 12,693,500  | 貸付有価証券<br>3,600株         |
| シュッピン             | 11,900  | 953.00   | 11,340,700  | 貸付有価証券<br>2,200株         |
| ネクステージ            | 24,900  | 1,104.00 | 27,489,600  | 貸付有価証券<br>3,200株         |
| ジョイフル本田           | 51,200  | 1,315.00 | 67,328,000  | 貸付有価証券<br>7,900株         |
| 鳥貴族               | 5,800   | 2,139.00 | 12,406,200  | 貸付有価証券<br>3,800株(600株)   |
| キリン堂ホールディングス      | 6,900   | 1,806.00 | 12,461,400  | 貸付有価証券<br>800株           |
| ホットランド            | 10,200  | 1,175.00 | 11,985,000  | 貸付有価証券<br>6,800株(200株)   |
| すかいらーくホールディングス    | 195,900 | 1,836.00 | 359,672,400 | 貸付有価証券<br>130,700株       |
| SFPホールディングス       | 7,500   | 2,063.00 | 15,472,500  | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| 綿半ホールディングス        | 6,500   | 2,183.00 | 14,189,500  | 貸付有価証券<br>4,100株         |
| ヨシックス             | 2,800   | 3,185.00 | 8,918,000   | 貸付有価証券<br>500株           |

|                      |         |           |               |                             |
|----------------------|---------|-----------|---------------|-----------------------------|
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 50,800  | 935.00    | 47,498,000    | 貸付有価証券<br>7,100株            |
| ゴルフダイジェスト・オンライン      | 8,100   | 677.00    | 5,483,700     | 貸付有価証券<br>900株              |
| B E E N O S          | 6,100   | 1,231.00  | 7,509,100     | 貸付有価証券<br>3,300株            |
| あさひ                  | 14,500  | 1,206.00  | 17,487,000    | 貸付有価証券<br>3,600株（1,800株）    |
| 日本調剤                 | 6,200   | 3,715.00  | 23,033,000    |                             |
| コスモス薬品               | 7,700   | 21,420.00 | 164,934,000   | 貸付有価証券<br>5,100株            |
| トーエル                 | 8,400   | 680.00    | 5,712,000     | 貸付有価証券<br>1,000株            |
| オンリー                 | 3,000   | 780.00    | 2,340,000     | 貸付有価証券<br>400株              |
| セブン & アイ・ホールディングス    | 732,700 | 3,855.00  | 2,824,558,500 | 貸付有価証券<br>477,600株（92,200株） |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング | 47,000  | 1,616.00  | 75,952,000    | 貸付有価証券<br>13,600株           |
| ツルハホールディングス          | 38,000  | 11,560.00 | 439,280,000   | 貸付有価証券<br>15,400株（700株）     |
| サンマルクホールディングス        | 13,800  | 2,420.00  | 33,396,000    |                             |
| フェリシモ                | 3,900   | 999.00    | 3,896,100     | 貸付有価証券<br>500株              |
| トリドールホールディングス        | 21,600  | 2,463.00  | 53,200,800    | 貸付有価証券<br>11,200株           |
| T O K Y O B A S E    | 15,700  | 890.00    | 13,973,000    | 貸付有価証券<br>5,300株（2,900株）    |
| ウイルプラスホールディングス       | 2,700   | 810.00    | 2,187,000     | 貸付有価証券<br>100株              |
| ジャパンミート              | 8,800   | 2,059.00  | 18,119,200    | 貸付有価証券<br>1,000株            |
| サッドラホールディングス         | 2,600   | 1,733.00  | 4,505,800     | 貸付有価証券<br>500株              |
| デファクトスタンダード          | 1,500   | 308.00    | 462,000       | 貸付有価証券<br>300株              |
| アレンザホールディングス         | 9,400   | 783.00    | 7,360,200     | 貸付有価証券<br>1,800株            |
| 串カツ田中ホールディングス        | 2,700   | 2,054.00  | 5,545,800     | 貸付有価証券<br>1,800株            |

|                  |         |          |             |                           |
|------------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| パロックジャパンリミテッド    | 14,100  | 1,021.00 | 14,396,100  | 貸付有価証券<br>1,700株          |
| クスのアオキホールディングス   | 17,400  | 8,100.00 | 140,940,000 | 貸付有価証券<br>10,000株         |
| 力の源ホールディングス      | 6,600   | 860.00   | 5,676,000   | 貸付有価証券<br>4,300株          |
| スシログローバルホールディングス | 19,200  | 6,990.00 | 134,208,000 | 貸付有価証券<br>12,300株         |
| L I X I L ビバ     | 14,800  | 1,407.00 | 20,823,600  |                           |
| メディカルシステムネットワーク  | 18,600  | 504.00   | 9,374,400   | 貸付有価証券<br>9,500株          |
| はるやまホールディングス     | 8,200   | 783.00   | 6,420,600   | 貸付有価証券<br>1,100株          |
| ノジマ              | 31,100  | 1,745.00 | 54,269,500  | 貸付有価証券<br>400株            |
| カップ・クリエイト        | 24,500  | 1,383.00 | 33,883,500  | 貸付有価証券<br>16,300株（500株）   |
| ライトオン            | 13,100  | 640.00   | 8,384,000   | 貸付有価証券<br>8,700株          |
| ジーンズメイト          | 5,300   | 312.00   | 1,653,600   | 貸付有価証券<br>2,300株（1,100株）  |
| 良品計画             | 247,600 | 1,954.00 | 483,810,400 | 貸付有価証券<br>81,700株（5,000株） |
| 三城ホールディングス       | 21,600  | 303.00   | 6,544,800   | 貸付有価証券<br>300株（200株）      |
| アドヴァン            | 26,700  | 1,139.00 | 30,411,300  | 貸付有価証券<br>3,200株          |
| アルビス             | 6,600   | 2,378.00 | 15,694,800  | 貸付有価証券<br>3,600株          |
| コナカ              | 20,600  | 425.00   | 8,755,000   | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| ハウス オブ ローゼ       | 2,100   | 1,580.00 | 3,318,000   | 貸付有価証券<br>200株            |
| G - 7ホールディングス    | 5,100   | 3,170.00 | 16,167,000  |                           |
| イオン北海道           | 17,600  | 730.00   | 12,848,000  | 貸付有価証券<br>2,500株          |
| コジマ              | 30,100  | 449.00   | 13,514,900  | 貸付有価証券<br>13,500株         |
| ヒマラヤ             | 6,100   | 786.00   | 4,794,600   | 貸付有価証券<br>800株            |
| コーナン商事           | 22,900  | 2,323.00 | 53,196,700  | 貸付有価証券<br>2,800株          |

|                          |         |          |             |                           |
|--------------------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| エコス                      | 6,400   | 1,543.00 | 9,875,200   | 貸付有価証券<br>700株            |
| ワタミ                      | 23,000  | 1,426.00 | 32,798,000  | 貸付有価証券<br>12,600株         |
| マルシェ                     | 4,600   | 776.00   | 3,569,600   | 貸付有価証券<br>2,500株          |
| パン・パシフィック・イ<br>ンターナショナルホ | 418,800 | 1,655.00 | 693,114,000 | 貸付有価証券<br>86,800株         |
| 西松屋チェーン                  | 38,300  | 895.00   | 34,278,500  | 貸付有価証券<br>5,000株          |
| ゼンショーホールディン<br>グス        | 85,000  | 2,369.00 | 201,365,000 | 貸付有価証券<br>56,700株(300株)   |
| 幸楽苑ホールディングス              | 11,100  | 2,446.00 | 27,150,600  | 貸付有価証券<br>1,800株          |
| ハークスレイ                   | 3,600   | 1,010.00 | 3,636,000   |                           |
| サイゼリヤ                    | 28,800  | 2,646.00 | 76,204,800  | 貸付有価証券<br>3,900株(400株)    |
| V Tホールディングス              | 78,900  | 447.00   | 35,268,300  | 貸付有価証券<br>200株            |
| 魚力                       | 4,800   | 1,544.00 | 7,411,200   | 貸付有価証券<br>2,700株          |
| ポブラ                      | 4,500   | 479.00   | 2,155,500   | 貸付有価証券<br>3,000株          |
| フジ・コーポレーション              | 4,600   | 2,160.00 | 9,936,000   | 貸付有価証券<br>500株            |
| ユナイテッドアローズ               | 20,000  | 3,320.00 | 66,400,000  | 貸付有価証券<br>2,800株          |
| ハイデイ日高                   | 25,200  | 2,097.00 | 52,844,400  | 貸付有価証券<br>3,400株          |
| 京都きもの友禅                  | 11,100  | 339.00   | 3,762,900   | 貸付有価証券<br>5,400株          |
| コロワイド                    | 58,100  | 2,072.00 | 120,383,200 | 貸付有価証券<br>38,900株(4,500株) |
| ピーシーデポコーポレー<br>ション       | 23,200  | 483.00   | 11,205,600  | 貸付有価証券<br>100株            |
| 壱番屋                      | 12,300  | 5,090.00 | 62,607,000  | 貸付有価証券<br>3,800株          |
| トップカルチャー                 | 6,300   | 335.00   | 2,110,500   | 貸付有価証券<br>4,200株(2,200株)  |
| P L A N T                | 4,500   | 691.00   | 3,109,500   | 貸付有価証券<br>2,400株          |
| スギホールディングス               | 38,400  | 5,580.00 | 214,272,000 | 貸付有価証券                    |

|               |         |          |             |                            |
|---------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
|               |         |          |             | 10,500株                    |
| 薬王堂ホールディングス   | 7,600   | 2,419.00 | 18,384,400  | 貸付有価証券<br>300株             |
| ヴィア・ホールディングス  | 21,400  | 658.00   | 14,081,200  | 貸付有価証券<br>3,700株(900株)     |
| スクロール         | 26,900  | 327.00   | 8,796,300   | 貸付有価証券<br>3,300株           |
| ヨンドシーホールディングス | 19,400  | 2,567.00 | 49,799,800  | 貸付有価証券<br>11,400株          |
| ファミリーマート      | 195,500 | 2,538.00 | 496,179,000 | 貸付有価証券<br>98,100株(11,500株) |
| 木曽路           | 21,400  | 2,604.00 | 55,725,600  | 貸付有価証券<br>11,700株          |
| S R Sホールディングス | 20,600  | 1,030.00 | 21,218,000  | 貸付有価証券<br>11,200株(300株)    |
| 千趣会           | 31,600  | 301.00   | 9,511,600   | 貸付有価証券<br>21,000株          |
| タカキュー         | 13,500  | 172.00   | 2,322,000   | 貸付有価証券<br>4,000株(300株)     |
| ケーヨー          | 32,300  | 472.00   | 15,245,600  | 貸付有価証券<br>7,200株(100株)     |
| 上新電機          | 20,600  | 1,957.00 | 40,314,200  | 貸付有価証券<br>2,500株           |
| 日本瓦斯          | 27,600  | 3,105.00 | 85,698,000  |                            |
| ロイヤルホールディングス  | 30,500  | 2,579.00 | 78,659,500  | 貸付有価証券<br>20,200株          |
| 東天紅           | 1,300   | 1,209.00 | 1,571,700   | 貸付有価証券<br>100株             |
| いなげや          | 19,500  | 1,524.00 | 29,718,000  | 貸付有価証券<br>12,900株          |
| 島忠            | 36,900  | 2,557.00 | 94,353,300  | 貸付有価証券<br>24,600株          |
| チヨダ           | 18,300  | 1,535.00 | 28,090,500  | 貸付有価証券<br>2,200株           |
| ライフコーポレーション   | 13,300  | 2,062.00 | 27,424,600  | 貸付有価証券<br>1,600株           |
| リンガーハット       | 21,500  | 2,484.00 | 53,406,000  | 貸付有価証券<br>3,100株           |
| Mr Max HD     | 24,000  | 435.00   | 10,440,000  | 貸付有価証券<br>3,800株           |
| テンアライド        | 16,100  | 439.00   | 7,067,900   | 貸付有価証券<br>10,700株          |

|                     |         |          |               |                                  |
|---------------------|---------|----------|---------------|----------------------------------|
| AOKIホールディングス        | 35,000  | 1,042.00 | 36,470,000    | 貸付有価証券<br>100株                   |
| オークワ                | 24,900  | 1,138.00 | 28,336,200    | 貸付有価証券<br>7,100株                 |
| コメリ                 | 27,000  | 2,153.00 | 58,131,000    | 貸付有価証券<br>500株                   |
| 青山商事                | 30,500  | 1,860.00 | 56,730,000    |                                  |
| しまむら                | 20,300  | 8,200.00 | 166,460,000   | 貸付有価証券<br>6,300株（200株）           |
| はせがわ                | 9,200   | 402.00   | 3,698,400     | 貸付有価証券<br>400株（400株）             |
| 高島屋                 | 137,100 | 1,179.00 | 161,640,900   | 貸付有価証券<br>29,700株（2,900株）        |
| 松屋                  | 35,200  | 767.00   | 26,998,400    | 貸付有価証券<br>5,100株                 |
| エイチ・ツー・オー<br>リテイリング | 89,700  | 1,128.00 | 101,181,600   |                                  |
| 近鉄百貨店               | 6,700   | 2,993.00 | 20,053,100    | 貸付有価証券<br>900株                   |
| パルコ                 | 16,800  | 1,258.00 | 21,134,400    | 貸付有価証券<br>6,200株                 |
| 丸井グループ              | 147,900 | 2,115.00 | 312,808,500   | 貸付有価証券<br>18,100株                |
| アクシアル<br>リテイリング     | 14,500  | 3,840.00 | 55,680,000    | 貸付有価証券<br>1,700株                 |
| 井筒屋                 | 8,900   | 219.00   | 1,949,100     | 貸付有価証券<br>1,100株                 |
| イオン                 | 672,700 | 1,888.50 | 1,270,393,950 | 貸付有価証券<br>449,100株（115,500<br>株） |
| イズミ                 | 35,500  | 4,000.00 | 142,000,000   | 貸付有価証券<br>7,100株                 |
| 平和堂                 | 35,500  | 1,978.00 | 70,219,000    | 貸付有価証券<br>4,300株                 |
| フジ                  | 21,100  | 1,821.00 | 38,423,100    | 貸付有価証券<br>2,500株                 |
| ヤオコー                | 19,800  | 4,675.00 | 92,565,000    | 貸付有価証券<br>4,300株                 |
| ゼビオホールディングス         | 21,100  | 1,126.00 | 23,758,600    | 貸付有価証券<br>2,500株                 |
| ケーズホールディングス         | 181,600 | 1,123.00 | 203,936,800   | 貸付有価証券<br>600株                   |

|                   |         |           |               |                           |
|-------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| Olympicグループ       | 10,300  | 605.00    | 6,231,500     | 貸付有価証券<br>3,900株（2,500株）  |
| 日産東京販売ホールディングス    | 25,700  | 277.00    | 7,118,900     | 貸付有価証券<br>3,300株（100株）    |
| Genky Drug Stores | 8,500   | 2,053.00  | 17,450,500    | 貸付有価証券<br>4,200株（100株）    |
| 総合メディカルホールディングス   | 15,200  | 1,477.00  | 22,450,400    |                           |
| ブックオフグループホールディングス | 9,100   | 1,160.00  | 10,556,000    | 貸付有価証券<br>4,900株          |
| アインホールディングス       | 23,400  | 5,760.00  | 134,784,000   | 貸付有価証券<br>4,300株          |
| 元気寿司              | 4,900   | 2,746.00  | 13,455,400    | 貸付有価証券<br>3,200株          |
| ヤマダ電機             | 532,600 | 489.00    | 260,441,400   | 貸付有価証券<br>355,400株        |
| アークランドサカモト        | 29,600  | 1,228.00  | 36,348,800    | 貸付有価証券<br>3,600株          |
| ニトリホールディングス       | 75,700  | 15,075.00 | 1,141,177,500 | 貸付有価証券<br>50,500株         |
| グルメ杵屋             | 12,500  | 1,170.00  | 14,625,000    | 貸付有価証券<br>8,300株          |
| 愛眼                | 13,900  | 242.00    | 3,363,800     | 貸付有価証券<br>2,800株          |
| ケーユーホールディングス      | 9,100   | 810.00    | 7,371,000     | 貸付有価証券<br>1,100株          |
| 吉野家ホールディングス       | 61,000  | 2,301.00  | 140,361,000   | 貸付有価証券<br>22,300株（1,000株） |
| 松屋フーズホールディングス     | 8,400   | 3,825.00  | 32,130,000    | 貸付有価証券<br>1,200株          |
| サガミホールディングス       | 23,400  | 1,345.00  | 31,473,000    | 貸付有価証券<br>15,600株         |
| 関西スーパーマーケット       | 13,200  | 1,102.00  | 14,546,400    | 貸付有価証券<br>1,600株          |
| 王将フードサービス         | 12,800  | 7,180.00  | 91,904,000    | 貸付有価証券<br>1,500株          |
| プレナス              | 19,600  | 1,720.00  | 33,712,000    | 貸付有価証券<br>6,100株          |
| ミニストップ            | 12,900  | 1,360.00  | 17,544,000    | 貸付有価証券<br>6,200株          |
| アークス              | 32,800  | 2,150.00  | 70,520,000    | 貸付有価証券<br>4,000株          |

|                     |           |           |               |                         |
|---------------------|-----------|-----------|---------------|-------------------------|
| パローホールディングス         | 37,700    | 1,774.00  | 66,879,800    |                         |
| 藤久                  | 1,400     | 718.00    | 1,005,200     | 貸付有価証券<br>900株          |
| ベルク                 | 8,600     | 5,030.00  | 43,258,000    | 貸付有価証券<br>1,000株        |
| 大庄                  | 9,300     | 1,555.00  | 14,461,500    | 貸付有価証券<br>4,400株        |
| ファーストリテイリング         | 23,400    | 65,150.00 | 1,524,510,000 | 貸付有価証券<br>6,200株（300株）  |
| サンドラッグ              | 65,800    | 3,245.00  | 213,521,000   |                         |
| サックスパーホールディングス      | 14,800    | 883.00    | 13,068,400    |                         |
| ヤマザワ                | 3,600     | 1,623.00  | 5,842,800     | 貸付有価証券<br>400株          |
| やまや                 | 3,000     | 2,297.00  | 6,891,000     | 貸付有価証券<br>1,700株        |
| ペルーナ                | 42,900    | 700.00    | 30,030,000    | 貸付有価証券<br>23,400株（100株） |
| 島根銀行                | 3,700     | 702.00    | 2,597,400     | 貸付有価証券<br>1,200株        |
| じもとホールディングス         | 118,300   | 92.00     | 10,883,600    | 貸付有価証券<br>2,000株（400株）  |
| めぶきフィナンシャルグループ      | 909,600   | 241.00    | 219,213,600   | 貸付有価証券<br>1,100株        |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ   | 23,600    | 1,283.00  | 30,278,800    | 貸付有価証券<br>2,900株        |
| 九州フィナンシャルグループ       | 287,300   | 406.00    | 116,643,800   | 貸付有価証券<br>40,000株       |
| ゆうちょ銀行              | 495,900   | 997.00    | 494,412,300   | 貸付有価証券<br>106,400株      |
| 富山第一銀行              | 41,700    | 268.00    | 11,175,600    | 貸付有価証券<br>5,400株（100株）  |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 1,098,200 | 379.00    | 416,217,800   | 貸付有価証券<br>100株          |
| 西日本フィナンシャルホールディングス  | 110,200   | 651.00    | 71,740,200    |                         |
| 関西みらいフィナンシャルグループ    | 82,200    | 672.00    | 55,238,400    | 貸付有価証券<br>11,200株       |
| 三十三フィナンシャルグループ      | 15,100    | 1,483.00  | 22,393,300    |                         |
| 第四北越フィナンシャルグループ     | 30,400    | 2,470.00  | 75,088,000    |                         |

|                   |            |          |               |                         |
|-------------------|------------|----------|---------------|-------------------------|
| 新生銀行              | 128,500    | 1,437.00 | 184,654,500   | 貸付有価証券<br>82,000株（900株） |
| あおぞら銀行            | 97,800     | 2,481.00 | 242,641,800   | 貸付有価証券<br>12,400株       |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 12,050,400 | 519.80   | 6,263,797,920 | 貸付有価証券<br>5,400株        |
| りそなホールディングス       | 1,921,000  | 423.30   | 813,159,300   | 貸付有価証券<br>15,700株       |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 344,200    | 3,556.00 | 1,223,975,200 | 貸付有価証券<br>42,100株       |
| 三井住友フィナンシャルグループ   | 1,233,700  | 3,526.00 | 4,350,026,200 | 貸付有価証券<br>150,900株      |
| 千葉銀行              | 602,100    | 538.00   | 323,929,800   | 貸付有価証券<br>400株          |
| 群馬銀行              | 350,200    | 342.00   | 119,768,400   |                         |
| 武蔵野銀行             | 26,100     | 1,757.00 | 45,857,700    | 貸付有価証券<br>3,100株        |
| 千葉興業銀行            | 48,000     | 292.00   | 14,016,000    | 貸付有価証券<br>2,000株        |
| 筑波銀行              | 72,800     | 153.00   | 11,138,400    | 貸付有価証券<br>9,800株        |
| 七十七銀行             | 54,900     | 1,379.00 | 75,707,100    |                         |
| 青森銀行              | 13,600     | 2,451.00 | 33,333,600    | 貸付有価証券<br>1,600株        |
| 秋田銀行              | 11,200     | 1,858.00 | 20,809,600    |                         |
| 山形銀行              | 19,700     | 1,387.00 | 27,323,900    | 貸付有価証券<br>2,400株        |
| 岩手銀行              | 12,200     | 2,288.00 | 27,913,600    |                         |
| 東邦銀行              | 156,500    | 235.00   | 36,777,500    | 貸付有価証券<br>19,500株       |
| 東北銀行              | 8,900      | 936.00   | 8,330,400     |                         |
| みちのく銀行            | 11,200     | 1,548.00 | 17,337,600    | 貸付有価証券<br>1,300株        |
| ふくおかフィナンシャルグループ   | 154,200    | 1,842.00 | 284,036,400   | 貸付有価証券<br>100株          |
| 静岡銀行              | 433,500    | 732.00   | 317,322,000   | 貸付有価証券<br>500株          |
| 十六銀行              | 23,500     | 2,137.00 | 50,219,500    | 貸付有価証券<br>1,700株        |
| スルガ銀行             | 179,100    | 407.00   | 72,893,700    | 貸付有価証券<br>102,100株      |

|                     |         |          |             |                   |
|---------------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 八十二銀行               | 422,500 | 397.00   | 167,732,500 | 貸付有価証券<br>51,500株 |
| 山梨中央銀行              | 21,100  | 951.00   | 20,066,100  |                   |
| 大垣共立銀行              | 36,900  | 2,208.00 | 81,475,200  | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 福井銀行                | 15,000  | 1,235.00 | 18,525,000  | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 北國銀行                | 18,000  | 2,348.00 | 42,264,000  |                   |
| 清水銀行                | 7,200   | 1,807.00 | 13,010,400  |                   |
| 富山銀行                | 3,400   | 2,167.00 | 7,367,800   | 貸付有価証券<br>400株    |
| 滋賀銀行                | 35,100  | 2,290.00 | 80,379,000  | 貸付有価証券<br>12,200株 |
| 南都銀行                | 27,300  | 2,247.00 | 61,343,100  |                   |
| 百五銀行                | 157,500 | 317.00   | 49,927,500  | 貸付有価証券<br>800株    |
| 京都銀行                | 62,700  | 3,885.00 | 243,589,500 |                   |
| 紀陽銀行                | 62,000  | 1,464.00 | 90,768,000  | 貸付有価証券<br>8,300株  |
| ほくほくフィナンシャル<br>グループ | 116,500 | 950.00   | 110,675,000 | 貸付有価証券<br>14,200株 |
| 広島銀行                | 258,400 | 481.00   | 124,290,400 | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| 山陰合同銀行              | 103,800 | 590.00   | 61,242,000  | 貸付有価証券<br>100株    |
| 中国銀行                | 150,600 | 878.00   | 132,226,800 | 貸付有価証券<br>20,000株 |
| 鳥取銀行                | 6,000   | 1,369.00 | 8,214,000   | 貸付有価証券<br>100株    |
| 伊予銀行                | 231,900 | 497.00   | 115,254,300 | 貸付有価証券<br>300株    |
| 百十四銀行               | 18,600  | 1,943.00 | 36,139,800  |                   |
| 四国銀行                | 24,800  | 900.00   | 22,320,000  | 貸付有価証券<br>3,000株  |
| 阿波銀行                | 26,800  | 2,202.00 | 59,013,600  | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| 大分銀行                | 10,700  | 2,828.00 | 30,259,600  | 貸付有価証券<br>700株    |
| 宮崎銀行                | 11,700  | 2,261.00 | 26,453,700  | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| 佐賀銀行                | 10,600  | 1,379.00 | 14,617,400  |                   |

|                |            |          |               |                      |
|----------------|------------|----------|---------------|----------------------|
| 沖縄銀行           | 16,000     | 3,035.00 | 48,560,000    | 貸付有価証券<br>1,900株     |
| 琉球銀行           | 40,400     | 1,027.00 | 41,490,800    | 貸付有価証券<br>100株       |
| セブン銀行          | 591,500    | 278.00   | 164,437,000   | 貸付有価証券<br>73,700株    |
| みずほフィナンシャルグループ | 23,786,900 | 158.40   | 3,767,844,960 | 貸付有価証券<br>2,910,700株 |
| 高知銀行           | 6,400      | 740.00   | 4,736,000     |                      |
| 山口フィナンシャルグループ  | 218,500    | 679.00   | 148,361,500   | 貸付有価証券<br>200株       |
| 長野銀行           | 5,700      | 1,554.00 | 8,857,800     | 貸付有価証券<br>3,800株     |
| 名古屋銀行          | 14,200     | 2,945.00 | 41,819,000    | 貸付有価証券<br>1,900株     |
| 北洋銀行           | 263,900    | 211.00   | 55,682,900    | 貸付有価証券<br>8,300株     |
| 愛知銀行           | 6,300      | 3,280.00 | 20,664,000    | 貸付有価証券<br>100株       |
| 中京銀行           | 7,200      | 2,106.00 | 15,163,200    |                      |
| 大光銀行           | 6,000      | 1,583.00 | 9,498,000     | 貸付有価証券<br>600株       |
| 愛媛銀行           | 24,400     | 1,074.00 | 26,205,600    | 貸付有価証券<br>2,700株     |
| トマト銀行          | 6,800      | 1,013.00 | 6,888,400     | 貸付有価証券<br>100株       |
| 京葉銀行           | 74,600     | 594.00   | 44,312,400    |                      |
| 栃木銀行           | 90,600     | 164.00   | 14,858,400    | 貸付有価証券<br>900株       |
| 北日本銀行          | 5,500      | 1,637.00 | 9,003,500     | 貸付有価証券<br>200株       |
| 東和銀行           | 30,700     | 686.00   | 21,060,200    | 貸付有価証券<br>2,400株     |
| 福島銀行           | 15,200     | 226.00   | 3,435,200     | 貸付有価証券<br>2,800株     |
| 大東銀行           | 8,400      | 549.00   | 4,611,600     |                      |
| トモニホールディングス    | 135,300    | 316.00   | 42,754,800    | 貸付有価証券<br>700株       |
| フィデアホールディングス   | 169,900    | 111.00   | 18,858,900    |                      |
| 池田泉州ホールディングス   | 185,800    | 178.00   | 33,072,400    | 貸付有価証券<br>24,200株    |

|                          |           |          |               |                            |
|--------------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| F P G                    | 55,000    | 1,084.00 | 59,620,000    | 貸付有価証券<br>9,200株           |
| マーキュリアインベスト<br>メント       | 7,700     | 729.00   | 5,613,300     | 貸付有価証券<br>900株             |
| S B Iホールディングス            | 208,600   | 2,257.00 | 470,810,200   | 貸付有価証券<br>11,000株          |
| 日本アジア投資                  | 14,800    | 226.00   | 3,344,800     | 貸付有価証券<br>5,600株(1,100株)   |
| ジャフコ                     | 28,700    | 3,860.00 | 110,782,000   | 貸付有価証券<br>3,500株           |
| 大和証券グループ本社               | 1,404,600 | 474.40   | 666,342,240   | 貸付有価証券<br>12,100株          |
| 野村ホールディングス               | 3,080,200 | 442.60   | 1,363,296,520 |                            |
| 岡三証券グループ                 | 149,200   | 349.00   | 52,070,800    | 貸付有価証券<br>20,900株          |
| 丸三証券                     | 52,000    | 485.00   | 25,220,000    | 貸付有価証券<br>34,600株(2,600株)  |
| 東洋証券                     | 62,600    | 146.00   | 9,139,600     | 貸付有価証券<br>14,800株(300株)    |
| 東海東京フィナンシャル・<br>ホールディングス | 208,700   | 290.00   | 60,523,000    | 貸付有価証券<br>13,000株          |
| 光世証券                     | 4,200     | 559.00   | 2,347,800     | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| 水戸証券                     | 50,600    | 192.00   | 9,715,200     | 貸付有価証券<br>400株(300株)       |
| いちよし証券                   | 35,100    | 631.00   | 22,148,100    |                            |
| 松井証券                     | 85,700    | 887.00   | 76,015,900    | 貸付有価証券<br>20,400株          |
| だいこう証券ビジネス               | 7,100     | 530.00   | 3,763,000     | 貸付有価証券<br>900株             |
| マネックスグループ                | 161,400   | 314.00   | 50,679,600    | 貸付有価証券<br>83,600株(31,800株) |
| 極東証券                     | 23,500    | 805.00   | 18,917,500    |                            |
| 岩井コスモホールディン<br>グス        | 17,900    | 1,072.00 | 19,188,800    |                            |
| 藍澤證券                     | 31,400    | 676.00   | 21,226,400    | 貸付有価証券<br>3,800株           |
| マネーパートナーズグ<br>ループ        | 20,500    | 263.00   | 5,391,500     | 貸付有価証券<br>8,500株           |
| スパークス・グループ               | 69,300    | 240.00   | 16,632,000    | 貸付有価証券<br>8,500株           |
| 小林洋行                     | 5,000     | 243.00   | 1,215,000     | 貸付有価証券                     |

|                          |         |          |               |                           |
|--------------------------|---------|----------|---------------|---------------------------|
|                          |         |          |               | 100株                      |
| かんぽ生命保険                  | 62,000  | 1,535.00 | 95,170,000    | 貸付有価証券<br>200株            |
| S O M P Oホールディングス        | 308,600 | 4,401.00 | 1,358,148,600 | 貸付有価証券<br>37,700株         |
| アニコムホールディングス             | 14,400  | 3,830.00 | 55,152,000    | 貸付有価証券<br>9,500株(2,000株)  |
| M S & A Dインシュアランスグループホール | 457,700 | 3,420.00 | 1,565,334,000 |                           |
| ソニーフィナンシャルホールディングス       | 143,900 | 2,318.00 | 333,560,200   | 貸付有価証券<br>25,500株         |
| 第一生命ホールディングス             | 990,500 | 1,500.00 | 1,485,750,000 | 貸付有価証券<br>600株            |
| 東京海上ホールディングス             | 626,000 | 5,567.00 | 3,484,942,000 | 貸付有価証券<br>79,500株         |
| T & Dホールディングス            | 541,400 | 1,073.00 | 580,922,200   | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| アドバンスクリエイト               | 4,100   | 1,806.00 | 7,404,600     | 貸付有価証券<br>2,200株          |
| 全国保証                     | 49,300  | 3,975.00 | 195,967,500   | 貸付有価証券<br>5,300株(700株)    |
| ジェイリース                   | 4,800   | 306.00   | 1,468,800     |                           |
| イントラスト                   | 4,900   | 669.00   | 3,278,100     | 貸付有価証券<br>1,500株          |
| 日本モーゲージサービス              | 3,100   | 1,064.00 | 3,298,400     | 貸付有価証券<br>500株            |
| C a s a                  | 7,900   | 1,219.00 | 9,630,100     | 貸付有価証券<br>900株            |
| アルヒ                      | 15,900  | 2,115.00 | 33,628,500    | 貸付有価証券<br>10,600株(6,800株) |
| プレミアグループ                 | 10,000  | 1,842.00 | 18,420,000    | 貸付有価証券<br>1,500株          |
| クレディセゾン                  | 122,600 | 1,193.00 | 146,261,800   | 貸付有価証券<br>600株(300株)      |
| 芙蓉総合リース                  | 20,000  | 6,140.00 | 122,800,000   |                           |
| 興銀リース                    | 32,900  | 2,750.00 | 90,475,000    | 貸付有価証券<br>4,000株          |
| 東京センチュリー                 | 35,300  | 4,370.00 | 154,261,000   |                           |
| 日本証券金融                   | 77,100  | 494.00   | 38,087,400    | 貸付有価証券<br>100株            |
| アイフル                     | 267,000 | 222.00   | 59,274,000    | 貸付有価証券<br>156,200株        |

|                      |           |          |               |                                 |
|----------------------|-----------|----------|---------------|---------------------------------|
| リコーリース               | 13,800    | 3,315.00 | 45,747,000    | 貸付有価証券<br>1,600株                |
| イオンフィナンシャル<br>サービス   | 111,800   | 1,578.00 | 176,420,400   | 貸付有価証券<br>19,000株               |
| アコム                  | 351,800   | 378.00   | 132,980,400   | 貸付有価証券<br>43,300株               |
| ジャックス                | 19,300    | 2,178.00 | 42,035,400    |                                 |
| オリエントコーポレー<br>ション    | 473,500   | 138.00   | 65,343,000    | 貸付有価証券<br>62,900株               |
| 日立キャピタル              | 41,300    | 2,134.00 | 88,134,200    | 貸付有価証券<br>500株                  |
| アプラスフィナンシャル          | 84,000    | 69.00    | 5,796,000     | 貸付有価証券<br>24,400株               |
| オリックス                | 1,167,900 | 1,608.00 | 1,877,983,200 |                                 |
| 三菱UFJリース             | 394,900   | 587.00   | 231,806,300   | 貸付有価証券<br>600株                  |
| 九州リースサービス            | 8,600     | 585.00   | 5,031,000     | 貸付有価証券<br>1,000株                |
| 日本取引所グループ            | 472,900   | 1,745.00 | 825,210,500   |                                 |
| イー・ギャランティ            | 16,400    | 1,306.00 | 21,418,400    |                                 |
| アサックス                | 7,300     | 589.00   | 4,299,700     | 貸付有価証券<br>800株                  |
| NECキャピタルソ<br>リューション  | 7,100     | 2,092.00 | 14,853,200    | 貸付有価証券<br>800株                  |
| いちご                  | 222,700   | 442.00   | 98,433,400    | 貸付有価証券<br>31,900株               |
| 日本駐車場開発              | 192,000   | 170.00   | 32,640,000    | 貸付有価証券<br>34,900株               |
| スター・マイカ・ホール<br>ディングス | 9,000     | 1,874.00 | 16,866,000    | 貸付有価証券<br>1,100株                |
| ヒューリック               | 373,821   | 1,045.00 | 390,642,945   | 貸付有価証券<br>249,500株（19,200<br>株） |
| 三栄建築設計               | 7,000     | 1,430.00 | 10,010,000    | 貸付有価証券<br>800株                  |
| 野村不動産ホールディ<br>ングス    | 116,700   | 2,293.00 | 267,593,100   | 貸付有価証券<br>600株                  |
| 三重交通グループホール<br>ディングス | 35,500    | 525.00   | 18,637,500    | 貸付有価証券<br>23,700株               |
| サムティ                 | 24,800    | 1,837.00 | 45,557,600    | 貸付有価証券<br>5,400株                |
| ディア・ライフ              | 22,400    | 516.00   | 11,558,400    | 貸付有価証券                          |

|                |         |          |             |                            |
|----------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
|                |         |          |             | 2,900株                     |
| コーセーアールイー      | 5,100   | 684.00   | 3,488,400   | 貸付有価証券<br>200株             |
| エー・ディー・ワークス    | 539,200 | 34.00    | 18,332,800  | 貸付有価証券<br>263,000株(300株)   |
| 日本商業開発         | 10,900  | 1,470.00 | 16,023,000  |                            |
| プレサンスコーポレーション  | 27,800  | 1,575.00 | 43,785,000  |                            |
| ユニゾホールディングス    | 26,400  | 4,310.00 | 113,784,000 | 貸付有価証券<br>15,500株(1,800株)  |
| THEグローバル社      | 8,900   | 421.00   | 3,746,900   | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| 日本管理センター       | 11,500  | 1,360.00 | 15,640,000  | 貸付有価証券<br>1,400株           |
| サンセイランディック     | 5,100   | 795.00   | 4,054,500   | 貸付有価証券<br>700株             |
| エストラスト         | 2,400   | 721.00   | 1,730,400   | 貸付有価証券<br>300株             |
| フージャースホールディングス | 38,100  | 614.00   | 23,393,400  | 貸付有価証券<br>24,500株(15,900株) |
| オープンハウス        | 25,400  | 5,170.00 | 131,318,000 | 貸付有価証券<br>16,900株          |
| 東急不動産ホールディングス  | 470,800 | 661.00   | 311,198,800 | 貸付有価証券<br>57,600株          |
| 飯田グループホールディングス | 146,000 | 1,670.00 | 243,820,000 | 貸付有価証券<br>18,800株          |
| イーグランド         | 2,500   | 684.00   | 1,710,000   |                            |
| ムゲンエステート       | 12,100  | 604.00   | 7,308,400   | 貸付有価証券<br>1,900株           |
| ピーロット          | 4,100   | 1,514.00 | 6,207,400   |                            |
| ファーストブラザーズ     | 4,000   | 1,048.00 | 4,192,000   | 貸付有価証券<br>2,600株           |
| ハウズドゥ          | 9,600   | 1,577.00 | 15,139,200  | 貸付有価証券<br>6,400株(200株)     |
| シーアールイー        | 4,300   | 1,041.00 | 4,476,300   | 貸付有価証券<br>500株             |
| プロパティエージェント    | 2,300   | 1,189.00 | 2,734,700   | 貸付有価証券<br>400株(400株)       |
| ケイアイスター不動産     | 4,700   | 1,935.00 | 9,094,500   | 貸付有価証券<br>2,500株(1,900株)   |
| アグレ都市デザイン      | 2,800   | 421.00   | 1,178,800   | 貸付有価証券<br>600株             |

|                      |           |          |               |                                 |
|----------------------|-----------|----------|---------------|---------------------------------|
| グッドコムアセット            | 4,000     | 1,635.00 | 6,540,000     | 貸付有価証券<br>2,500株(300株)          |
| ジェイ・エス・ピー            | 1,800     | 4,120.00 | 7,416,000     | 貸付有価証券<br>200株                  |
| テンポイノベーション           | 1,900     | 1,554.00 | 2,952,600     |                                 |
| グローバル・リンク・マ<br>ネジメント | 2,900     | 583.00   | 1,690,700     | 貸付有価証券<br>300株                  |
| パーク24                | 93,900    | 2,257.00 | 211,932,300   | 貸付有価証券<br>50,100株(6,800株)       |
| パラカ                  | 4,500     | 2,077.00 | 9,346,500     | 貸付有価証券<br>2,500株                |
| 三井不動産                | 928,700   | 2,575.00 | 2,391,402,500 | 貸付有価証券<br>113,600株              |
| 三菱地所                 | 1,226,400 | 2,029.50 | 2,488,978,800 | 貸付有価証券<br>150,000株              |
| 平和不動産                | 32,100    | 2,521.00 | 80,924,100    |                                 |
| 東京建物                 | 191,300   | 1,463.00 | 279,871,900   | 貸付有価証券<br>124,000株(21,900<br>株) |
| ダイビル                 | 51,500    | 1,038.00 | 53,457,000    |                                 |
| 京阪神ビルディング            | 30,600    | 1,214.00 | 37,148,400    | 貸付有価証券<br>3,800株                |
| 住友不動産                | 393,500   | 3,913.00 | 1,539,765,500 |                                 |
| テオーシー                | 40,100    | 806.00   | 32,320,600    | 貸付有価証券<br>100株                  |
| 東京楽天地                | 2,500     | 5,450.00 | 13,625,000    | 貸付有価証券<br>300株                  |
| レオパレス21              | 215,900   | 304.00   | 65,633,600    | 貸付有価証券<br>144,100株(50,700<br>株) |
| スターツコーポレーショ<br>ン     | 23,800    | 2,402.00 | 57,167,600    | 貸付有価証券<br>2,900株                |
| フジ住宅                 | 22,300    | 678.00   | 15,119,400    | 貸付有価証券<br>2,700株                |
| 空港施設                 | 20,400    | 527.00   | 10,750,800    |                                 |
| 明和地所                 | 9,600     | 531.00   | 5,097,600     | 貸付有価証券<br>1,200株                |
| ゴールドクレスト             | 13,800    | 2,044.00 | 28,207,200    | 貸付有価証券<br>2,600株                |
| 日本エスリード              | 6,800     | 1,586.00 | 10,784,800    |                                 |
| 日神不動産                | 25,900    | 441.00   | 11,421,900    | 貸付有価証券<br>100株                  |

|                 |         |          |             |                            |
|-----------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 日本エスコン          | 31,700  | 750.00   | 23,775,000  | 貸付有価証券<br>18,800株（13,800株） |
| タカラレーベン         | 80,000  | 400.00   | 32,000,000  |                            |
| サンヨーハウジング名古屋    | 9,800   | 846.00   | 8,290,800   | 貸付有価証券<br>1,300株           |
| イオンモール          | 87,800  | 1,699.00 | 149,172,200 | 貸付有価証券<br>41,900株          |
| 毎日コムネット         | 3,700   | 722.00   | 2,671,400   | 貸付有価証券<br>200株             |
| ファースト住建         | 7,500   | 1,239.00 | 9,292,500   | 貸付有価証券<br>900株             |
| カチタス            | 19,500  | 4,215.00 | 82,192,500  | 貸付有価証券<br>2,900株           |
| トーセイ            | 24,100  | 1,279.00 | 30,823,900  | 貸付有価証券<br>3,000株           |
| 穴吹興産            | 1,900   | 2,777.00 | 5,276,300   | 貸付有価証券<br>200株             |
| サンフロンティア不動産     | 24,200  | 1,223.00 | 29,596,600  | 貸付有価証券<br>300株             |
| エフ・ジェー・ネクスト     | 15,300  | 1,005.00 | 15,376,500  |                            |
| インテリックス         | 4,900   | 715.00   | 3,503,500   | 貸付有価証券<br>800株             |
| ランドビジネス         | 7,400   | 765.00   | 5,661,000   |                            |
| 日本社宅サービス        | 4,400   | 971.00   | 4,272,400   | 貸付有価証券<br>200株             |
| グランディハウス        | 15,300  | 446.00   | 6,823,800   | 貸付有価証券<br>1,800株           |
| 日本空港ビルデング       | 55,900  | 4,225.00 | 236,177,500 | 貸付有価証券<br>37,300株          |
| 日本工営            | 11,400  | 2,768.00 | 31,555,200  | 貸付有価証券<br>1,600株           |
| L I F U L L     | 59,200  | 653.00   | 38,657,600  | 貸付有価証券<br>3,100株           |
| ジェイエイシーリクルートメント | 11,400  | 1,917.00 | 21,853,800  | 貸付有価証券<br>1,300株           |
| 日本M&Aセンター       | 128,000 | 3,090.00 | 395,520,000 | 貸付有価証券<br>5,100株           |
| メンバーズ           | 5,700   | 1,845.00 | 10,516,500  | 貸付有価証券<br>3,800株           |
| 中広              | 1,700   | 602.00   | 1,023,400   |                            |
| アイティメディア        | 3,400   | 645.00   | 2,193,000   | 貸付有価証券<br>1,600株           |

|               |         |          |             |                           |
|---------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| タケエイ          | 17,600  | 944.00   | 16,614,400  | 貸付有価証券<br>400株            |
| E・Jホールディングス   | 2,100   | 1,214.00 | 2,549,400   |                           |
| トラスト・テック      | 18,700  | 1,224.00 | 22,888,800  | 貸付有価証券<br>2,200株          |
| コシダカホールディングス  | 40,800  | 1,672.00 | 68,217,600  | 貸付有価証券<br>5,900株          |
| アルトナー         | 4,100   | 699.00   | 2,865,900   |                           |
| パソナグループ       | 20,700  | 1,481.00 | 30,656,700  | 貸付有価証券<br>3,100株          |
| CDS           | 4,200   | 1,274.00 | 5,350,800   | 貸付有価証券<br>700株            |
| リンクアンドモチベーション | 37,400  | 607.00   | 22,701,800  | 貸付有価証券<br>24,900株(100株)   |
| GCA           | 20,000  | 705.00   | 14,100,000  | 貸付有価証券<br>2,400株          |
| エス・エム・エス      | 62,300  | 2,593.00 | 161,543,900 | 貸付有価証券<br>7,700株          |
| サニーサイドアップ     | 3,800   | 972.00   | 3,693,600   |                           |
| パーソルホールディングス  | 169,600 | 2,115.00 | 358,704,000 |                           |
| リニカル          | 9,500   | 1,013.00 | 9,623,500   | 貸付有価証券<br>1,800株          |
| クックパッド        | 59,200  | 289.00   | 17,108,800  | 貸付有価証券<br>17,700株(1,000株) |
| エスクリ          | 4,600   | 835.00   | 3,841,000   |                           |
| アイ・ケイ・ケイ      | 8,300   | 690.00   | 5,727,000   | 貸付有価証券<br>1,200株(200株)    |
| 学情            | 6,000   | 1,192.00 | 7,152,000   | 貸付有価証券<br>2,800株          |
| スタジオアリス       | 8,500   | 1,892.00 | 16,082,000  | 貸付有価証券<br>1,200株          |
| シミックホールディングス  | 9,400   | 1,661.00 | 15,613,400  |                           |
| NJS           | 3,700   | 1,554.00 | 5,749,800   | 貸付有価証券<br>400株            |
| 総合警備保障        | 67,500  | 5,340.00 | 360,450,000 | 貸付有価証券<br>8,200株          |
| カカクコム         | 127,000 | 2,524.00 | 320,548,000 | 貸付有価証券<br>17,600株         |
| セントケア・ホールディング | 12,300  | 500.00   | 6,150,000   | 貸付有価証券<br>6,800株          |

|                      |         |          |             |                                 |
|----------------------|---------|----------|-------------|---------------------------------|
| サイネックス               | 2,900   | 620.00   | 1,798,000   |                                 |
| ルネサンス                | 9,400   | 1,578.00 | 14,833,200  | 貸付有価証券<br>5,100株                |
| ディップ                 | 27,300  | 2,509.00 | 68,495,700  | 貸付有価証券<br>15,900株(2,800株)       |
| オプトホールディング           | 9,200   | 1,532.00 | 14,094,400  | 貸付有価証券<br>4,500株                |
| 新日本科学                | 22,900  | 686.00   | 15,709,400  | 貸付有価証券<br>8,000株                |
| ツクイ                  | 39,900  | 431.00   | 17,196,900  | 貸付有価証券<br>200株                  |
| キャリアデザインセン<br>ター     | 4,300   | 1,294.00 | 5,564,200   |                                 |
| ベネフィット・ワン            | 47,000  | 1,830.00 | 86,010,000  | 貸付有価証券<br>100株                  |
| エムスリー                | 357,000 | 2,415.00 | 862,155,000 | 貸付有価証券<br>173,700株(13,100<br>株) |
| ツカダ・グローバルホー<br>ルディング | 10,800  | 572.00   | 6,177,600   | 貸付有価証券<br>1,500株                |
| プラス                  | 1,900   | 613.00   | 1,164,700   | 貸付有価証券<br>200株                  |
| アウトソーシング             | 96,900  | 986.00   | 95,543,400  | 貸付有価証券<br>15,400株               |
| ウェルネット               | 16,000  | 707.00   | 11,312,000  | 貸付有価証券<br>2,700株                |
| ワールドホールディング<br>ス     | 5,600   | 1,530.00 | 8,568,000   | 貸付有価証券<br>600株                  |
| ディー・エヌ・エー            | 91,400  | 2,059.00 | 188,192,600 | 貸付有価証券<br>12,200株               |
| 博報堂DYホールディン<br>グス    | 235,800 | 1,561.00 | 368,083,800 | 貸付有価証券<br>28,900株               |
| ぐるなび                 | 24,100  | 688.00   | 16,580,800  | 貸付有価証券<br>1,400株                |
| タカミヤ                 | 17,900  | 648.00   | 11,599,200  | 貸付有価証券<br>9,100株                |
| ジャパンベストレス<br>キューシステム | 11,500  | 1,139.00 | 13,098,500  | 貸付有価証券<br>6,200株                |
| ファンコミュニケーション<br>ズ    | 46,600  | 538.00   | 25,070,800  | 貸付有価証券<br>5,800株                |
| ライク                  | 6,700   | 1,877.00 | 12,575,900  | 貸付有価証券<br>1,600株                |

|                  |         |          |             |                             |
|------------------|---------|----------|-------------|-----------------------------|
| ビジネス・ブレイクスルー     | 7,100   | 361.00   | 2,563,100   | 貸付有価証券<br>1,000株            |
| エスプール            | 6,500   | 3,035.00 | 19,727,500  |                             |
| WDBホールディングス      | 7,700   | 2,467.00 | 18,995,900  | 貸付有価証券<br>900株              |
| ティア              | 9,900   | 617.00   | 6,108,300   | 貸付有価証券<br>300株              |
| CDG              | 1,500   | 1,420.00 | 2,130,000   | 貸付有価証券<br>500株              |
| バリューコマース         | 9,500   | 1,726.00 | 16,397,000  | 貸付有価証券<br>1,200株            |
| インフォーマート         | 92,900  | 1,611.00 | 149,661,900 | 貸付有価証券<br>45,900株           |
| J Pホールディングス      | 48,400  | 273.00   | 13,213,200  | 貸付有価証券<br>300株              |
| EPSホールディングス      | 25,500  | 1,296.00 | 33,048,000  |                             |
| レッグス             | 4,200   | 1,732.00 | 7,274,400   | 貸付有価証券<br>2,800株            |
| プレステージ・インターナショナル | 31,700  | 1,856.00 | 58,835,200  | 貸付有価証券<br>4,300株（500株）      |
| アミューズ            | 10,300  | 2,622.00 | 27,006,600  |                             |
| ドリームインキュベータ      | 5,100   | 1,269.00 | 6,471,900   | 貸付有価証券<br>600株              |
| クイック             | 10,500  | 1,279.00 | 13,429,500  |                             |
| TAC              | 9,200   | 194.00   | 1,784,800   | 貸付有価証券<br>1,100株            |
| ケネディクス           | 161,400 | 532.00   | 85,864,800  | 貸付有価証券<br>49,800株（8,800株）   |
| 電通               | 174,800 | 3,650.00 | 638,020,000 | 貸付有価証券<br>116,300株（18,600株） |
| テイクアンドグヴィ・ニーズ    | 6,500   | 1,123.00 | 7,299,500   | 貸付有価証券<br>700株              |
| ぴあ               | 4,800   | 4,165.00 | 19,992,000  | 貸付有価証券<br>1,600株            |
| イオンファンタジー        | 5,400   | 2,715.00 | 14,661,000  | 貸付有価証券<br>600株              |
| シーティーエス          | 19,100  | 721.00   | 13,771,100  | 貸付有価証券<br>8,700株            |
| ネクシィーズグループ       | 5,900   | 1,843.00 | 10,873,700  | 貸付有価証券<br>300株              |
| みらかホールディングス      | 47,400  | 2,380.00 | 112,812,000 |                             |

|                |         |           |               |                          |
|----------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| アルプス技研         | 15,000  | 1,507.00  | 22,605,000    | 貸付有価証券<br>2,200株         |
| ダイオーズ          | 3,900   | 1,433.00  | 5,588,700     | 貸付有価証券<br>2,200株（100株）   |
| 日本空調サービス       | 19,200  | 696.00    | 13,363,200    | 貸付有価証券<br>2,300株         |
| オリエンタルランド      | 200,400 | 15,970.00 | 3,200,388,000 | 貸付有価証券<br>24,800株        |
| ダスキン           | 43,600  | 2,758.00  | 120,248,800   | 貸付有価証券<br>5,500株         |
| 明光ネットワークジャパン   | 19,900  | 892.00    | 17,750,800    | 貸付有価証券<br>3,000株         |
| ファルコホールディングス   | 9,300   | 1,600.00  | 14,880,000    | 貸付有価証券<br>5,100株（200株）   |
| 秀英予備校          | 3,700   | 437.00    | 1,616,900     |                          |
| 田谷             | 3,100   | 605.00    | 1,875,500     | 貸付有価証券<br>2,000株         |
| ラウンドワン         | 52,600  | 1,601.00  | 84,212,600    |                          |
| リゾートトラスト       | 71,800  | 1,640.00  | 117,752,000   | 貸付有価証券<br>100株           |
| ビー・エム・エル       | 21,800  | 2,947.00  | 64,244,600    |                          |
| ワタベウェディング      | 2,700   | 558.00    | 1,506,600     | 貸付有価証券<br>500株           |
| りらいあコミュニケーションズ | 30,600  | 1,330.00  | 40,698,000    | 貸付有価証券<br>3,700株         |
| リソー教育          | 86,100  | 460.00    | 39,606,000    | 貸付有価証券<br>10,500株        |
| 早稲田アカデミー       | 4,800   | 799.00    | 3,835,200     | 貸付有価証券<br>2,700株         |
| ユー・エス・エス       | 207,100 | 2,009.00  | 416,063,900   | 貸付有価証券<br>25,300株        |
| 東京個別指導学院       | 6,000   | 947.00    | 5,682,000     | 貸付有価証券<br>2,000株         |
| サイバーエージェント     | 97,500  | 4,400.00  | 429,000,000   | 貸付有価証券<br>14,700株        |
| 楽天             | 790,500 | 984.00    | 777,852,000   | 貸付有価証券<br>403,700株       |
| クリーク・アンド・リパー社  | 10,000  | 1,139.00  | 11,390,000    | 貸付有価証券<br>4,100株（1,500株） |
| テー・オー・ダブリュー    | 14,800  | 723.00    | 10,700,400    | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| 山田コンサルティンググループ | 8,200   | 1,636.00  | 13,415,200    | 貸付有価証券                   |

|                    |        |          |             |                          |
|--------------------|--------|----------|-------------|--------------------------|
| ループ                |        |          |             | 1,900株                   |
| セントラルスポーツ          | 6,300  | 3,035.00 | 19,120,500  | 貸付有価証券<br>3,500株         |
| フルキャストホールディングス     | 17,000 | 1,973.00 | 33,541,000  | 貸付有価証券<br>2,000株         |
| エン・ジャパン            | 24,700 | 3,825.00 | 94,477,500  | 貸付有価証券<br>5,100株(2,100株) |
| リソルホールディングス        | 1,800  | 3,945.00 | 7,101,000   |                          |
| テクノプロ・ホールディングス     | 34,000 | 6,140.00 | 208,760,000 | 貸付有価証券<br>4,200株         |
| アトラ                | 3,900  | 493.00   | 1,922,700   | 貸付有価証券<br>2,600株         |
| インターワークス           | 3,200  | 555.00   | 1,776,000   |                          |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 6,900  | 3,705.00 | 25,564,500  | 貸付有価証券<br>300株           |
| KeepPer 技研         | 6,200  | 1,368.00 | 8,481,600   | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| ファーストロジック          | 3,900  | 637.00   | 2,484,300   | 貸付有価証券<br>600株           |
| 三機サービス             | 3,500  | 903.00   | 3,160,500   | 貸付有価証券<br>1,600株         |
| Gunosy             | 11,800 | 1,381.00 | 16,295,800  | 貸付有価証券<br>3,900株(400株)   |
| デザインワン・ジャパン        | 3,300  | 279.00   | 920,700     | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| イー・ガーディアン          | 8,600  | 1,710.00 | 14,706,000  | 貸付有価証券<br>3,900株         |
| リブセンス              | 10,900 | 256.00   | 2,790,400   | 貸付有価証券<br>6,900株         |
| ジャパンマテリアル          | 46,400 | 1,203.00 | 55,819,200  | 貸付有価証券<br>5,600株         |
| ベクトル               | 21,100 | 975.00   | 20,572,500  | 貸付有価証券<br>2,800株         |
| ウチヤマホールディングス       | 8,300  | 494.00   | 4,100,200   |                          |
| チャーム・ケア・コーポレーション   | 5,400  | 1,942.00 | 10,486,800  | 貸付有価証券<br>200株           |
| ライクキッズネクスト         | 4,000  | 920.00   | 3,680,000   | 貸付有価証券<br>500株           |
| キャリアリンク            | 6,200  | 566.00   | 3,509,200   | 貸付有価証券<br>3,000株         |
| I B J              | 11,400 | 1,100.00 | 12,540,000  | 貸付有価証券                   |

|                       |           |          |               |                                 |
|-----------------------|-----------|----------|---------------|---------------------------------|
|                       |           |          |               | 3,000株                          |
| アサンテ                  | 6,800     | 1,961.00 | 13,334,800    |                                 |
| N・フィールド               | 11,600    | 617.00   | 7,157,200     | 貸付有価証券<br>1,700株                |
| バリューHR                | 3,300     | 2,839.00 | 9,368,700     | 貸付有価証券<br>600株                  |
| M&Aキャピタルパートナーズ        | 6,000     | 6,410.00 | 38,460,000    | 貸付有価証券<br>1,200株                |
| ライドオンエクスプレスホールディングス   | 7,000     | 1,530.00 | 10,710,000    | 貸付有価証券<br>2,900株                |
| E R Iホールディングス         | 4,700     | 779.00   | 3,661,300     | 貸付有価証券<br>500株                  |
| アビスト                  | 2,600     | 2,585.00 | 6,721,000     |                                 |
| シグマクシス                | 8,100     | 1,228.00 | 9,946,800     | 貸付有価証券<br>200株                  |
| ウィルグループ               | 11,000    | 836.00   | 9,196,000     | 貸付有価証券<br>400株                  |
| エスクロー・エージェン<br>ト・ジャパン | 23,300    | 221.00   | 5,149,300     | 貸付有価証券<br>7,000株(800株)          |
| リクルートホールディング<br>ス     | 1,214,900 | 3,255.00 | 3,954,499,500 | 貸付有価証券<br>105,200株(27,200<br>株) |
| エラン                   | 10,000    | 1,770.00 | 17,700,000    | 貸付有価証券<br>1,400株(200株)          |
| 土木管理総合試験所             | 7,400     | 417.00   | 3,085,800     | 貸付有価証券<br>800株                  |
| ネットマーケティング            | 6,100     | 702.00   | 4,282,200     | 貸付有価証券<br>700株                  |
| 日本郵政                  | 1,390,100 | 966.00   | 1,342,836,600 |                                 |
| ベルシステム24ホール<br>ディングス  | 28,400    | 1,609.00 | 45,695,600    | 貸付有価証券<br>3,400株                |
| 鎌倉新書                  | 12,500    | 1,682.00 | 21,025,000    | 貸付有価証券<br>7,300株(100株)          |
| ソネット・メディア・<br>ネットワークス | 2,100     | 609.00   | 1,278,900     | 貸付有価証券<br>1,400株(1,000株)        |
| 一蔵                    | 1,800     | 581.00   | 1,045,800     |                                 |
| LITALICO              | 3,900     | 1,909.00 | 7,445,100     | 貸付有価証券<br>1,200株                |
| グローバルキッズCOM<br>PANY   | 2,500     | 857.00   | 2,142,500     | 貸付有価証券<br>600株                  |
| エボラブルアジア              | 7,500     | 1,995.00 | 14,962,500    | 貸付有価証券<br>2,100株(200株)          |

|                             |        |          |            |                          |
|-----------------------------|--------|----------|------------|--------------------------|
| アトラエ                        | 4,400  | 2,613.00 | 11,497,200 | 貸付有価証券<br>2,300株         |
| ストライク                       | 6,400  | 2,677.00 | 17,132,800 | 貸付有価証券<br>1,600株(400株)   |
| ソラスト                        | 41,500 | 1,292.00 | 53,618,000 | 貸付有価証券<br>500株           |
| セラク                         | 5,300  | 719.00   | 3,810,700  | 貸付有価証券<br>400株(400株)     |
| インソース                       | 8,250  | 2,398.00 | 19,783,500 | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| ベイカレント・コンサル<br>ティング         | 12,000 | 4,460.00 | 53,520,000 |                          |
| Orchestra H<br>oldings      | 3,300  | 1,131.00 | 3,732,300  | 貸付有価証券<br>1,000株(100株)   |
| アイモバイル                      | 5,300  | 727.00   | 3,853,100  | 貸付有価証券<br>3,300株(2,400株) |
| キャリアインデックス                  | 5,800  | 453.00   | 2,627,400  | 貸付有価証券<br>3,100株         |
| MS - J a p a n              | 6,900  | 1,373.00 | 9,473,700  | 貸付有価証券<br>1,100株(100株)   |
| 船場                          | 2,700  | 890.00   | 2,403,000  |                          |
| グレイステクノロジー                  | 6,100  | 2,931.00 | 17,879,100 | 貸付有価証券<br>3,300株(300株)   |
| ジャパンエレベーター<br>サービスホールディン    | 13,300 | 2,633.00 | 35,018,900 | 貸付有価証券<br>3,100株         |
| フルテック                       | 2,400  | 1,222.00 | 2,932,800  |                          |
| グリーンズ                       | 6,400  | 1,350.00 | 8,640,000  |                          |
| ツナググループ・ホール<br>ディングス        | 2,000  | 584.00   | 1,168,000  | 貸付有価証券<br>200株           |
| ソウルドアウト                     | 2,600  | 1,393.00 | 3,621,800  | 貸付有価証券<br>900株(100株)     |
| MS & C o n s u l t i<br>n g | 2,500  | 908.00   | 2,270,000  |                          |
| 日総工産                        | 11,200 | 1,037.00 | 11,614,400 | 貸付有価証券<br>2,400株         |
| キュービーネットホール<br>ディングス        | 10,300 | 2,171.00 | 22,361,300 | 貸付有価証券<br>100株           |
| R P Aホールディングス               | 7,200  | 1,653.00 | 11,901,600 | 貸付有価証券<br>4,000株         |
| スプリックス                      | 5,700  | 1,466.00 | 8,356,200  | 貸付有価証券<br>3,500株(2,200株) |
| アドバンテッジリスクマ                 | 6,600  | 794.00   | 5,240,400  | 貸付有価証券                   |

|              |        |          |             |                           |
|--------------|--------|----------|-------------|---------------------------|
| ネジメント        |        |          |             | 2,100株                    |
| リログループ       | 92,700 | 2,597.00 | 240,741,900 | 貸付有価証券<br>5,300株          |
| 東祥           | 10,600 | 2,249.00 | 23,839,400  | 貸付有価証券<br>200株            |
| エイチ・アイ・エス    | 26,400 | 2,634.00 | 69,537,600  | 貸付有価証券<br>17,600株（2,000株） |
| ラックランド       | 3,400  | 2,257.00 | 7,673,800   | 貸付有価証券<br>500株            |
| 共立メンテナンス     | 25,900 | 4,215.00 | 109,168,500 | 貸付有価証券<br>4,300株          |
| イチネンホールディングス | 17,600 | 1,059.00 | 18,638,400  |                           |
| 建設技術研究所      | 11,700 | 1,578.00 | 18,462,600  | 貸付有価証券<br>1,400株          |
| スペース         | 11,000 | 1,188.00 | 13,068,000  | 貸付有価証券<br>1,300株          |
| 長大           | 6,200  | 904.00   | 5,604,800   |                           |
| 燦ホールディングス    | 3,700  | 2,082.00 | 7,703,400   |                           |
| スバル興業        | 1,200  | 6,540.00 | 7,848,000   | 貸付有価証券<br>100株            |
| 東京テアトル       | 6,600  | 1,364.00 | 9,002,400   | 貸付有価証券<br>4,000株（100株）    |
| タナベ経営        | 3,300  | 1,252.00 | 4,131,600   |                           |
| ナガワ          | 4,700  | 5,090.00 | 23,923,000  | 貸付有価証券<br>700株            |
| よみうりランド      | 3,700  | 4,460.00 | 16,502,000  | 貸付有価証券<br>2,000株（100株）    |
| 東京都競馬        | 11,100 | 3,140.00 | 34,854,000  | 貸付有価証券<br>1,300株          |
| 常磐興産         | 6,800  | 1,676.00 | 11,396,800  | 貸付有価証券<br>2,000株          |
| カナモト         | 27,800 | 2,651.00 | 73,697,800  | 貸付有価証券<br>4,100株（700株）    |
| 東京ドーム        | 63,400 | 986.00   | 62,512,400  | 貸付有価証券<br>34,700株（3,200株） |
| 西尾レントオール     | 17,200 | 2,763.00 | 47,523,600  |                           |
| トランス・コスモス    | 18,800 | 2,517.00 | 47,319,600  | 貸付有価証券<br>2,300株          |
| 乃村工藝社        | 79,300 | 1,337.00 | 106,024,100 | 貸付有価証券<br>10,500株         |
| 藤田観光         | 7,400  | 2,683.00 | 19,854,200  | 貸付有価証券                    |

|                  |              |          |                 |                   |
|------------------|--------------|----------|-----------------|-------------------|
|                  |              |          |                 | 2,000株            |
| KNT - CTホールディングス | 9,000        | 1,419.00 | 12,771,000      | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 日本管財             | 18,200       | 1,857.00 | 33,797,400      | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| トーカイ             | 16,400       | 2,291.00 | 37,572,400      |                   |
| 白洋舎              | 1,900        | 2,791.00 | 5,302,900       | 貸付有価証券<br>200株    |
| セコム              | 180,000      | 9,172.00 | 1,650,960,000   | 貸付有価証券<br>22,000株 |
| セントラル警備保障        | 8,200        | 5,200.00 | 42,640,000      | 貸付有価証券<br>1,700株  |
| 丹青社              | 32,000       | 1,257.00 | 40,224,000      | 貸付有価証券<br>4,000株  |
| メイテック            | 21,000       | 5,300.00 | 111,300,000     |                   |
| 応用地質             | 18,200       | 1,048.00 | 19,073,600      | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| 船井総研ホールディングス     | 35,000       | 2,331.00 | 81,585,000      | 貸付有価証券<br>4,200株  |
| 進学会ホールディングス      | 7,700        | 444.00   | 3,418,800       |                   |
| オオバ              | 13,300       | 599.00   | 7,966,700       | 貸付有価証券<br>1,600株  |
| いであ              | 3,100        | 1,103.00 | 3,419,300       | 貸付有価証券<br>500株    |
| 学究社              | 5,600        | 1,215.00 | 6,804,000       |                   |
| ベネッセホールディングス     | 62,100       | 2,708.00 | 168,166,800     | 貸付有価証券<br>8,100株  |
| イオンディライト         | 20,900       | 3,255.00 | 68,029,500      | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| ナック              | 10,700       | 939.00   | 10,047,300      |                   |
| ニチイ学館            | 24,100       | 1,621.00 | 39,066,100      | 貸付有価証券<br>2,900株  |
| ダイセキ             | 28,400       | 2,621.00 | 74,436,400      | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| ステップ             | 6,200        | 1,396.00 | 8,655,200       | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| 小計               | 銘柄数：2,131    |          | 390,459,905,575 |                   |
|                  | 組入時価比率：97.8% |          | 100.0%          |                   |
| 合計               |              |          | 390,459,905,575 |                   |

(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(2019年9月6日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類       | 2019年 9月 6日現在 |       |               |             |
|----------|---------------|-------|---------------|-------------|
|          | 契約額等(円)       |       | 時価(円)         | 評価損益(円)     |
|          |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引     |               |       |               |             |
| 株価指数先物取引 |               |       |               |             |
| 買建       | 8,700,255,125 | -     | 8,827,645,000 | 127,109,453 |
| 合計       | 8,700,255,125 | -     | 8,827,645,000 | 127,109,453 |

(注)時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2019年 9月 6日現在)

|             |                |
|-------------|----------------|
| <b>資産の部</b> |                |
| 流動資産        |                |
| 預金          | 1,053,645,346  |
| コール・ローン     | 1,026,839,238  |
| 株式          | 47,131,347,695 |
| 投資証券        | 1,378,975,131  |
| 派生商品評価勘定    | 24,008,511     |
| 未収入金        | 1,670,508      |
| 未収配当金       | 105,137,658    |
| 差入委託証拠金     | 354,733,207    |
| 流動資産合計      | 51,076,357,294 |
| 資産合計        | 51,076,357,294 |
| <b>負債の部</b> |                |
| 流動負債        |                |
| 派生商品評価勘定    | 501,052,940    |
| 未払金         | 1,023,448,382  |
| 未払解約金       | 100,137,686    |
| 未払利息        | 1,708          |
| その他未払費用     | 518,100        |

(2019年 9月 6日現在)

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 流動負債合計          | 1,625,158,816  |
| 負債合計            | 1,625,158,816  |
| 純資産の部           |                |
| 元本等             |                |
| 元本              | 25,142,823,196 |
| 剰余金             |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 24,308,375,282 |
| 元本等合計           | 49,451,198,478 |
| 純資産合計           | 49,451,198,478 |
| 負債純資産合計         | 51,076,357,294 |

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

## （貸借対照表に関する注記）

| 2019年 9月 6日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 1.9668円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (19,668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 2018年 9月 7日<br>至 2019年 9月 6日   |
|--|
| <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</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

| 2019年 9月 6日現在  |  |
|--|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額                                   |  |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ |  |
| ん。   |  |
| 2. 時価の算定方法   |  |

## 株式

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

## 投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## (その他の注記)

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2019年 9月 6日現在                                  |                 |
|--|-----------------|
| 期首   | 2018年 9月 7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               | 24,511,893,185円 |
| 同期中における追加設定元本額                                 | 7,908,198,423円  |
| 同期中における一部解約元本額                                 | 7,277,268,412円  |
| 期末元本額  | 25,142,823,196円 |
| 期末元本額の内訳*                                      |                 |
| 野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型                       | 1,908,584,972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                  | 888,541,821円    |
| 野村外国株インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)                   | 571,559,028円    |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                              | 4,086,980円      |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                              | 2,666,394円      |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                              | 7,856,937円      |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                              | 1,619,936円      |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                              | 4,887,834円      |
| 野村外国株インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)                   | 7,119,889,220円  |
| 野村外国株(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)            | 2,360,206,689円  |
| NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジあり)連動型上場投信 | 599,749,668円    |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式                         | 204,637,486円    |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)                   | 8,602,530,047円  |
| 野村外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA(適格機関投資家専用)            | 1,602,414,978円  |
| ノムラ外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA(適格機関投資家専用)           | 1,196,852,779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)               | 66,142,214円     |
| 野村MSCI-KOKUSAIインデックスオープン投信・為替ヘッジ型(適格機関投資家専用)   | 596,213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(2019年9月6日現在)

| 種類                   | 通貨     | 銘柄                           | 株式数        | 評価額    |              | 備考 |
|----------------------|--------|------------------------------|------------|--------|--------------|----|
|                      |        |                              |            | 単価     | 金額           |    |
| 株式                   | 米ドル    | BAKER HUGHES, A GE CO, LLC   | 5,200      | 23.52  | 122,304.00   |    |
|                      |        | HALLIBURTON CO               | 10,600     | 19.00  | 201,400.00   |    |
|                      |        | HELMERICH & PAYNE            | 1,000      | 37.61  | 37,610.00    |    |
|                      |        | NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 4,200      | 22.00  | 92,400.00    |    |
|                      |        | SCHLUMBERGER LTD             | 16,200     | 34.06  | 551,772.00   |    |
|                      |        | TECHNIPFMC PLC               | 5,200      | 25.74  | 133,848.00   |    |
|                      |        | APACHE CORPORATION           | 4,400      | 22.67  | 99,748.00    |    |
|                      |        | CABOT OIL & GAS CORP         | 4,600      | 17.40  | 80,040.00    |    |
|                      |        | CHENIERE ENERGY INC          | 2,500      | 61.87  | 154,675.00   |    |
|                      |        | CHEVRON CORP                 | 23,030     | 117.64 | 2,709,249.20 |    |
|                      |        | CIMAREX ENERGY CO            | 960        | 43.18  | 41,452.80    |    |
|                      |        | CONCHO RESOURCES INC         | 2,340      | 70.36  | 164,642.40   |    |
|                      |        | CONOCOPHILLIPS               | 14,000     | 53.44  | 748,160.00   |    |
|                      |        | CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 1,180      | 30.17  | 35,600.60    |    |
|                      |        | DEVON ENERGY CORP            | 6,000      | 23.50  | 141,000.00   |    |
|                      |        | DIAMONDBACK ENERGY INC       | 1,800      | 97.65  | 175,770.00   |    |
|                      |        | EOG RESOURCES INC            | 6,810      | 75.60  | 514,836.00   |    |
|                      |        | EXXON MOBIL CORP             | 51,100     | 70.27  | 3,590,797.00 |    |
|                      |        | HESS CORP                    | 2,900      | 64.99  | 188,471.00   |    |
|                      |        | HOLLYFRONTIER CORP           | 1,600      | 47.62  | 76,192.00    |    |
|                      |        | KINDER MORGAN INC            | 24,600     | 20.51  | 504,546.00   |    |
|                      |        | MARATHON OIL CORP            | 10,800     | 12.54  | 135,432.00   |    |
|                      |        | MARATHON PETROLEUM CORP      | 7,600      | 52.48  | 398,848.00   |    |
|                      |        | NOBLE ENERGY INC             | 5,000      | 22.68  | 113,400.00   |    |
|                      |        | OCCIDENTAL PETE CORP         | 10,089     | 45.09  | 454,913.01   |    |
|                      |        | ONEOK INC                    | 4,600      | 71.02  | 326,692.00   |    |
|                      |        | PARSLEY ENERGY INC-CLASS A   | 3,500      | 17.65  | 61,775.00    |    |
|                      |        | PHILLIPS 66                  | 5,510      | 99.80  | 549,898.00   |    |
|                      |        | PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 2,200      | 128.54 | 282,788.00   |    |
|                      |        | PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A   | 2,000      | 21.88  | 43,760.00    |    |
| TARGA RESOURCES CORP | 2,800  | 36.78                        | 102,984.00 |        |              |    |
| VALERO ENERGY CORP   | 5,150  | 76.79                        | 395,468.50 |        |              |    |
| WILLIAMS COS         | 14,600 | 24.07                        | 351,422.00 |        |              |    |

|                                      |        |        |              |
|--------------------------------------|--------|--------|--------------|
| AIR PRODUCTS                         | 2,650  | 224.57 | 595,110.50   |
| ALBEMARLE CORP                       | 1,080  | 62.97  | 68,007.60    |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD           | 2,900  | 29.64  | 85,956.00    |
| CELANESE CORP-SERIES A               | 1,480  | 117.63 | 174,092.40   |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC           | 2,400  | 48.17  | 115,608.00   |
| CORTEVA INC                          | 8,266  | 28.46  | 235,250.36   |
| DOW INC                              | 8,933  | 43.36  | 387,334.88   |
| DUPONT DE NEMOURS INC                | 8,966  | 68.94  | 618,116.04   |
| EASTMAN CHEMICAL CO.                 | 1,490  | 67.49  | 100,560.10   |
| ECOLAB INC                           | 3,220  | 205.33 | 661,162.60   |
| FMC CORP                             | 1,800  | 87.48  | 157,464.00   |
| INTERNATIONAL FLAVORS &<br>FRAGRANCE | 1,320  | 114.50 | 151,140.00   |
| LINDE PLC                            | 6,630  | 187.10 | 1,240,473.00 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A             | 3,500  | 77.60  | 271,600.00   |
| MOSAIC CO/THE                        | 3,660  | 19.38  | 70,930.80    |
| PPG INDUSTRIES                       | 2,870  | 113.34 | 325,285.80   |
| SHERWIN-WILLIAMS                     | 960    | 534.52 | 513,139.20   |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP               | 280    | 60.21  | 16,858.80    |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS            | 830    | 255.72 | 212,247.60   |
| VULCAN MATERIALS CO                  | 1,520  | 142.86 | 217,147.20   |
| AMCOR PLC                            | 19,400 | 9.77   | 189,538.00   |
| AVERY DENNISON CORP                  | 810    | 113.93 | 92,283.30    |
| BALL CORP                            | 4,000  | 78.71  | 314,840.00   |
| CROWN HOLDINGS INC                   | 1,800  | 65.45  | 117,810.00   |
| IP(INTERNATIONAL PAPER CO)           | 4,400  | 39.37  | 173,228.00   |
| PACKAGING CORP OP AMERICA            | 1,050  | 100.53 | 105,556.50   |
| SEALED AIR CORP                      | 1,500  | 39.32  | 58,980.00    |
| WESTROCK CO                          | 2,900  | 34.93  | 101,297.00   |
| FREEMONT-MCMORAN INC                 | 14,500 | 9.53   | 138,185.00   |
| NEWMONT GOLDCORP CORP                | 9,656  | 39.34  | 379,867.04   |
| NUCOR CORP                           | 3,300  | 50.35  | 166,155.00   |
| STEEL DYNAMICS                       | 2,100  | 28.05  | 58,905.00    |
| ARCONIC INC                          | 4,400  | 26.01  | 114,444.00   |
| BOEING CO                            | 6,470  | 360.30 | 2,331,141.00 |
| GENERAL DYNAMICS                     | 3,000  | 192.27 | 576,810.00   |

|                                       |         |        |              |
|---------------------------------------|---------|--------|--------------|
| HEICO CORP                            | 340     | 144.57 | 49,153.80    |
| HEICO CORP-CLASS A                    | 1,090   | 110.21 | 120,128.90   |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE          | 540     | 214.24 | 115,689.60   |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC             | 2,700   | 212.13 | 572,751.00   |
| LOCKHEED MARTIN                       | 3,010   | 385.15 | 1,159,301.50 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP                 | 1,940   | 368.43 | 714,754.20   |
| RAYTHEON COMPANY                      | 3,390   | 185.27 | 628,065.30   |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A          | 1,120   | 81.77  | 91,582.40    |
| TEXTRON INC                           | 2,800   | 46.29  | 129,612.00   |
| TRANSDIGM GROUP INC                   | 600     | 532.97 | 319,782.00   |
| UNITED TECHNOLOGIES                   | 9,990   | 133.03 | 1,328,969.70 |
| ALLEGION PLC                          | 890     | 98.62  | 87,771.80    |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY<br>INC | 1,740   | 51.53  | 89,662.20    |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL<br>PLC | 9,300   | 42.85  | 398,505.00   |
| LENNOX INTERNATIONAL INC              | 530     | 251.65 | 133,374.50   |
| MASCO CORP                            | 3,300   | 41.26  | 136,158.00   |
| OWENS CORNING INC                     | 1,050   | 56.75  | 59,587.50    |
| SMITH (A.O.) CORP                     | 1,400   | 47.62  | 66,668.00    |
| FLUOR CORP                            | 1,400   | 19.64  | 27,496.00    |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC          | 1,900   | 91.36  | 173,584.00   |
| ACUITY BRANDS INC                     | 440     | 124.75 | 54,890.00    |
| AMETEK INC                            | 2,630   | 88.33  | 232,307.90   |
| EATON CORP PLC                        | 5,200   | 81.95  | 426,140.00   |
| EMERSON ELEC                          | 6,900   | 61.84  | 426,696.00   |
| ROCKWELL AUTOMATION INC               | 1,270   | 158.70 | 201,549.00   |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING          | 1,600   | 47.37  | 75,792.00    |
| 3M CORP                               | 6,900   | 164.23 | 1,133,187.00 |
| GENERAL ELEC CO                       | 107,000 | 8.81   | 942,670.00   |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC           | 8,680   | 170.37 | 1,478,811.60 |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD            | 2,500   | 55.80  | 139,500.00   |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD           | 2,600   | 33.05  | 85,930.00    |
| ROPER TECHNOLOGIES INC                | 1,200   | 375.11 | 450,132.00   |
| CATERPILLAR INC DEL                   | 7,050   | 122.99 | 867,079.50   |
| CUMMINS INC                           | 1,760   | 154.66 | 272,201.60   |

|                                      |       |        |              |
|--------------------------------------|-------|--------|--------------|
| DEERE & COMPANY                      | 3,760 | 156.30 | 587,688.00   |
| DOVER CORP                           | 1,700 | 96.13  | 163,421.00   |
| FLOWSERVE CORP                       | 1,480 | 43.89  | 64,957.20    |
| FORTIVE CORP                         | 3,470 | 68.10  | 236,307.00   |
| IDEX CORP                            | 950   | 168.71 | 160,274.50   |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC              | 3,960 | 151.48 | 599,860.80   |
| INGERSOLL-RAND PLC                   | 2,830 | 121.41 | 343,590.30   |
| MIDDLEBY CORP                        | 660   | 112.35 | 74,151.00    |
| PACCAR                               | 3,890 | 68.20  | 265,298.00   |
| PARKER HANNIFIN CORP                 | 1,400 | 171.64 | 240,296.00   |
| PENTAIR PLC                          | 2,100 | 36.23  | 76,083.00    |
| SNAP-ON INC                          | 550   | 151.74 | 83,457.00    |
| STANLEY BLACK & DECKER INC           | 1,990 | 136.32 | 271,276.80   |
| WABCO HOLDINGS INC                   | 620   | 133.72 | 82,906.40    |
| WABTEC CORP                          | 2,200 | 67.99  | 149,578.00   |
| XYLEM INC                            | 2,150 | 77.75  | 167,162.50   |
| AERCAP HOLDINGS NV                   | 1,400 | 54.62  | 76,468.00    |
| FASTENAL CO                          | 7,600 | 31.06  | 236,056.00   |
| GRAINGER(W.W.) INC                   | 570   | 276.78 | 157,764.60   |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC               | 1,700 | 40.08  | 68,136.00    |
| UNITED RENTALS INC                   | 800   | 116.49 | 93,192.00    |
| CINTAS CORP                          | 1,150 | 267.24 | 307,326.00   |
| COPART INC                           | 2,600 | 80.61  | 209,586.00   |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A           | 2,860 | 88.81  | 253,996.60   |
| ROLLINS INC                          | 1,500 | 34.20  | 51,300.00    |
| WASTE CONNECTIONS INC                | 3,000 | 91.73  | 275,190.00   |
| WASTE MANAGEMENT INC                 | 5,110 | 119.09 | 608,549.90   |
| C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC           | 1,580 | 83.94  | 132,625.20   |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH<br>INC | 2,300 | 72.57  | 166,911.00   |
| FEDEX CORPORATION                    | 2,990 | 164.38 | 491,496.20   |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B           | 8,300 | 121.20 | 1,005,960.00 |
| XPO LOGISTICS INC                    | 1,490 | 71.83  | 107,026.70   |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC          | 1,100 | 27.69  | 30,459.00    |
| DELTA AIR LINES INC                  | 1,700 | 58.19  | 98,923.00    |
| SOUTHWEST AIRLINES                   | 1,500 | 52.52  | 78,780.00    |

|  |        |          |              |
|--|--------|----------|--------------|
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC             | 860    | 85.84    | 73,822.40    |
| AMERCO                                   | 80     | 357.51   | 28,600.80    |
| CSX CORP                                 | 8,900  | 68.06    | 605,734.00   |
| HUNT J B TRANSPORT SVCS INC              | 880    | 112.44   | 98,947.20    |
| KANSAS CITY SOUTHERN                     | 1,260  | 129.92   | 163,699.20   |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 1,300  | 36.01    | 46,813.00    |
| NORFOLK SOUTHERN CORP                    | 3,320  | 176.28   | 585,249.60   |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE                | 920    | 164.68   | 151,505.60   |
| UBER TECHNOLOGIES INC                    | 1,600  | 32.51    | 52,016.00    |
| UNION PAC CORP                           | 8,630  | 166.13   | 1,433,701.90 |
| APTIV PLC                                | 2,950  | 88.17    | 260,101.50   |
| AUTOLIV INC                              | 980    | 74.17    | 72,686.60    |
| BORGWARNER INC                           | 2,600  | 35.09    | 91,234.00    |
| LEAR CORP                                | 810    | 120.45   | 97,564.50    |
| FORD MOTOR COMPANY                       | 47,500 | 9.34     | 443,650.00   |
| GENERAL MOTORS CO                        | 15,100 | 38.73    | 584,823.00   |
| HARLEY-DAVIDSON INC                      | 1,800  | 32.58    | 58,644.00    |
| TESLA INC                                | 1,520  | 229.58   | 348,961.60   |
| DR HORTON INC                            | 4,300  | 49.96    | 214,828.00   |
| GARMIN LTD                               | 1,700  | 83.05    | 141,185.00   |
| LEGGETT & PLATT INC                      | 1,400  | 38.30    | 53,620.00    |
| LENNAR CORP-A                            | 3,000  | 51.69    | 155,070.00   |
| MOHAWK INDUSTRIES                        | 660    | 117.83   | 77,767.80    |
| NEWELL BRANDS INC                        | 5,900  | 17.51    | 103,309.00   |
| NVR INC                                  | 44     | 3,585.60 | 157,766.40   |
| PULTEGROUP INC                           | 2,800  | 34.25    | 95,900.00    |
| ROKU INC                                 | 1,110  | 166.93   | 185,292.30   |
| WHIRLPOOL CORP                           | 700    | 142.96   | 100,072.00   |
| HASBRO INC                               | 1,640  | 110.99   | 182,023.60   |
| POLARIS INC                              | 640    | 83.35    | 53,344.00    |
| CAPRI HOLDINGS LTD                       | 1,900  | 28.30    | 53,770.00    |
| HANESBRANDS INC                          | 3,400  | 14.33    | 48,722.00    |
| LULULEMON ATHLETICA INC                  | 1,450  | 188.41   | 273,194.50   |
| NIKE INC-B                               | 15,000 | 88.42    | 1,326,300.00 |
|  | 930    | 84.56    | 78,640.80    |

|                              |        |          |              |
|------------------------------|--------|----------|--------------|
| PVH CORP                     |        |          |              |
| RALPH LAUREN CORPORATION     | 640    | 94.26    | 60,326.40    |
| TAPESTRY INC                 | 3,300  | 22.92    | 75,636.00    |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A     | 2,100  | 19.77    | 41,517.00    |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C     | 2,114  | 17.91    | 37,861.74    |
| V F CORP                     | 3,720  | 86.51    | 321,817.20   |
| ARAMARK                      | 3,000  | 42.01    | 126,030.00   |
| CARNIVAL CORP                | 4,800  | 45.11    | 216,528.00   |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 340    | 838.11   | 284,957.40   |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 1,390  | 124.06   | 172,443.40   |
| DOMINOS PIZZA INC            | 470    | 244.83   | 115,070.10   |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 3,400  | 93.47    | 317,798.00   |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 4,330  | 56.13    | 243,042.90   |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA   | 3,570  | 128.46   | 458,602.20   |
| MCDONALD'S CORP              | 9,060  | 219.49   | 1,988,579.40 |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR   | 3,000  | 20.96    | 62,880.00    |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 6,500  | 27.98    | 181,870.00   |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 2,600  | 52.31    | 136,006.00   |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 1,940  | 106.94   | 207,463.60   |
| STARBUCKS CORP               | 14,440 | 95.56    | 1,379,886.40 |
| VAIL RESORTS INC             | 500    | 235.80   | 117,900.00   |
| WYNN RESORTS LTD             | 960    | 111.33   | 106,876.80   |
| YUM BRANDS INC               | 3,740  | 118.16   | 441,918.40   |
| GENUINE PARTS CO             | 1,560  | 93.56    | 145,953.60   |
| LKQ CORP                     | 2,800  | 26.91    | 75,348.00    |
| AMAZON.COM INC               | 5,031  | 1,840.72 | 9,260,662.32 |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 513    | 1,994.44 | 1,023,147.72 |
| EBAY INC                     | 9,900  | 40.80    | 403,920.00   |
| EXPEDIA GROUP INC            | 1,510  | 131.55   | 198,640.50   |
| GRUBHUB INC                  | 800    | 60.40    | 48,320.00    |
| MERCADOLIBRE INC             | 560    | 605.69   | 339,186.40   |
| QURATE RETAIL INC - A        | 5,100  | 11.08    | 56,508.00    |
| WAYFAIR INC - CLASS A        | 840    | 119.60   | 100,464.00   |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 3,060  | 159.82   | 489,049.20   |
| DOLLAR TREE INC              | 3,070  | 107.63   | 330,424.10   |
|                              | 2,100  | 48.25    | 101,325.00   |

|                              |        |          |              |  |
|------------------------------|--------|----------|--------------|--|
| KOHL'S CORP                  |        |          |              |  |
| MACYS INC                    | 3,700  | 15.31    | 56,647.00    |  |
| NORDSTROM INC                | 1,600  | 31.07    | 49,712.00    |  |
| TARGET CORP                  | 6,030  | 108.54   | 654,496.20   |  |
| ADVANCE AUTO PARTS           | 760    | 146.55   | 111,378.00   |  |
| AUTOZONE                     | 315    | 1,134.54 | 357,380.10   |  |
| BEST BUY COMPANY INC         | 2,700  | 65.76    | 177,552.00   |  |
| BURLINGTON STORES INC        | 930    | 204.18   | 189,887.40   |  |
| CARMAX INC                   | 1,700  | 86.73    | 147,441.00   |  |
| GAP INC                      | 2,400  | 16.99    | 40,776.00    |  |
| HOME DEPOT                   | 13,290 | 228.15   | 3,032,113.50 |  |
| L BRANDS, INC                | 2,600  | 16.82    | 43,732.00    |  |
| LOWES COS INC                | 9,340  | 114.21   | 1,066,721.40 |  |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC,      | 1,000  | 396.58   | 396,580.00   |  |
| ROSS STORES INC              | 4,350  | 109.36   | 475,716.00   |  |
| TIFFANY & CO                 | 1,390  | 88.19    | 122,584.10   |  |
| TJX COS INC                  | 14,700 | 55.77    | 819,819.00   |  |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 1,600  | 102.98   | 164,768.00   |  |
| ULTA BEAUTY INC              | 620    | 236.71   | 146,760.20   |  |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION | 5,350  | 296.97   | 1,588,789.50 |  |
| DAIRY FARM INTL HLDGS LTD    | 4,500  | 7.00     | 31,500.00    |  |
| KROGER CO                    | 9,500  | 24.83    | 235,885.00   |  |
| SYSCO CORP                   | 6,200  | 74.38    | 461,156.00   |  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 8,900  | 52.33    | 465,737.00   |  |
| WALMART INC                  | 17,010 | 115.44   | 1,963,634.40 |  |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B       | 3,800  | 60.91    | 231,458.00   |  |
| COCA COLA CO                 | 49,000 | 55.12    | 2,700,880.00 |  |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  | 2,700  | 55.72    | 150,444.00   |  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 1,910  | 204.93   | 391,416.30   |  |
| MOLSON COORS BREWING CO-B    | 1,960  | 53.18    | 104,232.80   |  |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 4,800  | 58.77    | 282,096.00   |  |
| PEPSICO INC                  | 16,610 | 135.98   | 2,258,627.80 |  |
| ARCHER DANIELS MIDLAND       | 6,300  | 38.63    | 243,369.00   |  |
| BUNGE LIMITED                | 1,700  | 55.22    | 93,874.00    |  |
| CAMPBELL SOUP CO             | 2,000  | 44.62    | 89,240.00    |  |
|                              | 6,100  | 28.45    | 173,545.00   |  |

|                             |        |        |              |
|-----------------------------|--------|--------|--------------|
| CONAGRA BRANDS INC          |        |        |              |
| GENERAL MILLS               | 7,300  | 54.16  | 395,368.00   |
| HERSHEY CO/THE              | 1,870  | 160.30 | 299,761.00   |
| HORMEL FOODS CORP           | 3,600  | 42.55  | 153,180.00   |
| INGREDION INC               | 690    | 79.47  | 54,834.30    |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW       | 1,230  | 104.68 | 128,756.40   |
| KELLOGG CO                  | 3,100  | 62.84  | 194,804.00   |
| KRAFT HEINZ CO/THE          | 7,800  | 26.59  | 207,402.00   |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC    | 2,000  | 71.79  | 143,580.00   |
| MCCORMICK & CO INC.         | 1,450  | 163.75 | 237,437.50   |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC  | 17,300 | 56.14  | 971,222.00   |
| TYSON FOODS INC-CL A        | 3,770  | 85.26  | 321,430.20   |
| ALTRIA GROUP INC            | 22,900 | 43.85  | 1,004,165.00 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 18,300 | 71.95  | 1,316,685.00 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC      | 3,200  | 77.50  | 248,000.00   |
| CLOROX CO                   | 1,610  | 162.20 | 261,142.00   |
| COLGATE PALMOLIVE CO.       | 9,900  | 74.29  | 735,471.00   |
| KIMBERLY-CLARK CORP         | 4,080  | 139.48 | 569,078.40   |
| PROCTER & GAMBLE CO         | 30,260 | 122.76 | 3,714,717.60 |
| COTY INC-CL A               | 4,300  | 9.91   | 42,613.00    |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 2,530  | 204.98 | 518,599.40   |
| ABBOTT LABORATORIES         | 21,000 | 85.90  | 1,803,900.00 |
| ABIOMED INC                 | 500    | 190.25 | 95,125.00    |
| ALIGN TECHNOLOGY INC        | 810    | 177.11 | 143,459.10   |
| BAXTER INTERNATIONAL INC.   | 5,900  | 87.91  | 518,669.00   |
| BECTON,DICKINSON            | 3,210  | 258.48 | 829,720.80   |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP      | 16,600 | 42.61  | 707,326.00   |
| DANAHER CORP                | 7,880  | 142.95 | 1,126,446.00 |
| DENTSPLY SIRONA INC         | 2,420  | 51.65  | 124,993.00   |
| DEXCOM INC                  | 1,190  | 167.67 | 199,527.30   |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP   | 2,550  | 224.98 | 573,699.00   |
| HOLOGIC INC                 | 2,900  | 49.69  | 144,101.00   |
| IDEXX LABORATORIES INC      | 1,110  | 289.93 | 321,822.30   |
| INTUITIVE SURGICAL INC      | 1,340  | 508.17 | 680,947.80   |
| MEDTRONIC PLC               | 15,930 | 107.72 | 1,715,979.60 |
|                             | 1,680  | 140.33 | 235,754.40   |

|                              |        |        |              |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| RESMED INC                   |        |        |              |
| STERIS PLC                   | 1,160  | 153.50 | 178,060.00   |
| STRYKER CORP                 | 3,970  | 220.22 | 874,273.40   |
| TELEFLEX INC                 | 510    | 356.48 | 181,804.80   |
| THE COOPER COMPANIES, INC.   | 620    | 307.73 | 190,792.60   |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC   | 1,060  | 108.09 | 114,575.40   |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 2,500  | 139.54 | 348,850.00   |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 1,650  | 86.04  | 141,966.00   |
| ANTHEM INC                   | 2,990  | 251.22 | 751,147.80   |
| CARDINAL HEALTH INC          | 3,500  | 44.38  | 155,330.00   |
| CENTENE CORP                 | 4,400  | 46.14  | 203,016.00   |
| CIGNA CORP                   | 4,380  | 151.00 | 661,380.00   |
| CVS HEALTH CORP              | 15,900 | 62.76  | 997,884.00   |
| DAVITA INC                   | 1,400  | 57.98  | 81,172.00    |
| HCA HEALTHCARE INC           | 3,210  | 124.25 | 398,842.50   |
| HENRY SCHEIN INC             | 2,100  | 61.83  | 129,843.00   |
| HUMANA INC                   | 1,640  | 274.71 | 450,524.40   |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 1,050  | 170.49 | 179,014.50   |
| MCKESSON CORP                | 2,440  | 141.37 | 344,942.80   |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 1,360  | 102.72 | 139,699.20   |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 11,490 | 229.59 | 2,637,989.10 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 870    | 145.14 | 126,271.80   |
| WELLCARE HEALTH PLANS INC    | 690    | 270.35 | 186,541.50   |
| ABBVIE INC                   | 17,700 | 67.03  | 1,186,431.00 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 2,510  | 100.28 | 251,702.80   |
| ALKERMES PLC                 | 1,640  | 20.12  | 32,996.80    |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 1,600  | 83.14  | 133,024.00   |
| AMGEN INC                    | 7,300  | 207.65 | 1,515,845.00 |
| BEIGENE, LTD ADR             | 370    | 131.03 | 48,481.10    |
| BIOGEN INC                   | 2,240  | 223.96 | 501,670.40   |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 2,140  | 73.10  | 156,434.00   |
| CELGENE CORP                 | 8,370  | 97.51  | 816,158.70   |
| EXACT SCIENCES CORP          | 1,690  | 122.49 | 207,008.10   |
| GILEAD SCIENCES INC          | 15,100 | 64.06  | 967,306.00   |
| INCYTE CORP                  | 2,500  | 79.27  | 198,175.00   |

|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| IONIS PHARMACEUTICALS INC    | 1,200   | 62.76  | 75,312.00    |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 1,050   | 289.37 | 303,838.50   |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC     | 1,100   | 89.02  | 97,922.00    |
| SEATTLE GENETICS INC         | 1,100   | 71.35  | 78,485.00    |
| VERTEX PHARMACEUTICALS       | 3,030   | 179.86 | 544,975.80   |
| ALLERGAN PLC                 | 4,000   | 162.41 | 649,640.00   |
| BRISTOL MYERS SQUIBB         | 20,100  | 48.51  | 975,051.00   |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC     | 5,000   | 26.49  | 132,450.00   |
| ELI LILLY & CO.              | 10,550  | 114.60 | 1,209,030.00 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | 550     | 126.78 | 69,729.00    |
| JOHNSON & JOHNSON            | 32,010  | 128.58 | 4,115,845.80 |
| MERCK & CO INC               | 31,130  | 86.10  | 2,680,293.00 |
| MYLAN NV                     | 6,100   | 20.22  | 123,342.00   |
| NEKTAR THERAPEUTICS          | 2,200   | 17.37  | 38,214.00    |
| PERRIGO CO PLC               | 1,700   | 48.16  | 81,872.00    |
| PFIZER INC                   | 67,200  | 36.34  | 2,442,048.00 |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | 16,000  | 6.89   | 110,240.00   |
| ZOETIS INC                   | 5,760   | 128.07 | 737,683.20   |
| BANK OF AMERICA CORP         | 109,100 | 28.12  | 3,067,892.00 |
| BB&T CORPORATION             | 9,300   | 48.65  | 452,445.00   |
| CIT GROUP INC                | 1,000   | 43.32  | 43,320.00    |
| CITIGROUP                    | 27,500  | 66.34  | 1,824,350.00 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 5,300   | 34.20  | 181,260.00   |
| COMERICA INC                 | 1,800   | 62.38  | 112,284.00   |
| EAST WEST BANCORP INC        | 1,900   | 42.18  | 80,142.00    |
| FIFTH THIRD BANCORP          | 10,200  | 26.75  | 272,850.00   |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 1,700   | 89.67  | 152,439.00   |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 11,900  | 13.54  | 161,126.00   |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 39,100  | 112.37 | 4,393,667.00 |
| KEYCORP                      | 12,300  | 17.04  | 209,592.00   |
| M & T BANK CORP              | 1,410   | 147.10 | 207,411.00   |
| PEOPLES UNITED FINANCIAL INC | 5,700   | 14.81  | 84,417.00    |
| PNC FINANCIAL                | 5,470   | 131.56 | 719,633.20   |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 12,300  | 14.81  | 182,163.00   |
| SIGNATURE BANK               | 520     | 116.41 | 60,533.20    |
| SUNTRUST BKS INC.            | 5,200   | 62.91  | 327,132.00   |

|                               |        |          |              |
|-------------------------------|--------|----------|--------------|
| SVB FINANCIAL GROUP           | 630    | 199.78   | 125,861.40   |
| US BANCORP                    | 17,800 | 53.27    | 948,206.00   |
| WELLS FARGO CO                | 51,700 | 47.62    | 2,461,954.00 |
| ZIONS BANCORP NA              | 2,300  | 41.14    | 94,622.00    |
| AXA EQUITABLE HOLDINGS INC    | 4,100  | 21.04    | 86,264.00    |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B   | 15,700 | 204.24   | 3,206,568.00 |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC | 3,000  | 19.06    | 57,180.00    |
| VOYA FINANCIAL INC            | 2,100  | 50.95    | 106,995.00   |
| AFLAC INC                     | 9,100  | 51.13    | 465,283.00   |
| ALLEGHANY CORP                | 170    | 771.09   | 131,085.30   |
| ALLSTATE CORP                 | 3,730  | 104.38   | 389,337.40   |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC  | 1,130  | 103.83   | 117,327.90   |
| AMERICAN INTL GROUP           | 10,100 | 54.68    | 552,268.00   |
| AON PLC                       | 2,900  | 195.60   | 567,240.00   |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD        | 5,400  | 41.13    | 222,102.00   |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO       | 2,400  | 89.73    | 215,352.00   |
| ASSURANT INC                  | 750    | 123.85   | 92,887.50    |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A    | 2,000  | 39.63    | 79,260.00    |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC     | 890    | 36.39    | 32,387.10    |
| CHUBB LTD                     | 5,460  | 160.63   | 877,039.80   |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP     | 2,050  | 113.93   | 233,556.50   |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A   | 200    | 214.06   | 42,812.00    |
| EVEREST RE GROUP LTD          | 440    | 248.74   | 109,445.60   |
| FNF GROUP                     | 3,500  | 44.79    | 156,765.00   |
| GLOBE LIFE INC                | 1,230  | 90.84    | 111,733.20   |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES   | 4,100  | 59.99    | 245,959.00   |
| LINCOLN NATIONAL CORP         | 2,200  | 54.81    | 120,582.00   |
| LOEWS CORP                    | 2,800  | 48.96    | 137,088.00   |
| MARKEL CORP                   | 144    | 1,152.89 | 166,016.16   |
| MARSH & MCLENNAN COS          | 6,360  | 101.05   | 642,678.00   |
| METLIFE INC                   | 10,200 | 45.95    | 468,690.00   |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP     | 3,080  | 53.90    | 166,012.00   |
| PROGRESSIVE CO                | 7,000  | 76.53    | 535,710.00   |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC      | 5,100  | 81.92    | 417,792.00   |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA  | 750    | 155.07   | 116,302.50   |

|                                       |        |        |              |
|---------------------------------------|--------|--------|--------------|
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD            | 490    | 188.10 | 92,169.00    |
| TRAVELERS COS INC/THE                 | 3,200  | 151.74 | 485,568.00   |
| UNUM GROUP                            | 2,700  | 26.28  | 70,956.00    |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC              | 1,640  | 197.69 | 324,211.60   |
| WR BERKLEY CORP                       | 1,485  | 71.93  | 106,816.05   |
| ACCENTURE PLC-CL A                    | 7,760  | 199.49 | 1,548,042.40 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES                   | 1,800  | 92.54  | 166,572.00   |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP            | 510    | 126.99 | 64,764.90    |
| AUTOMATIC DATA PROCESS                | 5,240  | 173.27 | 907,934.80   |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS<br>INC | 1,410  | 131.51 | 185,429.10   |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP         | 7,000  | 64.26  | 449,820.00   |
| DXC TECHNOLOGY CO                     | 3,310  | 34.04  | 112,672.40   |
| EPAM SYSTEMS INC                      | 530    | 194.82 | 103,254.60   |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION         | 7,209  | 139.05 | 1,002,411.45 |
| FISERV INC                            | 6,950  | 108.70 | 755,465.00   |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC             | 950    | 302.53 | 287,403.50   |
| GARTNER INC                           | 920    | 136.80 | 125,856.00   |
| GLOBAL PAYMENTS INC                   | 1,880  | 174.84 | 328,699.20   |
| GODADDY INC - CLASS A                 | 1,800  | 65.12  | 117,216.00   |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES       | 10,570 | 140.97 | 1,490,052.90 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC           | 970    | 148.51 | 144,054.70   |
| LEIDOS HOLDINGS INC                   | 1,800  | 88.82  | 159,876.00   |
| MASTERCARD INC                        | 10,980 | 292.08 | 3,207,038.40 |
| MONGODB INC                           | 640    | 150.44 | 96,281.60    |
| OKTA INC                              | 1,420  | 124.25 | 176,435.00   |
| PAYCHEX INC                           | 4,000  | 83.80  | 335,200.00   |
| PAYPAL HOLDINGS INC                   | 13,130 | 111.46 | 1,463,469.80 |
| SABRE CORP                            | 3,700  | 23.74  | 87,838.00    |
| SQUARE INC - A                        | 4,100  | 63.02  | 258,382.00   |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC             | 2,120  | 141.41 | 299,789.20   |
| TWILIO INC - A                        | 1,460  | 129.73 | 189,405.80   |
| VERISIGN INC                          | 1,390  | 206.58 | 287,146.20   |
| VISA INC-CLASS A SHARES               | 20,980 | 184.73 | 3,875,635.40 |
| WESTERN UNION CO                      | 5,500  | 22.60  | 124,300.00   |
| WIX.COM LTD                           | 530    | 135.94 | 72,048.20    |

|  |        |        |               |
|--|--------|--------|---------------|
| ADOBE INC                              | 5,800  | 287.75 | 1,668,950.00  |
| ANSYS INC                              | 950    | 218.09 | 207,185.50    |
| AUTODESK INC.                          | 2,480  | 148.22 | 367,585.60    |
| CADENCE DESIGN SYS INC                 | 3,700  | 70.61  | 261,257.00    |
| CDK GLOBAL INC                         | 1,430  | 44.52  | 63,663.60     |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD. | 1,430  | 108.00 | 154,440.00    |
| CITRIX SYSTEMS INC                     | 1,590  | 94.35  | 150,016.50    |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL           | 560    | 115.90 | 64,904.00     |
| DOCUSIGN INC                           | 900    | 46.25  | 41,625.00     |
| DROPBOX INC-CLASS A                    | 1,500  | 18.86  | 28,290.00     |
| FORTINET INC                           | 1,500  | 80.39  | 120,585.00    |
| INTUIT INC                             | 3,090  | 292.31 | 903,237.90    |
| MICROSOFT CORP                         | 87,460 | 140.05 | 12,248,773.00 |
| ORACLE CORPORATION                     | 28,400 | 53.84  | 1,529,056.00  |
| PALO ALTO NETWORKS INC                 | 1,260  | 212.05 | 267,183.00    |
| PAYCOM SOFTWARE INC                    | 490    | 252.69 | 123,818.10    |
| PTC INC                                | 1,590  | 66.94  | 106,434.60    |
| SALESFORCE.COM INC                     | 10,120 | 153.77 | 1,556,152.40  |
| SERVICENOW INC                         | 2,180  | 269.62 | 587,771.60    |
| SPLUNK INC                             | 1,750  | 110.68 | 193,690.00    |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS             | 2,200  | 48.82  | 107,404.00    |
| SYMANTEC CORP                          | 6,700  | 23.47  | 157,249.00    |
| SYNOPSYS INC                           | 1,780  | 145.95 | 259,791.00    |
| VMWARE INC - CLASS A                   | 900    | 147.90 | 133,110.00    |
| WORKDAY INC-CLASS A                    | 1,860  | 175.90 | 327,174.00    |
| ARISTA NETWORKS INC                    | 560    | 235.38 | 131,812.80    |
| CISCO SYSTEMS                          | 51,800 | 48.42  | 2,508,156.00  |
| F5 NETWORKS INC                        | 760    | 131.27 | 99,765.20     |
| JUNIPER NETWORKS INC                   | 4,100  | 23.87  | 97,867.00     |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC                 | 1,940  | 173.57 | 336,725.80    |
| APPLE INC                              | 55,280 | 213.28 | 11,790,118.40 |
| DELL TECHNOLOGIES-C                    | 2,200  | 52.92  | 116,424.00    |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE             | 16,500 | 14.40  | 237,600.00    |
| HP INC                                 | 18,400 | 18.91  | 347,944.00    |

|                              |        |        |              |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| NETAPP INC                   | 2,900  | 51.76  | 150,104.00   |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 3,200  | 54.10  | 173,120.00   |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 3,040  | 61.95  | 188,328.00   |
| XEROX HOLDINGS CORP          | 2,500  | 29.85  | 74,625.00    |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 3,670  | 89.79  | 329,529.30   |
| ARROW ELECTRS INC            | 750    | 72.18  | 54,135.00    |
| CDW CORPORATION              | 1,940  | 118.47 | 229,831.80   |
| COGNEX CORP                  | 1,640  | 47.15  | 77,326.00    |
| CORNING INC                  | 10,100 | 28.58  | 288,658.00   |
| FLEX LTD                     | 4,700  | 10.38  | 48,786.00    |
| FLIR SYSTEMS INC             | 1,200  | 50.45  | 60,540.00    |
| IPG PHOTONICS CORP           | 360    | 134.37 | 48,373.20    |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC    | 2,300  | 99.30  | 228,390.00   |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 4,290  | 94.51  | 405,447.90   |
| TRIMBLE INC                  | 2,500  | 37.89  | 94,725.00    |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 530    | 205.85 | 109,100.50   |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 12,800 | 31.50  | 403,200.00   |
| ANALOG DEVICES INC           | 4,640  | 113.02 | 524,412.80   |
| APPLIED MATERIALS            | 11,500 | 50.35  | 579,025.00   |
| BROADCOM INC                 | 4,720  | 291.02 | 1,373,614.40 |
| INTEL CORP                   | 54,200 | 50.10  | 2,715,420.00 |
| KLA CORP                     | 2,100  | 151.00 | 317,100.00   |
| LAM RESEARCH                 | 1,900  | 226.74 | 430,806.00   |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 7,400  | 24.87  | 184,038.00   |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 2,800  | 56.65  | 158,620.00   |
| MICROCHIP TECHNOLOGY         | 2,660  | 88.83  | 236,287.80   |
| MICRON TECHNOLOGY            | 13,800 | 49.03  | 676,614.00   |
| NVIDIA CORP                  | 6,920  | 179.74 | 1,243,800.80 |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | 3,400  | 106.00 | 360,400.00   |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 3,900  | 18.33  | 71,487.00    |
| QORVO INC                    | 1,200  | 75.17  | 90,204.00    |
| QUALCOMM INC                 | 14,600 | 78.99  | 1,153,254.00 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 1,950  | 79.33  | 154,693.50   |
| TEXAS INSTRUMENTS INC        | 11,190 | 126.81 | 1,419,003.90 |
| XILINX INC                   | 3,270  | 105.30 | 344,331.00   |

|                             |        |        |              |
|-----------------------------|--------|--------|--------------|
| AT & T INC                  | 88,100 | 35.89  | 3,161,909.00 |
| CENTURYLINK INC             | 11,200 | 11.86  | 132,832.00   |
| VERIZON COMMUNICATIONS      | 50,000 | 58.59  | 2,929,500.00 |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC     | 3,500  | 33.76  | 118,160.00   |
| SPRINT CORP                 | 7,300  | 6.76   | 49,348.00    |
| T-MOBILE US INC             | 3,900  | 77.83  | 303,537.00   |
| ALLIANT ENERGY CORP         | 3,300  | 52.56  | 173,448.00   |
| AMERICAN ELECTRIC POWER     | 6,030  | 91.53  | 551,925.90   |
| DUKE ENERGY CORP            | 8,680  | 93.41  | 810,798.80   |
| EDISON INTERNATIONAL        | 4,500  | 71.31  | 320,895.00   |
| ENTERGY CORP                | 2,420  | 114.50 | 277,090.00   |
| EVERGY INC                  | 3,300  | 64.78  | 213,774.00   |
| EVERSOURCE ENERGY           | 4,000  | 82.03  | 328,120.00   |
| EXELON CORPORATION          | 11,900 | 48.12  | 572,628.00   |
| FIRSTENERGY CORP            | 6,800  | 46.52  | 316,336.00   |
| NEXTERA ENERGY INC          | 5,720  | 219.81 | 1,257,313.20 |
| OGE ENERGY CORP             | 2,700  | 43.00  | 116,100.00   |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP  | 1,150  | 94.31  | 108,456.50   |
| PPL CORPORATION             | 9,100  | 30.11  | 274,001.00   |
| SOUTHERN CO.                | 12,600 | 59.50  | 749,700.00   |
| XCEL ENERGY INC             | 6,500  | 65.15  | 423,475.00   |
| ATMOS ENERGY CORP           | 1,600  | 109.68 | 175,488.00   |
| UGI CORP                    | 2,500  | 48.07  | 120,175.00   |
| AMEREN CORPORATION          | 3,000  | 77.14  | 231,420.00   |
| CENTERPOINT ENERGY INC      | 6,100  | 27.99  | 170,739.00   |
| CMS ENERGY CORP             | 3,800  | 63.40  | 240,920.00   |
| CONSOLIDATED EDISON INC     | 3,800  | 90.88  | 345,344.00   |
| DOMINION ENERGY INC         | 9,500  | 77.43  | 735,585.00   |
| DTE ENERGY COMPANY          | 2,250  | 129.91 | 292,297.50   |
| NISOURCE INC                | 4,700  | 29.67  | 139,449.00   |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE       | 5,700  | 60.87  | 346,959.00   |
| SEMPRA ENERGY               | 3,370  | 141.83 | 477,967.10   |
| WEC ENERGY GROUP INC        | 3,600  | 95.33  | 343,188.00   |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 2,180  | 126.53 | 275,835.40   |
| ALLY FINANCIAL INC          | 4,000  | 32.53  | 130,120.00   |

|                               |        |        |              |
|-------------------------------|--------|--------|--------------|
| AMERICAN EXPRESS CO           | 8,700  | 120.67 | 1,049,829.00 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP    | 5,900  | 88.32  | 521,088.00   |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES   | 3,600  | 81.82  | 294,552.00   |
| SYNCHRONY FINANCIAL           | 6,800  | 33.28  | 226,304.00   |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP     | 600    | 78.74  | 47,244.00    |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC      | 1,680  | 133.41 | 224,128.80   |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP   | 9,700  | 42.82  | 415,354.00   |
| BLACKROCK INC                 | 1,430  | 424.72 | 607,349.60   |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC       | 1,240  | 119.21 | 147,820.40   |
| CME GROUP INC                 | 4,260  | 221.18 | 942,226.80   |
| E*TRADE FINANCIAL CORP        | 3,100  | 42.92  | 133,052.00   |
| EATON VANCE CORP              | 1,600  | 43.64  | 69,824.00    |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC  | 360    | 273.84 | 98,582.40    |
| FRANKLIN RESOURCES INC        | 3,400  | 27.03  | 91,902.00    |
| GOLDMAN SACHS GROUP           | 4,060  | 207.05 | 840,623.00   |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 6,850  | 94.73  | 648,900.50   |
| INVESCO LTD                   | 4,400  | 16.05  | 70,620.00    |
| KKR & CO INC-A                | 6,700  | 26.76  | 179,292.00   |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC      | 500    | 411.96 | 205,980.00   |
| MOODYS CORP                   | 2,110  | 219.58 | 463,313.80   |
| MORGAN STANLEY                | 15,700 | 42.47  | 666,779.00   |
| MSCI INC                      | 1,070  | 235.43 | 251,910.10   |
| NASDAQ INC                    | 1,430  | 102.02 | 145,888.60   |
| NORTHERN TRUST CORP           | 2,180  | 90.02  | 196,243.60   |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   | 1,300  | 79.95  | 103,935.00   |
| S&P GLOBAL INC                | 3,040  | 264.83 | 805,083.20   |
| SCHWAB(CHARLES)CORP           | 14,300 | 39.62  | 566,566.00   |
| SEI INVESTMENTS COMPANY       | 1,400  | 58.81  | 82,334.00    |
| STATE STREET CORP             | 4,500  | 52.47  | 236,115.00   |
| T ROWE PRICE GROUP INC        | 2,730  | 115.05 | 314,086.50   |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP    | 3,600  | 46.15  | 166,140.00   |
| H & R BLOCK INC               | 1,800  | 24.24  | 43,632.00    |
| AES CORP                      | 9,300  | 15.44  | 143,592.00   |
| NRG ENERGY INC                | 2,800  | 37.60  | 105,280.00   |
| VISTRA ENERGY CORP            | 4,600  | 25.68  | 118,128.00   |
|                               | 4,100  | 67.85  | 278,185.00   |

|                               |        |        |              |  |
|-------------------------------|--------|--------|--------------|--|
| CERNER CORP                   |        |        |              |  |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A     | 1,500  | 159.42 | 239,130.00   |  |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC      | 3,590  | 73.52  | 263,936.80   |  |
| ILLUMINA INC                  | 1,740  | 271.78 | 472,897.20   |  |
| IQVIA HOLDINGS INC            | 1,910  | 154.08 | 294,292.80   |  |
| METTLER-TOLEDO INTL           | 300    | 685.78 | 205,734.00   |  |
| PERKINELMER INC               | 1,010  | 83.71  | 84,547.10    |  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC  | 4,770  | 294.02 | 1,402,475.40 |  |
| WATERS CORP                   | 810    | 218.12 | 176,677.20   |  |
| COSTAR GROUP INC              | 460    | 613.19 | 282,067.40   |  |
| EQUIFAX INC                   | 1,600  | 146.78 | 234,848.00   |  |
| IHS MARKIT LTD                | 4,500  | 67.17  | 302,265.00   |  |
| MANPOWERGROUP INC             | 590    | 83.09  | 49,023.10    |  |
| NIELSEN HOLDINGS PLC          | 3,700  | 21.02  | 77,774.00    |  |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 1,430  | 54.17  | 77,463.10    |  |
| TRUNSON                       | 2,300  | 84.35  | 194,005.00   |  |
| VERISK ANALYTICS INC          | 1,720  | 163.54 | 281,288.80   |  |
| CBRE GROUP INC                | 4,000  | 53.15  | 212,600.00   |  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD    | 13,000 | 5.75   | 74,750.00    |  |
| JONES LANG LASALLE INC        | 470    | 136.84 | 64,314.80    |  |
| ALTICE USA INC-A              | 2,900  | 29.54  | 85,666.00    |  |
| CBS CORP-CL B                 | 3,700  | 43.00  | 159,100.00   |  |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A  | 1,940  | 422.05 | 818,777.00   |  |
| COMCAST CORP-CL A             | 54,800 | 46.41  | 2,543,268.00 |  |
| DISCOVERY INC - A             | 2,030  | 27.40  | 55,622.00    |  |
| DISCOVERY INC - C             | 5,000  | 25.77  | 128,850.00   |  |
| DISH NETWORK CORP-A           | 2,400  | 34.85  | 83,640.00    |  |
| FOX CORP-CLASS A              | 3,900  | 34.25  | 133,575.00   |  |
| FOX CORP-CLASS B              | 1,900  | 33.91  | 64,429.00    |  |
| INTERPUBLIC GROUP             | 3,600  | 20.44  | 73,584.00    |  |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C      | 1,340  | 107.73 | 144,358.20   |  |
| LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C  | 5,300  | 26.07  | 138,171.00   |  |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A          | 2,300  | 26.98  | 62,054.00    |  |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C        | 2,030  | 41.68  | 84,610.40    |  |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP        | 1,160  | 41.36  | 47,977.60    |  |
|                               | 4,300  | 14.00  | 60,200.00    |  |

|       |                                      |        |          |                  |  |
|-------|--------------------------------------|--------|----------|------------------|--|
|       | NEWS CORP/NEW-CL A-W/I               |        |          |                  |  |
|       | OMNICOM GROUP                        | 2,620  | 77.94    | 204,202.80       |  |
|       | SIRIUS XM HOLDINGS INC               | 17,000 | 6.28     | 106,760.00       |  |
|       | ACTIVISION BLIZZARD INC              | 9,600  | 54.58    | 523,968.00       |  |
|       | DISNEY (WALT) CO                     | 21,740 | 138.84   | 3,018,381.60     |  |
|       | ELECTRONIC ARTS                      | 3,730  | 97.45    | 363,488.50       |  |
|       | LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C         | 1,900  | 42.67    | 81,073.00        |  |
|       | LIVE NATION ENTERTAINMENT IN         | 1,400  | 70.98    | 99,372.00        |  |
|       | NETFLIX INC                          | 5,200  | 293.25   | 1,524,900.00     |  |
|       | TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE<br>INC | 1,380  | 131.35   | 181,263.00       |  |
|       | VIACOM INC-CLASS B                   | 3,600  | 25.68    | 92,448.00        |  |
|       | ALPHABET INC-CL A                    | 3,610  | 1,212.19 | 4,376,005.90     |  |
|       | ALPHABET INC-CL C                    | 3,777  | 1,211.38 | 4,575,382.26     |  |
|       | FACEBOOK INC-A                       | 28,930 | 190.90   | 5,522,737.00     |  |
|       | IAC/INTERACTIVE CORP                 | 950    | 244.89   | 232,645.50       |  |
|       | SNAP INC-A                           | 9,500  | 15.87    | 150,765.00       |  |
|       | TRIPADVISOR INC                      | 1,300  | 38.11    | 49,543.00        |  |
|       | TWITTER INC                          | 8,300  | 45.30    | 375,990.00       |  |
|       | ZILLOW GROUP INC - C                 | 1,120  | 31.99    | 35,828.80        |  |
|       | 小計 銘柄数：610                           |        |          | 303,039,038.63   |  |
|       |                                      |        |          | (32,446,389,866) |  |
|       | 組入時価比率：65.6%                         |        |          | 68.9%            |  |
| カナダドル | CAMECO CORP                          | 5,000  | 11.92    | 59,600.00        |  |
|       | CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD       | 14,700 | 32.19    | 473,193.00       |  |
|       | CENOVUS ENERGY INC                   | 14,000 | 12.09    | 169,260.00       |  |
|       | ENBRIDGE INC                         | 24,900 | 45.08    | 1,122,492.00     |  |
|       | ENCANA CORP                          | 14,000 | 6.08     | 85,120.00        |  |
|       | HUSKY ENERGY INC                     | 3,779  | 8.98     | 33,935.42        |  |
|       | IMPERIAL OIL                         | 2,900  | 33.35    | 96,715.00        |  |
|       | INTER PIPELINE LTD                   | 3,800  | 25.20    | 95,760.00        |  |
|       | KEYERA CORP                          | 2,020  | 33.00    | 66,660.00        |  |
|       | PEMBINA PIPELINE CORP                | 6,500  | 48.67    | 316,355.00       |  |
|       | PRAIRIESKY ROYALTY LTD               | 1,800  | 17.44    | 31,392.00        |  |
|       | SUNCOR ENERGY INC                    | 18,500 | 39.10    | 723,350.00       |  |
|       | TC ENERGY CORP                       | 11,100 | 67.93    | 754,023.00       |  |

|  |        |        |              |
|--|--------|--------|--------------|
| TOURMALINE OIL CORP                    | 2,800  | 13.40  | 37,520.00    |
| VERMILION ENERGY INC                   | 1,410  | 19.88  | 28,030.80    |
| METHANEX CORP                          | 970    | 45.41  | 44,047.70    |
| NUTRIEN LTD                            | 6,700  | 68.02  | 455,734.00   |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B              | 1,450  | 56.95  | 82,577.50    |
| AGNICO EAGLE MINES LTD                 | 3,200  | 81.18  | 259,776.00   |
| BARRICK GOLD                           | 21,700 | 24.36  | 528,612.00   |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD             | 7,800  | 9.30   | 72,540.00    |
| FRANCO-NEVADA CORP                     | 2,400  | 129.96 | 311,904.00   |
| KINROSS GOLD CORP                      | 10,000 | 6.73   | 67,300.00    |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD                 | 2,800  | 63.91  | 178,948.00   |
| LUNDIN MINING CORP                     | 8,000  | 6.63   | 53,040.00    |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B               | 6,100  | 23.46  | 143,106.00   |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP           | 6,000  | 39.73  | 238,380.00   |
| WEST FRASER TIMBER                     | 780    | 46.37  | 36,168.60    |
| BOMBARDIER B SHEARS                    | 19,500 | 1.80   | 35,100.00    |
| CAE INC                                | 3,800  | 33.75  | 128,250.00   |
| SNC-LAVALIN GROUP INC                  | 1,900  | 15.91  | 30,229.00    |
| WSP GLOBAL INC                         | 1,100  | 72.42  | 79,662.00    |
| AIR CANADA                             | 2,000  | 44.09  | 88,180.00    |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO               | 8,700  | 124.04 | 1,079,148.00 |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD           | 1,740  | 320.71 | 558,035.40   |
| MAGNA INTERNATIONAL INC                | 3,900  | 68.74  | 268,086.00   |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC                  | 2,700  | 49.58  | 133,866.00   |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL<br>INC | 2,700  | 99.32  | 268,164.00   |
| STARS GROUP INC/THE                    | 1,400  | 21.44  | 30,016.00    |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A               | 660    | 136.56 | 90,129.60    |
| DOLLARAMA INC                          | 3,120  | 50.95  | 158,964.00   |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B             | 5,300  | 83.32  | 441,596.00   |
| EMPIRE CO LTD A                        | 1,300  | 37.18  | 48,334.00    |
| LOBLAW COMPANIES                       | 2,400  | 74.25  | 178,200.00   |
| METRO INC                              | 3,400  | 57.64  | 195,976.00   |
| WESTON(GEORGE)LTD                      | 714    | 110.36 | 78,797.04    |
| SAPUTO INC                             | 3,100  | 40.34  | 125,054.00   |
| AURORA CANNABIS INC                    | 9,000  | 7.75   | 69,750.00    |

|                                       |        |          |              |
|---------------------------------------|--------|----------|--------------|
| BAUSCH HEALTH COS INC                 | 3,900  | 28.78    | 112,242.00   |
| CANOPY GROWTH CORP                    | 2,800  | 34.94    | 97,832.00    |
| CRONOS GROUP INC                      | 1,600  | 15.34    | 24,544.00    |
| BANK OF MONTREAL                      | 7,800  | 91.77    | 715,806.00   |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX           | 15,000 | 71.63    | 1,074,450.00 |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF<br>COMMERCE | 5,400  | 103.27   | 557,658.00   |
| NATIONAL BANK OF CANADA               | 4,400  | 63.51    | 279,444.00   |
| ROYAL BANK OF CANADA                  | 17,100 | 100.69   | 1,721,799.00 |
| TORONTO DOMINION BANK                 | 22,300 | 72.41    | 1,614,743.00 |
| ONEX CORPORATION                      | 900    | 79.37    | 71,433.00    |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD           | 330    | 591.89   | 195,323.70   |
| GREAT-WEST LIFE CO INC                | 3,800  | 28.75    | 109,250.00   |
| IA FINANCIAL CORP INC                 | 800    | 56.74    | 45,392.00    |
| INTACT FINANCIAL CORP                 | 1,460  | 129.39   | 188,909.40   |
| MANULIFE FINANCIAL CORP               | 22,900 | 22.64    | 518,456.00   |
| POWER CORPORATION OF CANADA           | 3,500  | 28.49    | 99,715.00    |
| POWER FINANCIAL CORP                  | 3,300  | 28.68    | 94,644.00    |
| SUN LIFE FINANCIAL INC                | 6,800  | 55.92    | 380,256.00   |
| CGI INC                               | 3,000  | 105.57   | 316,710.00   |
| SHOPIFY INC - CLASS A                 | 1,220  | 519.51   | 633,802.20   |
| BLACKBERRY LTD                        | 4,500  | 9.66     | 43,470.00    |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC            | 236    | 1,320.03 | 311,527.08   |
| OPEN TEXT CORP                        | 3,100  | 54.94    | 170,314.00   |
| BCE INC                               | 2,200  | 63.30    | 139,260.00   |
| TELUS CORP                            | 2,600  | 48.60    | 126,360.00   |
| ROGERS COMMUNICATIONS-CL B            | 4,200  | 65.21    | 273,882.00   |
| EMERA INC                             | 3,300  | 57.17    | 188,661.00   |
| FORTIS INC                            | 5,000  | 55.65    | 278,250.00   |
| HYDRO ONE LTD                         | 3,100  | 24.73    | 76,663.00    |
| ALTAGAS LTD                           | 3,600  | 18.52    | 66,672.00    |
| ATCO LTD CL1                          | 900    | 47.26    | 42,534.00    |
| CANADIAN UTILITIES LTD A              | 1,090  | 38.72    | 42,204.80    |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A          | 10,200 | 70.30    | 717,060.00   |
| CI FINANCIAL CORP                     | 3,700  | 19.15    | 70,855.00    |
|                                       | 600    | 37.15    | 22,290.00    |

|     |                             |        |        |                 |  |
|-----|-----------------------------|--------|--------|-----------------|--|
|     | IGM FINANCIAL INC           |        |        |                 |  |
|     | THOMSON REUTERS CORP        | 2,451  | 93.55  | 229,291.05      |  |
|     | FIRST CAPITAL REALTY INC    | 1,100  | 22.27  | 24,497.00       |  |
|     | QUEBECOR INC-CL B           | 1,400  | 30.14  | 42,196.00       |  |
|     | SHAW COMMUNICATIONS INC-B   | 6,100  | 26.10  | 159,210.00      |  |
| 小計  | 銘柄数：87                      |        |        | 22,528,683.29   |  |
|     |                             |        |        | (1,823,021,051) |  |
|     | 組入時価比率：3.7%                 |        |        | 3.9%            |  |
| ユーロ | TENARIS SA                  | 5,400  | 10.04  | 54,216.00       |  |
|     | ENI SPA                     | 31,400 | 13.86  | 435,455.20      |  |
|     | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 5,800  | 13.28  | 77,024.00       |  |
|     | NESTE OYJ                   | 5,500  | 28.73  | 158,015.00      |  |
|     | OMV AG                      | 1,600  | 46.82  | 74,912.00       |  |
|     | REPSOL SA                   | 18,228 | 13.77  | 251,090.70      |  |
|     | TOTAL SA                    | 28,500 | 46.22  | 1,317,412.50    |  |
|     | VOPAK                       | 700    | 43.55  | 30,485.00       |  |
|     | AIR LIQUIDE                 | 5,200  | 124.30 | 646,360.00      |  |
|     | AKZO NOBEL                  | 2,737  | 81.62  | 223,393.94      |  |
|     | ARKEMA                      | 850    | 81.98  | 69,683.00       |  |
|     | BASF SE                     | 11,300 | 61.01  | 689,413.00      |  |
|     | COVESTRO AG                 | 2,240  | 41.47  | 92,892.80       |  |
|     | EVONIK INDUSTRIES AG        | 1,800  | 23.41  | 42,138.00       |  |
|     | FUCHS PETROLUB SE -PFD      | 740    | 32.48  | 24,035.20       |  |
|     | KONINKLIJKE DSM NV          | 2,200  | 115.50 | 254,100.00      |  |
|     | LANXESS                     | 970    | 55.22  | 53,563.40       |  |
|     | SOLVAY SA                   | 920    | 93.08  | 85,633.60       |  |
|     | SYMRISE AG                  | 1,530  | 85.44  | 130,723.20      |  |
|     | UMICORE                     | 2,400  | 31.00  | 74,400.00       |  |
|     | CRH PLC                     | 10,000 | 30.63  | 306,300.00      |  |
|     | HEIDELBERGCEMENT AG         | 1,470  | 64.24  | 94,432.80       |  |
|     | IMERYS                      | 450    | 36.58  | 16,461.00       |  |
|     | SMURFIT KAPPA GROUP PLC     | 2,500  | 28.04  | 70,100.00       |  |
|     | ARCELORMITTAL               | 8,000  | 13.86  | 110,896.00      |  |
|     | THYSSENKRUPP AG             | 4,800  | 11.68  | 56,064.00       |  |
|     | VOESTALPINE AG              | 1,400  | 21.38  | 29,932.00       |  |
|     | STORA ENSO OYJ-R            | 6,100  | 10.58  | 64,568.50       |  |

|                                       |        |          |            |
|---------------------------------------|--------|----------|------------|
| UPM-KYMMENE OYJ                       | 6,200  | 24.83    | 153,946.00 |
| AIRBUS SE                             | 7,000  | 127.32   | 891,240.00 |
| DASSAULT AVIATION SA                  | 26     | 1,400.00 | 36,400.00  |
| LEONARDO SPA                          | 4,200  | 11.22    | 47,124.00  |
| MTU AERO ENGINES AG                   | 700    | 246.00   | 172,200.00 |
| SAFRAN SA                             | 4,070  | 138.00   | 561,660.00 |
| THALES SA                             | 1,360  | 109.95   | 149,532.00 |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)            | 5,500  | 33.40    | 183,700.00 |
| KINGSPAN GROUP PLC                    | 1,700  | 42.22    | 71,774.00  |
| ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV           | 3,292  | 34.86    | 114,759.12 |
| BOUYGUES                              | 2,130  | 33.42    | 71,184.60  |
| EIFFAGE SA                            | 930    | 94.26    | 87,661.80  |
| FERROVIAL SA                          | 6,300  | 26.10    | 164,430.00 |
| HOCHTIEF AG                           | 160    | 99.55    | 15,928.00  |
| VINCI                                 | 6,000  | 100.90   | 605,400.00 |
| LEGRAND SA                            | 3,500  | 65.52    | 229,320.00 |
| PRYSMIAN SPA                          | 2,800  | 20.18    | 56,504.00  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE                 | 6,500  | 76.14    | 494,910.00 |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY<br>SA | 1,800  | 12.55    | 22,590.00  |
| SIEMENS AG                            | 9,380  | 91.55    | 858,739.00 |
| ALSTOM                                | 2,100  | 39.06    | 82,026.00  |
| ANDRITZ AG                            | 700    | 33.76    | 23,632.00  |
| CNH INDUSTRIAL NV                     | 13,400 | 9.50     | 127,353.60 |
| GEA GROUP AG                          | 1,700  | 24.83    | 42,211.00  |
| KION GROUP AG                         | 970    | 45.76    | 44,387.20  |
| KNORR-BREMSE AG                       | 490    | 84.72    | 41,512.80  |
| KONE OYJ                              | 4,100  | 54.16    | 222,056.00 |
| METSO OYJ                             | 1,600  | 35.32    | 56,512.00  |
| WARTSILA OYJ                          | 4,800  | 11.16    | 53,568.00  |
| BRENNTAG AG                           | 1,900  | 45.21    | 85,899.00  |
| EDENRED                               | 2,900  | 44.46    | 128,934.00 |
| SOCIETE BIC SA                        | 300    | 58.35    | 17,505.00  |
| BOLLORE                               | 7,500  | 3.87     | 29,070.00  |
| DEUTSCHE POST AG-REG                  | 12,200 | 30.38    | 370,697.00 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG                | 3,000  | 14.13    | 42,405.00  |

|  |        |        |              |
|--|--------|--------|--------------|
| ADP                                    | 290    | 161.50 | 46,835.00    |
| AENA SME SA                            | 690    | 167.10 | 115,299.00   |
| ATLANTIA SPA                           | 5,300  | 24.30  | 128,790.00   |
| FRAPORT AG                             | 380    | 77.12  | 29,305.60    |
| GETLINK                                | 6,300  | 13.17  | 82,971.00    |
| CONTINENTAL AG                         | 1,380  | 116.96 | 161,404.80   |
| FAURECIA                               | 750    | 44.71  | 33,532.50    |
| MICHELIN (CGDE)                        | 1,990  | 99.94  | 198,880.60   |
| NOKIAN RENKAAT OYJ                     | 1,800  | 25.38  | 45,684.00    |
| PIRELLI & C. SPA                       | 3,500  | 5.09   | 17,836.00    |
| VALEO SA                               | 2,400  | 28.66  | 68,784.00    |
| BAYER MOTOREN WERK                     | 4,260  | 62.32  | 265,483.20   |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD           | 760    | 51.40  | 39,064.00    |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES           | 10,700 | 45.35  | 485,245.00   |
| FERRARI NV                             | 1,440  | 146.80 | 211,392.00   |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV           | 13,400 | 12.57  | 168,545.20   |
| PEUGEOT CITROEN                        | 6,900  | 21.46  | 148,074.00   |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE           | 1,600  | 60.12  | 96,192.00    |
| RENAULT SA                             | 2,020  | 55.45  | 112,009.00   |
| VOLKSWAGEN AG                          | 370    | 153.75 | 56,887.50    |
| VOLKSWAGEN AG-PREF                     | 2,290  | 150.84 | 345,423.60   |
| SEB SA                                 | 260    | 148.30 | 38,558.00    |
| ADIDAS AG                              | 2,180  | 274.80 | 599,064.00   |
| ESSILORLUXOTTICA                       | 3,334  | 134.80 | 449,423.20   |
| HERMES INTERNATIONAL                   | 390    | 646.00 | 251,940.00   |
| HUGO BOSS AG                           | 720    | 51.08  | 36,777.60    |
| KERING SA                              | 950    | 455.40 | 432,630.00   |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON<br>SE | 3,390  | 376.40 | 1,275,996.00 |
| MONCLER SPA                            | 1,700  | 35.86  | 60,962.00    |
| PUMA SE                                | 1,200  | 68.70  | 82,440.00    |
| ACCOR SA                               | 2,100  | 40.03  | 84,063.00    |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC              | 890    | 78.72  | 70,060.80    |
| SODEXO                                 | 1,110  | 104.15 | 115,606.50   |
| DELIVERY HERO SE                       | 1,700  | 45.58  | 77,486.00    |
| ZALANDO SE                             | 1,800  | 46.44  | 83,592.00    |

|                               |        |        |              |
|-------------------------------|--------|--------|--------------|
| INDITEX SA                    | 13,400 | 28.54  | 382,436.00   |
| CARREFOUR SUPERMARCHE         | 7,600  | 16.07  | 122,132.00   |
| CASINO GUICHARD-PERRACHON SA  | 700    | 41.64  | 29,148.00    |
| COLRUYT SA                    | 900    | 47.78  | 43,002.00    |
| JERONIMO MARTINS              | 3,400  | 15.90  | 54,077.00    |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 14,300 | 21.62  | 309,237.50   |
| METRO AG                      | 1,700  | 14.10  | 23,978.50    |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV    | 9,100  | 84.95  | 773,045.00   |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA     | 5,500  | 8.65   | 47,602.50    |
| HEINEKEN HOLDING NV           | 1,290  | 91.00  | 117,390.00   |
| HEINEKEN NV                   | 3,140  | 98.14  | 308,159.60   |
| PERNOD RICARD SA              | 2,450  | 174.60 | 427,770.00   |
| REMY COINTREAU                | 140    | 138.80 | 19,432.00    |
| DANONE                        | 7,490  | 81.80  | 612,682.00   |
| KERRY GROUP PLC-A             | 1,980  | 109.40 | 216,612.00   |
| HENKEL AG & CO KGAA           | 1,450  | 85.10  | 123,395.00   |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG    | 2,220  | 92.98  | 206,415.60   |
| BEIERSDORF AG                 | 1,280  | 114.45 | 146,496.00   |
| LOREAL-ORD                    | 3,100  | 250.70 | 777,170.00   |
| UNILEVER NV                   | 17,800 | 56.89  | 1,012,642.00 |
| BIOMERIEUX                    | 420    | 69.75  | 29,295.00    |
| CARL ZEISS MEDITEC AG-BR      | 390    | 106.40 | 41,496.00    |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV        | 11,100 | 42.96  | 476,911.50   |
| SARTORIUS AG-VORZUG           | 320    | 178.50 | 57,120.00    |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG       | 1,600  | 35.41  | 56,664.00    |
| FRESENIUS MEDICAL CARE        | 2,300  | 61.44  | 141,312.00   |
| FRESENIUS SE & CO KGAA        | 5,200  | 44.62  | 232,024.00   |
| GRIFOLS SA                    | 3,600  | 28.10  | 101,160.00   |
| BAYER AG-REG                  | 11,500 | 66.50  | 764,750.00   |
| IPSEN                         | 520    | 93.25  | 48,490.00    |
| MERCK KGAA                    | 1,670  | 97.28  | 162,457.60   |
| ORION OYJ                     | 1,000  | 33.98  | 33,980.00    |
| RECORDATI SPA                 | 1,100  | 39.94  | 43,934.00    |
| SANOFI                        | 13,500 | 81.19  | 1,096,065.00 |
| UCB SA                        | 1,800  | 67.32  | 121,176.00   |

|                                      |         |        |              |
|--------------------------------------|---------|--------|--------------|
| ABN AMRO BANK NV-CVA                 | 4,400   | 16.58  | 72,974.00    |
| AIB GROUP PLC                        | 8,000   | 2.46   | 19,680.00    |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A. | 75,000  | 4.49   | 337,200.00   |
| BANCO DE SABADELL SA                 | 70,000  | 0.81   | 56,742.00    |
| BANCO SANTANDER SA                   | 207,000 | 3.52   | 730,089.00   |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC            | 11,500  | 3.84   | 44,160.00    |
| BANKIA SA                            | 12,250  | 1.70   | 20,837.25    |
| BANKINTER S.A.                       | 8,200   | 5.54   | 45,428.00    |
| BNP PARIBAS                          | 13,900  | 42.46  | 590,194.00   |
| CAIXABANK                            | 41,000  | 2.16   | 88,560.00    |
| COMMERZBANK AG                       | 11,400  | 5.46   | 62,278.20    |
| CREDIT AGRICOLE SA                   | 14,400  | 10.67  | 153,648.00   |
| ERSTE GROUP BANK AG                  | 3,700   | 29.62  | 109,594.00   |
| FINECOBANK BANCA FINECO SPA          | 9,100   | 9.83   | 89,525.80    |
| ING GROEP NV                         | 45,800  | 9.03   | 413,757.20   |
| INTESA SANPAOLO                      | 185,000 | 2.05   | 380,360.00   |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD       | 13,429  | 0.00   | 0.00         |
| KBC GROEP NV                         | 2,750   | 54.98  | 151,195.00   |
| MEDIOBANCA S.P.A.                    | 8,600   | 9.44   | 81,218.40    |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG     | 1,500   | 20.04  | 30,060.00    |
| SOCIETE GENERALE                     | 9,900   | 24.17  | 239,332.50   |
| UNICREDIT SPA                        | 24,400  | 10.69  | 260,836.00   |
| EURAZEO SE                           | 350     | 61.40  | 21,490.00    |
| EXOR NV                              | 1,300   | 63.94  | 83,122.00    |
| GROUPE BRUXELLES LAM                 | 940     | 86.18  | 81,009.20    |
| WENDEL                               | 260     | 127.10 | 33,046.00    |
| AEGON NV                             | 18,000  | 3.57   | 64,314.00    |
| AGEAS                                | 1,800   | 50.06  | 90,108.00    |
| ALLIANZ SE-REG                       | 5,060   | 203.05 | 1,027,433.00 |
| ASSICURAZIONI GENERALI               | 12,300  | 17.04  | 209,653.50   |
| AXA                                  | 22,900  | 21.40  | 490,174.50   |
| CNP ASSURANCES                       | 1,640   | 17.02  | 27,912.80    |
| HANNOVER RUECK SE                    | 840     | 148.70 | 124,908.00   |
| MAPFRE SA                            | 12,700  | 2.44   | 30,988.00    |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG           | 1,730   | 222.20 | 384,406.00   |

|                                   |         |        |              |
|-----------------------------------|---------|--------|--------------|
| NN GROUP NV                       | 3,700   | 30.98  | 114,626.00   |
| POSTE ITALIANE SPA                | 7,300   | 10.05  | 73,365.00    |
| SAMPO OYJ-A SHS                   | 5,600   | 36.74  | 205,744.00   |
| SCOR SE                           | 2,200   | 36.57  | 80,454.00    |
| ADYEN NV                          | 110     | 662.80 | 72,908.00    |
| AMADEUS IT GROUP SA               | 5,000   | 68.08  | 340,400.00   |
| ATOS SE                           | 890     | 70.08  | 62,371.20    |
| CAPGEMINI SA                      | 1,980   | 113.70 | 225,126.00   |
| WIRECARD AG                       | 1,350   | 157.50 | 212,625.00   |
| WORLDLINE SA                      | 1,200   | 62.60  | 75,120.00    |
| DASSAULT SYSTEMES SA              | 1,410   | 128.85 | 181,678.50   |
| SAP SE                            | 11,690  | 111.48 | 1,303,201.20 |
| NOKIA OYJ                         | 67,000  | 4.48   | 300,763.00   |
| INGENICO GROUP                    | 690     | 89.70  | 61,893.00    |
| ASML HOLDING NV                   | 5,200   | 215.10 | 1,118,520.00 |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG          | 15,700  | 16.97  | 266,491.80   |
| STMICROELECTRONICS NV             | 8,000   | 17.32  | 138,600.00   |
| CELLNEX TELECOM SA                | 2,600   | 37.25  | 96,850.00    |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG              | 39,300  | 15.08  | 592,644.00   |
| ELISA OYJ                         | 1,600   | 45.73  | 73,168.00    |
| ILIAD SA                          | 310     | 84.00  | 26,040.00    |
| KONINKLIJKE KPN NV                | 39,000  | 2.89   | 112,788.00   |
| ORANGE SA                         | 24,300  | 13.71  | 333,153.00   |
| PROXIMUS                          | 1,550   | 26.41  | 40,935.50    |
| TELECOM ITALIA SPA                | 112,000 | 0.49   | 55,081.60    |
| TELECOM ITALIA-RNC                | 68,000  | 0.47   | 31,966.80    |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 5,000   | 2.33   | 11,675.00    |
| TELEFONICA SA                     | 59,000  | 6.50   | 383,913.00   |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE      | 1,500   | 30.53  | 45,795.00    |
| 1&1 DRILLISCH AG                  | 570     | 25.68  | 14,637.60    |
| ELECTRICITE DE FRANCE             | 7,400   | 11.19  | 82,843.00    |
| ENDESA S.A.                       | 3,500   | 23.71  | 82,985.00    |
| ENEL SPA                          | 98,000  | 6.66   | 653,170.00   |
| ENERGIAS DE PORTUGAL              | 30,000  | 3.54   | 106,410.00   |
| FORTUM OYJ                        | 4,900   | 20.80  | 101,920.00   |

|                              |        |        |            |
|------------------------------|--------|--------|------------|
| IBERDROLA SA                 | 72,100 | 9.43   | 680,479.80 |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 4,200  | 18.31  | 76,902.00  |
| TERNA SPA                    | 18,000 | 5.79   | 104,292.00 |
| VERBUND AG                   | 1,100  | 54.15  | 59,565.00  |
| ENAGAS SA                    | 2,900  | 20.30  | 58,870.00  |
| NATURGY ENERGY GROUP SA      | 4,200  | 23.75  | 99,750.00  |
| SNAM SPA                     | 23,000 | 4.63   | 106,628.00 |
| E.ON SE                      | 24,800 | 8.52   | 211,395.20 |
| ENGIE                        | 22,800 | 13.75  | 313,614.00 |
| INNOGY SE                    | 1,600  | 45.36  | 72,576.00  |
| RWE AG                       | 6,300  | 26.47  | 166,761.00 |
| SUEZ                         | 3,600  | 14.20  | 51,120.00  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 7,000  | 22.43  | 157,010.00 |
| AMUNDI SA                    | 600    | 59.60  | 35,760.00  |
| DEUTSCHE BANK AG-REG         | 25,400 | 7.08   | 180,035.20 |
| DEUTSCHE BOERSE AG           | 2,350  | 136.25 | 320,187.50 |
| NATIXIS                      | 11,000 | 3.59   | 39,567.00  |
| UNIPER SE                    | 2,100  | 28.68  | 60,228.00  |
| EUROFINS SCIENTIFIC SE       | 130    | 419.80 | 54,574.00  |
| QIAGEN NV                    | 2,176  | 30.93  | 67,303.68  |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH     | 220    | 138.30 | 30,426.00  |
| BUREAU VERITAS SA            | 3,100  | 22.14  | 68,634.00  |
| RANDSTAD NV                  | 1,500  | 43.85  | 65,775.00  |
| TELEPERFORMANCE              | 790    | 199.20 | 157,368.00 |
| WOLTERS KLUWER               | 3,700  | 66.06  | 244,422.00 |
| AROUNDTOWN SA                | 11,600 | 7.20   | 83,520.00  |
| DEUTSCHE WOHNEN SE           | 4,200  | 31.56  | 132,552.00 |
| VONOVIA SE                   | 5,700  | 43.31  | 246,867.00 |
| AXEL SPRINGER SE-TEND        | 360    | 62.50  | 22,500.00  |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS      | 2,200  | 16.49  | 36,289.00  |
| JC DECAUX SA                 | 750    | 24.58  | 18,435.00  |
| PUBLICIS GROUPE              | 2,700  | 43.55  | 117,585.00 |
| RTL GROUP                    | 310    | 42.74  | 13,249.40  |
| SES FDR                      | 3,900  | 13.98  | 54,541.50  |
| TELENET GROUP HOLDING NV     | 690    | 43.76  | 30,194.40  |

|      |                              |         |       |                 |  |
|------|------------------------------|---------|-------|-----------------|--|
|      | UBISOFT ENTERTAINMENT        | 920     | 73.26 | 67,399.20       |  |
|      | VIVENDI SA                   | 11,300  | 25.25 | 285,325.00      |  |
| 小計   | 銘柄数：240                      |         |       | 46,484,164.29   |  |
|      |                              |         |       | (5,487,920,436) |  |
|      | 組入時価比率：11.1%                 |         |       | 11.6%           |  |
| 英ポンド | WOOD GROUP (JOHN) PLC        | 6,500   | 3.90  | 25,350.00       |  |
|      | BP PLC                       | 242,000 | 5.07  | 1,226,940.00    |  |
|      | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  | 52,900  | 22.84 | 1,208,500.50    |  |
|      | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B      | 45,700  | 22.79 | 1,041,503.00    |  |
|      | CRODA INTERNATIONAL PLC      | 1,464   | 46.94 | 68,720.16       |  |
|      | JOHNSON MATTHEY PLC          | 2,600   | 31.05 | 80,730.00       |  |
|      | ANGLO AMERICAN PLC           | 13,000  | 18.36 | 238,680.00      |  |
|      | ANTOFAGASTA PLC              | 5,400   | 8.88  | 47,952.00       |  |
|      | BHP GROUP PLC                | 25,100  | 17.50 | 439,400.60      |  |
|      | EVRAZ PLC                    | 4,000   | 5.02  | 20,088.00       |  |
|      | FRESNILLO PLC                | 2,700   | 7.23  | 19,521.00       |  |
|      | GLENCORE PLC                 | 139,000 | 2.39  | 332,905.00      |  |
|      | RIO TINTO PLC-REG            | 13,900  | 42.20 | 586,649.50      |  |
|      | MONDI PLC                    | 5,400   | 16.01 | 86,454.00       |  |
|      | BAE SYSTEMS PLC              | 41,000  | 5.63  | 230,994.00      |  |
|      | MEGGITT PLC                  | 11,000  | 6.30  | 69,300.00       |  |
|      | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     | 19,000  | 7.76  | 147,478.00      |  |
|      | MELROSE INDUSTRIES PLC       | 56,000  | 2.01  | 113,008.00      |  |
|      | DCC PLC                      | 1,360   | 71.52 | 97,267.20       |  |
|      | SMITHS GROUP PLC             | 4,700   | 16.87 | 79,289.00       |  |
|      | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 720     | 80.60 | 58,032.00       |  |
|      | WEIR GROUP PLC               | 2,800   | 14.86 | 41,608.00       |  |
|      | ASHTREAD GROUP PLC           | 5,900   | 23.01 | 135,759.00      |  |
|      | BUNZLE                       | 4,400   | 20.73 | 91,212.00       |  |
|      | FERGUSON PLC                 | 2,548   | 64.16 | 163,479.68      |  |
|      | G4S PLC                      | 16,100  | 1.75  | 28,207.20       |  |
|      | RENTOKIL INTIAL PLC          | 26,000  | 4.57  | 118,924.00      |  |
|      | EASYJET PLC                  | 1,900   | 9.40  | 17,867.60       |  |
|      | BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 10,500  | 6.07  | 63,756.00       |  |
|      | PERSIMMON PLC                | 4,200   | 19.14 | 80,409.00       |  |

|                                      |         |       |              |
|--------------------------------------|---------|-------|--------------|
| TAYLOR WIMPEY PLC                    | 34,300  | 1.51  | 52,050.25    |
| THE BERKELEY GRP HOLDINGS            | 1,400   | 38.73 | 54,222.00    |
| BURBERRY GROUP PLC                   | 4,800   | 22.60 | 108,480.00   |
| CARNIVAL PLC                         | 1,700   | 34.73 | 59,041.00    |
| COMPASS GROUP PLC                    | 19,200  | 20.80 | 399,360.00   |
| GVC HOLDINGS PLC                     | 5,800   | 6.82  | 39,579.20    |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP<br>PLC | 2,300   | 50.80 | 116,840.00   |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI         | 6,200   | 4.51  | 27,999.20    |
| TUI AG-DI                            | 5,400   | 8.52  | 46,029.60    |
| WHITBREAD PLC                        | 1,600   | 44.69 | 71,504.00    |
| OCADO GROUP PLC                      | 4,300   | 13.31 | 57,254.50    |
| MARKS & SPENCER PLC                  | 20,640  | 1.96  | 40,557.60    |
| NEXT PLC                             | 1,800   | 61.44 | 110,592.00   |
| KINGFISHER PLC                       | 25,000  | 1.98  | 49,712.50    |
| MORRISON SUPERMARKETS                | 20,000  | 1.86  | 37,240.00    |
| SAINSBURY                            | 18,000  | 2.00  | 36,144.00    |
| TESCO PLC                            | 123,000 | 2.29  | 282,039.00   |
| COCA-COLA HBC AG-DI                  | 1,900   | 28.20 | 53,580.00    |
| DIAGEO PLC                           | 28,400  | 34.89 | 990,876.00   |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC         | 4,700   | 23.70 | 111,390.00   |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC         | 28,100  | 29.10 | 817,710.00   |
| IMPERIAL BRANDS PLC                  | 12,000  | 21.42 | 257,100.00   |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC          | 8,600   | 64.03 | 550,658.00   |
| UNILEVER PLC                         | 13,200  | 51.79 | 683,628.00   |
| SMITH & NEPHEW PLC                   | 11,100  | 19.45 | 215,895.00   |
| NMC HEALTH PLC                       | 800     | 27.59 | 22,072.00    |
| ASTRAZENECA PLC                      | 15,620  | 71.91 | 1,123,234.20 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC                  | 59,500  | 17.01 | 1,012,571.00 |
| BARCLAYS PLC                         | 209,000 | 1.39  | 292,223.80   |
| HSBC HOLDINGS PLC                    | 245,000 | 5.98  | 1,467,060.00 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC             | 820,000 | 0.50  | 410,246.00   |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP         | 57,000  | 1.90  | 108,556.50   |
| STANDARD CHARTERED PLC               | 34,900  | 6.45  | 225,384.20   |
| ADMIRAL GROUP PLC                    | 2,900   | 20.67 | 59,943.00    |
| AVIVA PLC                            | 44,100  | 3.64  | 160,700.40   |

|        |                                 |         |          |                 |  |
|--------|---------------------------------|---------|----------|-----------------|--|
|        | DIRECT LINE INSURANCE GROUP     | 12,000  | 2.84     | 34,116.00       |  |
|        | LEGAL & GENERAL                 | 78,000  | 2.32     | 181,116.00      |  |
|        | PRUDENTIAL PLC                  | 31,200  | 14.23    | 443,976.00      |  |
|        | RSA INSURANCE GROUP PLC         | 12,100  | 5.22     | 63,258.80       |  |
|        | MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC   | 3,235   | 10.85    | 35,099.75       |  |
|        | SAGE GROUP PLC (THE)            | 13,500  | 7.07     | 95,526.00       |  |
|        | HALMA PLC                       | 3,800   | 19.99    | 75,981.00       |  |
|        | BT GROUP PLC                    | 99,000  | 1.67     | 166,042.80      |  |
|        | VODAFONE GROUP PLC              | 315,000 | 1.53     | 484,218.00      |  |
|        | SSE PLC                         | 13,700  | 11.68    | 160,084.50      |  |
|        | CENTRICA PLC                    | 55,000  | 0.69     | 38,005.00       |  |
|        | NATIONAL GRID PLC               | 41,500  | 8.45     | 350,799.50      |  |
|        | SEVERN TRENT PLC                | 2,700   | 20.62    | 55,674.00       |  |
|        | UNITED UTILITIES GROUP PLC      | 7,300   | 8.07     | 58,969.40       |  |
|        | 3I GROUP PLC                    | 12,400  | 11.53    | 142,972.00      |  |
|        | HARGREAVES LANSDOWN PLC         | 3,600   | 19.50    | 70,218.00       |  |
|        | INVESTEC PLC                    | 6,200   | 4.37     | 27,118.80       |  |
|        | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 3,600   | 72.08    | 259,488.00      |  |
|        | SCHRODERS PLC                   | 1,100   | 28.33    | 31,163.00       |  |
|        | ST JAMES S PLACE PLC            | 6,200   | 9.71     | 60,239.20       |  |
|        | STANDARD LIFE ABERDEEN PLC      | 23,447  | 2.50     | 58,734.73       |  |
|        | EXPERIAN PLC                    | 10,400  | 25.86    | 268,944.00      |  |
|        | INTERTEK GROUP PLC              | 2,200   | 55.54    | 122,188.00      |  |
|        | RELX PLC                        | 22,900  | 19.40    | 444,260.00      |  |
|        | INFORMA PLC                     | 17,000  | 8.48     | 144,228.00      |  |
|        | ITV PLC                         | 41,000  | 1.21     | 49,692.00       |  |
|        | PEARSON                         | 8,800   | 8.45     | 74,430.40       |  |
|        | WPP PLC                         | 17,000  | 9.71     | 165,138.00      |  |
|        | AUTO TRADER GROUP PLC           | 13,000  | 5.16     | 67,132.00       |  |
| 小計     | 銘柄数：94                          |         |          | 21,340,270.27   |  |
|        |                                 |         |          | (2,815,421,856) |  |
|        | 組入時価比率：5.7%                     |         |          | 6.0%            |  |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG                 | 2,200   | 18.77    | 41,305.00       |  |
|        | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG       | 70      | 586.00   | 41,020.00       |  |
|        | GIVAUDAN-REG                    | 114     | 2,700.00 | 307,800.00      |  |
|        |                                 | 1,530   | 143.75   | 219,937.50      |  |

|                                  |        |           |              |  |
|----------------------------------|--------|-----------|--------------|--|
| SIKA AG-REG                      |        |           |              |  |
| LAFARGEHOLCIM LTD                | 5,700  | 47.02     | 268,014.00   |  |
| GEBERIT AG-REG                   | 490    | 456.00    | 223,440.00   |  |
| ABB LTD                          | 22,100 | 19.06     | 421,336.50   |  |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG         | 320    | 225.60    | 72,192.00    |  |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT      | 580    | 227.70    | 132,066.00   |  |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG       | 630    | 147.20    | 92,736.00    |  |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A    | 6,500  | 77.88     | 506,220.00   |  |
| THE SWATCH GROUP AG-B            | 340    | 275.40    | 93,636.00    |  |
| THE SWATCH GROUP AG-REG          | 550    | 51.85     | 28,517.50    |  |
| DUFREY AG-REG                    | 280    | 81.78     | 22,898.40    |  |
| BARRY CALLEBAUT AG               | 22     | 2,004.00  | 44,088.00    |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC       | 14     | 7,205.00  | 100,870.00   |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG      | 1      | 80,400.00 | 80,400.00    |  |
| NESTLE SA-REG                    | 36,910 | 111.90    | 4,130,229.00 |  |
| ALCON INC                        | 4,922  | 59.50     | 292,859.00   |  |
| SONOVA HOLDING AG-REG            | 690    | 225.00    | 155,250.00   |  |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG         | 100    | 818.60    | 81,860.00    |  |
| NOVARTIS AG-REG                  | 25,980 | 88.18     | 2,290,916.40 |  |
| ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)     | 8,500  | 271.05    | 2,303,925.00 |  |
| VIFOR PHARMA AG                  | 590    | 157.55    | 92,954.50    |  |
| PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES | 280    | 73.90     | 20,692.00    |  |
| BALOISE HOLDING AG               | 580    | 168.00    | 97,440.00    |  |
| SWISS LIFE HOLDING AG            | 390    | 479.60    | 187,044.00   |  |
| SWISS RE LTD                     | 3,470  | 99.30     | 344,571.00   |  |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG        | 1,810  | 365.10    | 660,831.00   |  |
| TEMENOS AG-REG                   | 770    | 173.85    | 133,864.50   |  |
| SWISSCOM AG-REG                  | 340    | 490.00    | 166,600.00   |  |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG       | 32,300 | 12.08     | 390,184.00   |  |
| JULIUS BAER GROUP LTD            | 2,500  | 40.92     | 102,300.00   |  |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG        | 240    | 812.80    | 195,072.00   |  |
| UBS GROUP AG                     | 45,500 | 10.65     | 484,802.50   |  |
| LONZA AG-REG                     | 840    | 353.10    | 296,604.00   |  |
| ADECCO GROUP AG-REG              | 1,910  | 54.10     | 103,331.00   |  |
| SGS SA-REG                       | 57     | 2,473.00  | 140,961.00   |  |

|                |                                  |        |        |                 |  |
|----------------|----------------------------------|--------|--------|-----------------|--|
|                | SWISS PRIME SITE-REG             | 786    | 97.75  | 76,831.50       |  |
| 小計             | 銘柄数：39                           |        |        | 15,445,599.30   |  |
|                |                                  |        |        | (1,675,538,612) |  |
|                | 組入時価比率：3.4%                      |        |        | 3.6%            |  |
| スウェーデンク<br>ローナ | LUNDIN PETROLEUM AB              | 2,500  | 309.00 | 772,500.00      |  |
|                | BOLIDEN AB                       | 2,600  | 228.75 | 594,750.00      |  |
|                | ASSA ABLOY AB-B                  | 12,300 | 210.70 | 2,591,610.00    |  |
|                | SKANSKA AB-B SHS                 | 4,700  | 191.90 | 901,930.00      |  |
|                | ALFA LAVAL AB                    | 3,000  | 184.00 | 552,000.00      |  |
|                | ATLAS COPCO AB-A                 | 8,800  | 296.60 | 2,610,080.00    |  |
|                | ATLAS COPCO AB-B                 | 4,800  | 264.90 | 1,271,520.00    |  |
|                | EPIROC AB - A                    | 6,900  | 99.56  | 686,964.00      |  |
|                | EPIROC AB - B                    | 3,500  | 95.14  | 332,990.00      |  |
|                | SANDVIK AB                       | 12,800 | 144.90 | 1,854,720.00    |  |
|                | SKF AB-B SHARES                  | 4,600  | 162.45 | 747,270.00      |  |
|                | VOLVO AB-B SHS                   | 19,600 | 137.25 | 2,690,100.00    |  |
|                | SECURITAS AB-B SHS               | 4,300  | 147.00 | 632,100.00      |  |
|                | ELECTROLUX AB-B                  | 2,600  | 220.40 | 573,040.00      |  |
|                | HUSQVARNA AB-B SHS               | 4,600  | 78.60  | 361,560.00      |  |
|                | HENNES&MAURITZ AB-B              | 10,000 | 187.38 | 1,873,800.00    |  |
|                | ICA GRUPPEN AB                   | 900    | 464.40 | 417,960.00      |  |
|                | SWEDISH MATCH AB                 | 1,900  | 415.80 | 790,020.00      |  |
|                | ESSITY AKTIEBOLAG-B              | 7,400  | 294.90 | 2,182,260.00    |  |
|                | NORDEA BANK ABP                  | 40,000 | 64.50  | 2,580,000.00    |  |
|                | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB | 18,400 | 85.30  | 1,569,520.00    |  |
|                | SVENSKA HANDELSBANKEN-A          | 17,100 | 87.80  | 1,501,380.00    |  |
|                | SWEDBANK AB                      | 9,600  | 129.35 | 1,241,760.00    |  |
|                | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS          | 2,000  | 210.40 | 420,800.00      |  |
|                | INVESTOR AB-B SHS                | 5,600  | 461.70 | 2,585,520.00    |  |
|                | KINNEVIK AB - B                  | 3,400  | 277.70 | 944,180.00      |  |
|                | LUNDBERGS AB-B SHS               | 800    | 373.60 | 298,880.00      |  |
|                | ERICSSON LM-B                    | 37,000 | 76.94  | 2,846,780.00    |  |
|                | HEXAGON AB-B SHS                 | 3,000  | 435.30 | 1,305,900.00    |  |
|                | TELIA CO AB                      | 32,000 | 42.92  | 1,373,440.00    |  |
|                | MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR- | 570    | 499.20 | 284,544.00      |  |

|               |                           |        |              |               |              |
|---------------|---------------------------|--------|--------------|---------------|--------------|
|               | SDR                       |        |              |               |              |
|               | TELE 2 AB-B SHS           | 6,900  | 141.30       | 974,970.00    |              |
| 小計            | 銘柄数：32                    |        |              | 40,364,848.00 |              |
|               |                           |        |              | (446,031,570) |              |
|               | 組入時価比率：0.9%               |        |              | 0.9%          |              |
| ノルウェーク<br>ローネ | AKER AB ASA               | 1,000  | 251.50       | 251,500.00    |              |
|               | EQUINOR ASA               | 11,500 | 166.75       | 1,917,625.00  |              |
|               | YARA INTERNATIONAL ASA    | 2,300  | 404.40       | 930,120.00    |              |
|               | NORSK HYDRO               | 14,200 | 30.92        | 439,064.00    |              |
|               | MOWI ASA                  | 5,700  | 216.80       | 1,235,760.00  |              |
|               | ORKLA ASA                 | 10,200 | 82.20        | 838,440.00    |              |
|               | DNB ASA                   | 11,700 | 150.45       | 1,760,265.00  |              |
|               | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 2,600  | 178.70       | 464,620.00    |              |
|               | TELENOR ASA               | 8,700  | 185.40       | 1,612,980.00  |              |
|               | SCHIBSTED ASA-B SHS       | 900    | 261.80       | 235,620.00    |              |
|               | 小計                        | 銘柄数：10 |              |               | 9,685,994.00 |
|               |                           |        |              | (114,972,748) |              |
|               | 組入時価比率：0.2%               |        |              | 0.2%          |              |
| デンマークク<br>ローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S    | 1,500  | 583.20       | 874,800.00    |              |
|               | NOVOZYMES A/S-B SHARES    | 2,500  | 290.30       | 725,750.00    |              |
|               | VESTAS WIND SYSTEMS A/S   | 2,300  | 500.40       | 1,150,920.00  |              |
|               | ISS A/S                   | 1,900  | 170.45       | 323,855.00    |              |
|               | A P MOLLER - MAERSK A/S-A | 51     | 7,175.00     | 365,925.00    |              |
|               | AP MOLLER-MAERSK A/S-B    | 79     | 7,646.00     | 604,034.00    |              |
|               | DSV A/S                   | 2,660  | 693.20       | 1,843,912.00  |              |
|               | PANDORA A/S               | 1,290  | 300.20       | 387,258.00    |              |
|               | CARLSBERG B               | 1,270  | 1,019.00     | 1,294,130.00  |              |
|               | COLOPLAST-B               | 1,290  | 816.80       | 1,053,672.00  |              |
|               | DEMANT A/S                | 1,300  | 205.40       | 267,020.00    |              |
|               | GENMAB A/S                | 780    | 1,430.00     | 1,115,400.00  |              |
|               | H LUNDBECK A/S            | 700    | 246.50       | 172,550.00    |              |
|               | NOVO NORDISK A/S-B        | 21,400 | 355.05       | 7,598,070.00  |              |
|               | DANSKE BANK AS            | 7,200  | 90.56        | 652,032.00    |              |
| TRYG A/S      | 1,000                     | 206.80 | 206,800.00   |               |              |
| ORSTED A/S    | 2,300                     | 670.20 | 1,541,460.00 |               |              |

|     |                                |        |       |               |  |
|-----|--------------------------------|--------|-------|---------------|--|
| 小計  | 銘柄数：17                         |        |       | 20,177,588.00 |  |
|     |                                |        |       | (319,411,218) |  |
|     | 組入時価比率：0.6%                    |        |       | 0.7%          |  |
| 豪ドル | WORLEYPARSONS LTD              | 2,600  | 12.50 | 32,500.00     |  |
|     | CALTEX AUSTRALIA LIMITED       | 3,200  | 24.22 | 77,504.00     |  |
|     | OIL SEARCH LTD                 | 14,000 | 7.05  | 98,700.00     |  |
|     | ORIGIN ENERGY LTD              | 17,000 | 7.47  | 126,990.00    |  |
|     | SANTOS LTD.                    | 23,000 | 7.29  | 167,670.00    |  |
|     | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON   | 900    | 20.85 | 18,765.00     |  |
|     | WOODSIDE PETROLEUM             | 11,500 | 31.66 | 364,090.00    |  |
|     | INCITEC PIVOT LTD              | 17,000 | 3.18  | 54,060.00     |  |
|     | ORICA LTD                      | 5,600  | 21.68 | 121,408.00    |  |
|     | BORAL LTD                      | 14,000 | 4.37  | 61,180.00     |  |
|     | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC    | 5,200  | 22.82 | 118,664.00    |  |
|     | ALUMINA LTD                    | 26,200 | 2.19  | 57,378.00     |  |
|     | BHP GROUP LIMITED              | 36,200 | 36.07 | 1,305,734.00  |  |
|     | BLUESCOPE STEEL LTD            | 7,300  | 12.79 | 93,367.00     |  |
|     | FORTESCUE METALS GROUP LTD     | 15,000 | 8.27  | 124,050.00    |  |
|     | NEWCREST MINING                | 10,100 | 37.68 | 380,568.00    |  |
|     | RIO TINTO LTD                  | 4,600  | 90.03 | 414,138.00    |  |
|     | SOUTH32 LTD                    | 61,000 | 2.71  | 165,310.00    |  |
|     | CIMIC GROUP LTD                | 1,045  | 30.18 | 31,538.10     |  |
|     | BRAMBLES LTD                   | 21,000 | 11.32 | 237,720.00    |  |
|     | AURIZON HOLDINGS LTD           | 19,000 | 5.98  | 113,620.00    |  |
|     | SYDNEY AIRPORT                 | 16,000 | 8.41  | 134,560.00    |  |
|     | TRANSURBAN GROUP               | 30,561 | 15.05 | 459,943.05    |  |
|     | ARISTOCRAT LEISURE LTD         | 8,000  | 29.59 | 236,720.00    |  |
|     | CROWN RESORTS LTD              | 4,800  | 12.10 | 58,080.00     |  |
|     | FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 800    | 48.48 | 38,784.00     |  |
|     | TABCORP HOLDINGS               | 18,320 | 4.72  | 86,470.40     |  |
|     | HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD     | 5,865  | 4.42  | 25,923.30     |  |
|     | WESFARMERS LIMITED             | 13,000 | 39.21 | 509,730.00    |  |
|     | COLES GROUP LTD                | 13,000 | 14.66 | 190,580.00    |  |
|     | WOOLWORTHS GROUP LTD           | 16,000 | 37.55 | 600,800.00    |  |
|     | COCA-COLA AMATIL LTD           | 4,300  | 11.00 | 47,300.00     |  |

|            |                                |        |        |                 |  |
|------------|--------------------------------|--------|--------|-----------------|--|
|            | TREASURY WINE ESTATES LTD      | 9,100  | 18.86  | 171,626.00      |  |
|            | COCHLEAR LTD                   | 740    | 212.86 | 157,516.40      |  |
|            | RAMSAY HEALTH CARE LTD         | 1,900  | 63.56  | 120,764.00      |  |
|            | SONIC HEALTHCARE LTD           | 4,900  | 29.12  | 142,688.00      |  |
|            | CSL LIMITED                    | 5,430  | 239.65 | 1,301,299.50    |  |
|            | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK   | 35,200 | 26.88  | 946,176.00      |  |
|            | BANK OF QUEENSLAND LTD         | 4,126  | 9.09   | 37,505.34       |  |
|            | BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD  | 3,700  | 10.89  | 40,293.00       |  |
|            | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 21,100 | 79.25  | 1,672,175.00    |  |
|            | NATIONAL AUSTRALIA BANK        | 34,000 | 27.51  | 935,340.00      |  |
|            | WESTPAC BANKING CORP           | 41,400 | 28.49  | 1,179,486.00    |  |
|            | AMP LIMITED                    | 31,000 | 1.66   | 51,460.00       |  |
|            | CHALLENGER LIMITED             | 6,000  | 6.67   | 40,020.00       |  |
|            | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD  | 27,328 | 8.12   | 221,903.36      |  |
|            | MEDIBANK PRIVATE LTD           | 30,000 | 3.44   | 103,200.00      |  |
|            | QBE INSURANCE                  | 16,400 | 12.37  | 202,868.00      |  |
|            | SUNCORP GROUP LTD              | 13,700 | 13.68  | 187,416.00      |  |
|            | COMPUTERSHARE LTD              | 6,600  | 15.28  | 100,848.00      |  |
|            | TELSTRA CORP LTD               | 42,000 | 3.59   | 150,780.00      |  |
|            | TPG TELECOM LTD                | 4,359  | 6.41   | 27,941.19       |  |
|            | AUSNET SERVICES                | 25,264 | 1.78   | 44,969.92       |  |
|            | APA GROUP                      | 12,700 | 10.83  | 137,541.00      |  |
|            | AGL ENERGY LTD                 | 6,300  | 19.02  | 119,826.00      |  |
|            | ASX LTD                        | 2,000  | 84.54  | 169,080.00      |  |
|            | MACQUARIE GROUP LIMITED        | 3,910  | 125.26 | 489,766.60      |  |
|            | MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD   | 1,900  | 52.89  | 100,491.00      |  |
|            | SEEK LTD                       | 3,800  | 20.90  | 79,420.00       |  |
|            | REA GROUP LTD                  | 600    | 106.35 | 63,810.00       |  |
| 小計         | 銘柄数：60                         |        |        | 15,550,055.16   |  |
|            |                                |        |        | (1,133,754,521) |  |
|            | 組入時価比率：2.3%                    |        |        | 2.4%            |  |
| ニュージーランドドル | FLETCHER BUILDING LTD          | 13,000 | 4.62   | 60,060.00       |  |
|            | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD      | 13,000 | 9.44   | 122,720.00      |  |
|            | A2 MILK CO LTD                 | 8,000  | 15.10  | 120,800.00      |  |
|            | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE     | 6,500  | 17.20  | 111,800.00      |  |

|      |  |         |        |               |  |
|------|--|---------|--------|---------------|--|
|      | CORPORATION L                          |         |        |               |  |
|      | RYMAN HEALTHCARE LTD                   | 5,000   | 13.47  | 67,350.00     |  |
|      | SPARK NEW ZEALAND LTD                  | 20,000  | 4.57   | 91,400.00     |  |
|      | MERIDIAN ENERGY LTD                    | 15,300  | 5.54   | 84,762.00     |  |
| 小計   | 銘柄数：7                                  |         |        | 658,892.00    |  |
|      |  |         |        | (44,956,201)  |  |
|      | 組入時価比率：0.1%                            |         |        | 0.1%          |  |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD              | 33,416  | 69.00  | 2,305,704.00  |  |
|      | NWS HOLDINGS LTD                       | 19,000  | 13.58  | 258,020.00    |  |
|      | TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED  | 18,000  | 57.70  | 1,038,600.00  |  |
|      | MTR CORP                               | 19,000  | 46.70  | 887,300.00    |  |
|      | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG               | 5,500   | 21.50  | 118,250.00    |  |
|      | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L           | 29,000  | 51.90  | 1,505,100.00  |  |
|      | MGM CHINA HOLDINGS LTD                 | 13,600  | 12.20  | 165,920.00    |  |
|      | SANDS CHINA LTD                        | 27,200  | 36.45  | 991,440.00    |  |
|      | SHANGRI-LA ASIA LTD                    | 7,000   | 8.05   | 56,350.00     |  |
|      | SJM HOLDINGS LIMITED                   | 24,000  | 7.84   | 188,160.00    |  |
|      | WYNN MACAU LTD                         | 18,000  | 16.30  | 293,400.00    |  |
|      | VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED | 8,000   | 37.75  | 302,000.00    |  |
|      | WH GROUP LIMITED                       | 106,000 | 6.81   | 721,860.00    |  |
|      | BANK OF EAST ASIA                      | 11,540  | 19.80  | 228,492.00    |  |
|      | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD             | 48,000  | 26.85  | 1,288,800.00  |  |
|      | HANG SENG BANK                         | 8,800   | 168.00 | 1,478,400.00  |  |
|      | AIA GROUP LTD                          | 146,600 | 78.55  | 11,515,430.00 |  |
|      | ASM PACIFIC TECHNOLOGY                 | 3,200   | 98.15  | 314,080.00    |  |
|      | HKT TRUST AND HKT LTD                  | 38,120  | 12.68  | 483,361.60    |  |
|      | PCCW LTD                               | 41,000  | 4.26   | 174,660.00    |  |
|      | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD         | 9,000   | 52.60  | 473,400.00    |  |
|      | CLP HLDGS                              | 20,500  | 80.55  | 1,651,275.00  |  |
|      | POWER ASSETS HOLDINGS LTD              | 20,000  | 52.30  | 1,046,000.00  |  |
|      | HONG KONG & CHINA GAS                  | 127,153 | 15.36  | 1,953,070.08  |  |
|      | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD     | 14,600  | 247.20 | 3,609,120.00  |  |
|      | CK ASSET HOLDINGS LTD                  | 29,416  | 55.20  | 1,623,763.20  |  |
|      | HANG LUNG PROPERTIES LTD               | 22,000  | 18.44  | 405,680.00    |  |

|              |   |        |        |               |      |
|--------------|---|--------|--------|---------------|------|
|              | HENDERSON LAND                          | 17,845 | 37.50  | 669,187.50    |      |
|              | HYSAN DEVELOPMENT                       | 7,000  | 31.50  | 220,500.00    |      |
|              | KERRY PROPERTIES                        | 6,500  | 26.05  | 169,325.00    |      |
|              | NEW WORLD DEVELOPMENT                   | 73,333 | 10.30  | 755,329.90    |      |
|              | SINO LAND CO.LTD                        | 31,000 | 11.66  | 361,460.00    |      |
|              | SUN HUNG KAI PROPERTIES                 | 20,000 | 115.10 | 2,302,000.00  |      |
|              | SWIRE PACIFIC-A                         | 5,000  | 76.10  | 380,500.00    |      |
|              | SWIRE PROPERTIES LTD                    | 10,800 | 26.45  | 285,660.00    |      |
|              | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT            | 16,200 | 44.85  | 726,570.00    |      |
|              | WHARF(HOLDING)                          | 10,200 | 17.20  | 175,440.00    |      |
|              | WHEELOCK & COMPANY LTD                  | 8,000  | 47.10  | 376,800.00    |      |
|              | 小計 銘柄数：38                               |        |        | 41,500,408.28 |      |
|              |   |        |        | (566,895,577) |      |
|              | 組入時価比率：1.1%                             |        |        |               | 1.2% |
| シンガポールド<br>ル | SINGAPORE TECH ENGINEERING              | 18,000 | 3.96   | 71,280.00     |      |
|              | KEPPEL CORP.                            | 16,000 | 5.90   | 94,400.00     |      |
|              | SEBACORP INDUSTRIES                     | 12,000 | 2.12   | 25,440.00     |      |
|              | YANGZIJANG SHIPBUILDING                 | 27,000 | 0.96   | 26,055.00     |      |
|              | SINGAPORE AIRLINES LTD                  | 8,000  | 8.99   | 71,920.00     |      |
|              | COMFORTDELGRO CORP LTD                  | 21,000 | 2.49   | 52,290.00     |      |
|              | SATS LTD                                | 8,000  | 4.79   | 38,320.00     |      |
|              | GENTING SINGAPORE LTD                   | 81,000 | 0.89   | 72,495.00     |      |
|              | JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD              | 1,111  | 30.67  | 34,074.37     |      |
|              | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD               | 86,000 | 0.26   | 22,790.00     |      |
|              | WILMAR INTERNATIONAL LTD                | 18,000 | 3.83   | 68,940.00     |      |
|              | DBS GROUP HLDGS                         | 22,800 | 24.63  | 561,564.00    |      |
|              | OCBC-ORD                                | 39,050 | 10.77  | 420,568.50    |      |
|              | UNITED OVERSEAS BANK                    | 14,600 | 25.26  | 368,796.00    |      |
|              | VENTURE CORP LTD                        | 3,200  | 15.09  | 48,288.00     |      |
|              | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS<br>LIMITED | 92,000 | 3.21   | 295,320.00    |      |
|              | SINGAPORE EXCHANGE LTD                  | 12,000 | 8.50   | 102,000.00    |      |
|              | CAPITALAND LIMITED                      | 32,000 | 3.51   | 112,320.00    |      |
|              | CITY DEVELOPMENTS LTD                   | 4,000  | 9.43   | 37,720.00     |      |
|              | UOL GROUP LIMITED                       | 3,000  | 7.48   | 22,440.00     |      |

|  |         |                          |        |        |                  |  |
|--|---------|--------------------------|--------|--------|------------------|--|
|  |         | SINGAPORE PRESS HOLDINGS | 17,000 | 1.96   | 33,320.00        |  |
|  | 小計      | 銘柄数：21                   |        |        | 2,580,340.87     |  |
|  |         | 組入時価比率：0.4%              |        |        | (199,537,759)    |  |
|  |         |                          |        |        | 0.4%             |  |
|  | 新スケジュール | ISRAEL CHEMICALS LIMITED | 6,000  | 16.10  | 96,600.00        |  |
|  |         | ELBIT SYSTEMS LTD        | 270    | 569.00 | 153,630.00       |  |
|  |         | BANK HAPOALIM BM         | 14,000 | 26.79  | 375,060.00       |  |
|  |         | BANK LEUMI LE-ISRAEL     | 18,000 | 24.20  | 435,600.00       |  |
|  |         | ISRAEL DISCOUNT BANK-A   | 14,000 | 14.37  | 201,180.00       |  |
|  |         | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 1,100  | 82.25  | 90,475.00        |  |
|  |         | NICE LTD                 | 810    | 538.00 | 435,780.00       |  |
|  |         | AZRIELI GROUP            | 400    | 257.50 | 103,000.00       |  |
|  | 小計      | 銘柄数：8                    |        |        | 1,891,325.00     |  |
|  |         | 組入時価比率：0.1%              |        |        | (57,496,280)     |  |
|  |         |                          |        |        | 0.1%             |  |
|  | 合計      |                          |        |        | 47,131,347,695   |  |
|  |         |                          |        |        | (47,131,347,695) |  |

(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(2019年9月6日現在)

| 種類   | 通貨  | 銘柄                           | 券面総額   | 評価額          | 備考 |
|------|-----|------------------------------|--------|--------------|----|
| 投資証券 | 米ドル | AGNC INVESTMENT CORP         | 6,100  | 92,049.00    |    |
|      |     | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 1,450  | 220,675.50   |    |
|      |     | AMERICAN TOWER CORP          | 5,220  | 1,230,615.00 |    |
|      |     | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT    | 16,800 | 140,616.00   |    |
|      |     | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 1,560  | 334,947.60   |    |
|      |     | BOSTON PROPERTIES            | 1,660  | 215,169.20   |    |
|      |     | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 960    | 105,120.00   |    |
|      |     | CROWN CASTLE INTL CORP       | 4,930  | 725,055.10   |    |
|      |     | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 2,340  | 296,407.80   |    |
|      |     | DUKE REALTY CORP             | 4,800  | 160,320.00   |    |
|      |     | EQUINIX INC                  | 980    | 539,980.00   |    |
|      |     | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 1,190  | 160,650.00   |    |

|       |                                |         |                 |  |
|-------|--------------------------------|---------|-----------------|--|
|       | EQUITY RESIDENTIAL             | 4,500   | 386,955.00      |  |
|       | ESSEX PROPERTY TRUST INC       | 860     | 279,259.20      |  |
|       | EXTRA SPACE STORAGE INC        | 1,610   | 195,132.00      |  |
|       | FEDERAL REALTY INVS TRUST      | 780     | 104,059.80      |  |
|       | HCP INC                        | 6,100   | 215,635.00      |  |
|       | HOST HOTELS & RESORTS INC      | 7,700   | 128,744.00      |  |
|       | INVITATION HOMES INC           | 5,400   | 154,494.00      |  |
|       | IRON MOUNTAIN INC              | 3,400   | 112,506.00      |  |
|       | KIMCO REALTY CORP              | 5,000   | 94,550.00       |  |
|       | LIBERTY PROPERTY TRUST         | 1,400   | 72,912.00       |  |
|       | MACERICH CO /THE               | 800     | 23,840.00       |  |
|       | MID-AMERICA APARTMENT COMM     | 1,420   | 182,257.00      |  |
|       | NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 1,700   | 93,891.00       |  |
|       | PROLOGIS INC                   | 7,600   | 642,884.00      |  |
|       | PUBLIC STORAGE                 | 1,910   | 493,276.60      |  |
|       | REALTY INCOME CORP             | 4,100   | 307,500.00      |  |
|       | REGENCY CENTERS CORP           | 2,300   | 153,134.00      |  |
|       | SBA COMMUNICATIONS CORP        | 1,290   | 339,528.00      |  |
|       | SIMON PROPERTY GROUP INC       | 3,650   | 547,719.00      |  |
|       | SL GREEN REALTY CORP           | 940     | 75,660.60       |  |
|       | SUN COMMUNITIES INC            | 1,210   | 179,430.90      |  |
|       | UDR INC                        | 3,400   | 164,390.00      |  |
|       | VENTAS INC                     | 4,200   | 313,404.00      |  |
|       | VEREIT INC                     | 11,100  | 107,226.00      |  |
|       | VORNADO REALTY TRUST           | 1,770   | 109,598.40      |  |
|       | WELLTOWER INC                  | 4,990   | 454,539.10      |  |
|       | WEYERHAEUSER CO                | 8,300   | 220,697.00      |  |
|       | WP CAREY INC                   | 1,800   | 162,270.00      |  |
| 小計    | 銘柄数：40                         | 147,220 | 10,537,097.80   |  |
|       |                                |         | (1,128,207,061) |  |
|       | 組入時価比率：2.3%                    |         | 81.8%           |  |
| カナダドル | H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS   | 1,200   | 27,096.00       |  |
|       | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR    | 1,986   | 51,854.46       |  |
|       | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV   | 700     | 22,351.00       |  |
| 小計    | 銘柄数：3                          | 3,886   | 101,301.46      |  |

|          |                              |         |              |               |
|----------|------------------------------|---------|--------------|---------------|
|          |                              |         | (8,197,314)  |               |
|          | 組入時価比率：0.0%                  |         | 0.6%         |               |
| ユーロ      | COVIVIO                      | 560     | 53,816.00    |               |
|          | GECINA SA                    | 560     | 79,016.00    |               |
|          | ICADE                        | 230     | 18,664.50    |               |
|          | KLEPIERRE                    | 2,200   | 61,336.00    |               |
|          | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 1,820   | 218,400.00   |               |
| 小計       | 銘柄数：5                        | 5,370   | 431,232.50   | (50,911,308)  |
|          | 組入時価比率：0.1%                  |         | 3.7%         |               |
| 英ポンド     | BRITISH LAND                 | 9,100   | 47,483.80    |               |
|          | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 7,312   | 55,892.92    |               |
|          | SEGRO PLC                    | 14,700  | 115,600.80   |               |
| 小計       | 銘柄数：3                        | 31,112  | 218,977.52   | (28,889,704)  |
|          | 組入時価比率：0.1%                  |         | 2.1%         |               |
| 豪ドル      | DEXUS                        | 13,200  | 170,676.00   |               |
|          | GOODMAN GROUP                | 21,100  | 295,400.00   |               |
|          | GPT GROUP                    | 26,000  | 164,060.00   |               |
|          | LENDLEASE GROUP              | 6,600   | 112,860.00   |               |
|          | MIRVAC GROUP                 | 54,000  | 169,560.00   |               |
|          | SCENTRE GROUP                | 68,000  | 270,640.00   |               |
|          | STOCKLAND TRUST GROUP        | 25,800  | 114,810.00   |               |
|          | VICINITY CENTRES             | 44,000  | 113,520.00   |               |
| 小計       | 銘柄数：8                        | 258,700 | 1,411,526.00 | (102,914,360) |
|          | 組入時価比率：0.2%                  |         | 7.5%         |               |
| 香港ドル     | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS  | 30,000  | 225,600.00   |               |
|          | LINK REIT                    | 26,000  | 2,324,400.00 |               |
| 小計       | 銘柄数：2                        | 56,000  | 2,550,000.00 | (34,833,000)  |
|          | 組入時価比率：0.1%                  |         | 2.5%         |               |
| シンガポールドル | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 34,000  | 109,140.00   |               |
|          | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  | 37,954  | 83,119.26    |               |
|          | CAPITALAND MALL TRUST        | 27,800  | 75,060.00    |               |
|          | SUNTEC REIT                  | 29,000  | 56,260.00    |               |

|    |                          |         |  |
|----|--------------------------|---------|--|
| 小計 | 銘柄数：4<br><br>組入時価比率：0.1% | 128,754 | 323,579.26<br><br>(25,022,384)<br><br>1.8% |
| 合計 |                          |         | 1,378,975,131<br><br>(1,378,975,131)       |

(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         | 2019年 9月 6日現在  |       |                |             |
|------------|----------------|-------|----------------|-------------|
|            | 契約額等(円)        |       | 時価(円)          | 評価損益(円)     |
|            |                | うち1年超 |                |             |
| 市場取引       |                |       |                |             |
| 株価指数先物取引   |                |       |                |             |
| 買建         | 1,423,467,368  | -     | 1,447,453,072  | 23,985,704  |
| 市場取引以外の取引  |                |       |                |             |
| 為替予約取引     |                |       |                |             |
| 売建         | 47,363,331,967 | -     | 47,864,362,100 | 501,030,133 |
| 米ドル        | 32,802,126,974 | -     | 33,083,965,500 | 281,838,526 |
| カナダドル      | 1,793,990,643  | -     | 1,821,006,600  | 27,015,957  |
| ユーロ        | 5,372,536,120  | -     | 5,435,222,400  | 62,686,280  |
| 英ポンド       | 2,794,884,163  | -     | 2,856,539,400  | 61,655,237  |
| スイスフラン     | 1,640,533,216  | -     | 1,658,491,200  | 17,957,984  |
| スウェーデンクローナ | 423,543,951    | -     | 433,049,500    | 9,505,549   |
| ノルウェークローネ  | 109,504,077    | -     | 111,721,200    | 2,217,123   |
| デンマーククローネ  | 308,599,753    | -     | 312,009,300    | 3,409,547   |
| 豪ドル        | 1,212,999,146  | -     | 1,238,110,000  | 25,110,854  |
| ニュージーランドドル | 42,097,017     | -     | 42,928,200     | 831,183     |
| 香港ドル       | 586,359,771    | -     | 591,839,600    | 5,479,829   |
| シンガポールドル   | 219,643,208    | -     | 222,364,800    | 2,721,592   |
| 新シェケル      | 56,513,928     | -     | 57,114,400     | 600,472     |
| 合計         | -              | -     | -              | 477,044,429 |

(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。

## 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)

(2019年 9月 6日現在)

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産の部            |                 |
| 流動資産            |                 |
| コール・ローン         | 5,862,036,828   |
| 国債証券            | 524,239,680,130 |
| 地方債証券           | 45,117,949,332  |
| 特殊債券            | 58,065,386,385  |
| 社債券             | 26,983,713,000  |
| 未収利息            | 1,845,587,982   |
| 前払費用            | 28,306,240      |
| 流動資産合計          | 662,142,659,897 |
| 資産合計            | 662,142,659,897 |
| 負債の部            |                 |
| 流動負債            |                 |
| 未払金             | 100,000,000     |
| 未払解約金           | 755,689,147     |
| 未払利息            | 9,753           |
| 流動負債合計          | 855,698,900     |
| 負債合計            | 855,698,900     |
| 純資産の部           |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 485,418,655,642 |
| 剰余金             |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 175,868,305,355 |
| 元本等合計           | 661,286,960,997 |
| 純資産合計           | 661,286,960,997 |
| 負債純資産合計         | 662,142,659,897 |

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

(貸借対照表に関する注記)

| 2019年 9月 6日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 1.3623円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (13,623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 2018年 9月 7日<br>至 2019年 9月 6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

2019年 9月 6日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2. 時価の算定方法

国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## (その他の注記)

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 9月 6日現在

| 期首                               | 2018年 9月 7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 | 501,468,969,614円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 65,614,795,954円  |
| 同期中における一部解約元本額                   | 81,665,109,926円  |
| 期末元本額                            | 485,418,655,642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                 | 485,206,910円     |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース)               | 36,029,411,288円  |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース)               | 17,211,907,414円  |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース)               | 2,588,626,185円   |
| 野村資産設計ファンド2015                   | 365,274,197円     |
| 野村資産設計ファンド2020                   | 347,946,667円     |
| 野村資産設計ファンド2025                   | 286,168,592円     |
| 野村資産設計ファンド2030                   | 202,082,649円     |
| 野村資産設計ファンド2035                   | 100,884,049円     |
| 野村資産設計ファンド2040                   | 156,455,927円     |
| 野村日本債券インデックスファンド                 | 986,033,111円     |
| 野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)         | 180,413,741,343円 |
| のむらップ・ファンド(保守型)                  | 12,126,676,482円  |
| のむらップ・ファンド(普通型)                  | 8,126,459,246円   |
| のむらップ・ファンド(積極型)                  | 974,981,927円     |
| 野村日本債券インデックス(野村SMA向け)            | 10,890,895,051円  |
| 野村資産設計ファンド2045                   | 15,613,711円      |
| 野村円債投資インデックスファンド                 | 1,238,447,870円   |
| 野村インデックスファンド・国内債券                | 3,088,216,030円   |
| マイ・ロード                           | 35,195,407,198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    | 836,082,856円     |
| 野村ターゲットプライス「日経225」(国内債券運用移行型)    | 24,132,577円      |
| 野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)         | 11,896,926,962円  |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース)             | 1,560,347,605円   |
| 野村資産設計ファンド2050                   | 19,564,327円      |

|   |                 |                 |
|---|-----------------|-----------------|
| 野村ターゲットデートファンド2016                        | 2026 - 2028年目標型 | 15,772,011円     |
| 野村ターゲットデートファンド2016                        | 2029 - 2031年目標型 | 4,026,620円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016                        | 2032 - 2034年目標型 | 2,499,040円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016                        | 2035 - 2037年目標型 | 1,560,486円      |
| のむらップ・ファンド(やや保守型)                         |                 | 736,917,899円    |
| のむらップ・ファンド(やや積極型)                         |                 | 148,155,225円    |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                         |                 | 60,542,562円     |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                         |                 | 21,734,178円     |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                         |                 | 49,258,758円     |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                         |                 | 8,519,435円      |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                         |                 | 13,805,162円     |
| 野村6資産均等バランス                               |                 | 834,639,796円    |
| 世界6資産分散ファンド                               |                 | 168,053,043円    |
| NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合連動型上場投信     |                 | 815,558,196円    |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型                  |                 | 10,588,332,294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)          |                 | 654,525,456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)          |                 | 161,680,784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)          |                 | 2,100,879,181円  |
| グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)          |                 | 1,382,361,265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)          |                 | 19,220,480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)        |                 | 10,666,952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)          |                 | 1,137,893円      |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)              |                 | 4,047,321,553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)         |                 | 16,340,548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)         |                 | 111,114,984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)            |                 | 103,101,081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)        |                 | 331,295,606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)        |                 | 323,315,952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)        |                 | 777,051,774円    |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)                   |                 | 1,546,101,782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)            |                 | 836,752,594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)        |                 | 1,822,293,813円  |
| マイバランス30(確定拠出年金向け)                        |                 | 16,460,777,778円 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け)                        |                 | 23,734,777,442円 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け)                        |                 | 10,221,331,272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) |                 | 47,865,503,099円 |
| マイバランスDC30                                |                 | 10,593,577,532円 |
| マイバランスDC50                                |                 | 7,310,220,242円  |
| マイバランスDC70                                |                 | 2,273,799,563円  |
| 野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合         |                 | 11,921,180,735円 |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け)                     |                 | 453,702,144円    |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け)                     |                 | 866,009,027円    |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け)                     |                 | 374,354,035円    |
| 野村世界6資産分散投信(DC)安定コース                      |                 | 55,434,481円     |
| 野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース                    |                 | 11,024,235円     |
| 野村世界6資産分散投信(DC)成長コース                      |                 | 9,264,264円      |
| 野村資産設計ファンド(DC)2030                        |                 | 7,139,071円      |

|                       |              |
|-----------------------|--------------|
| 野村資産設計ファンド(DC)2040    | 2,352,538円   |
| 野村資産設計ファンド(DC)2050    | 1,621,076円   |
| マイターゲット2035(確定拠出年金向け) | 228,737,130円 |
| マイターゲット2045(確定拠出年金向け) | 92,483,961円  |
| マイターゲット2055(確定拠出年金向け) | 22,082,744円  |
| マイターゲット2060(確定拠出年金向け) | 31,256,696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(2019年9月6日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2019年9月6日現在)

(単位:円)

| 種類              | 通貨            | 銘柄               | 券面総額          | 評価額           | 備考 |
|-----------------|---------------|------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券            | 日本円           | 国庫債券 利付(2年)第402回 | 1,400,000,000 | 1,410,178,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(2年)第403回 | 1,500,000,000 | 1,511,415,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第126回 | 7,500,000,000 | 7,536,525,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第127回 | 6,000,000,000 | 6,035,820,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第128回 | 5,200,000,000 | 5,236,712,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第129回 | 4,000,000,000 | 4,033,080,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第130回 | 5,000,000,000 | 5,047,050,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第131回 | 4,800,000,000 | 4,850,064,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第132回 | 3,000,000,000 | 3,034,440,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第133回 | 2,200,000,000 | 2,228,270,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第134回 | 3,000,000,000 | 3,042,240,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第135回 | 4,500,000,000 | 4,569,840,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第136回 | 4,300,000,000 | 4,372,369,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第137回 | 3,000,000,000 | 3,053,310,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第138回 | 3,900,000,000 | 3,974,490,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第139回 | 1,400,000,000 | 1,428,308,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(5年)第140回 | 1,400,000,000 | 1,429,918,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(40年)第1回  | 2,360,000,000 | 3,802,172,400 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(40年)第2回  | 900,000,000   | 1,415,646,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(40年)第3回  | 900,000,000   | 1,430,190,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(40年)第4回  | 1,300,000,000 | 2,089,646,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(40年)第5回  | 1,200,000,000 | 1,873,956,000 |    |
|                 |               | 国庫債券 利付(40年)第6回  | 1,300,000,000 | 2,006,966,000 |    |
| 国庫債券 利付(40年)第7回 | 1,400,000,000 | 2,088,324,000    |               |               |    |

|                   |               |               |  |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| 国庫債券 利付(40年)第8回   | 1,500,000,000 | 2,104,020,000 |  |
| 国庫債券 利付(40年)第9回   | 1,900,000,000 | 2,019,035,000 |  |
| 国庫債券 利付(40年)第10回  | 2,100,000,000 | 2,608,557,000 |  |
| 国庫債券 利付(40年)第11回  | 1,500,000,000 | 1,815,435,000 |  |
| 国庫債券 利付(40年)第12回  | 100,000,000   | 109,981,000   |  |
| 国庫債券 利付(10年)第312回 | 4,950,000,000 | 5,044,050,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第313回 | 3,200,000,000 | 3,277,984,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第314回 | 2,200,000,000 | 2,246,860,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第315回 | 3,600,000,000 | 3,695,868,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第316回 | 1,400,000,000 | 1,434,776,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第317回 | 1,800,000,000 | 1,851,462,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第318回 | 3,200,000,000 | 3,284,960,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第319回 | 1,850,000,000 | 1,909,662,500 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第320回 | 3,500,000,000 | 3,604,825,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第321回 | 3,200,000,000 | 3,306,304,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第322回 | 2,400,000,000 | 2,473,608,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第323回 | 1,700,000,000 | 1,757,392,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第324回 | 3,200,000,000 | 3,299,072,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第325回 | 4,400,000,000 | 4,550,084,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第326回 | 2,100,000,000 | 2,170,980,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第327回 | 3,100,000,000 | 3,215,041,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第328回 | 5,000,000,000 | 5,165,850,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第329回 | 5,300,000,000 | 5,529,119,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第330回 | 3,800,000,000 | 3,975,370,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第331回 | 1,900,000,000 | 1,972,162,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第332回 | 5,400,000,000 | 5,619,186,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第333回 | 4,200,000,000 | 4,380,432,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第334回 | 7,600,000,000 | 7,946,940,000 |  |
|                   | 4,200,000,000 | 4,381,650,000 |  |

|                   |               |               |  |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| 国庫債券 利付(10年)第335回 |               |               |  |
| 国庫債券 利付(10年)第336回 | 1,700,000,000 | 1,777,724,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第337回 | 1,700,000,000 | 1,759,432,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第338回 | 3,700,000,000 | 3,857,435,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第339回 | 3,000,000,000 | 3,133,590,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第340回 | 4,200,000,000 | 4,395,384,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第341回 | 3,700,000,000 | 3,855,622,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第342回 | 2,750,000,000 | 2,833,572,500 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第343回 | 5,400,000,000 | 5,570,640,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第344回 | 5,300,000,000 | 5,473,840,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第345回 | 5,000,000,000 | 5,170,000,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第346回 | 5,400,000,000 | 5,589,972,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第347回 | 4,400,000,000 | 4,560,116,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第348回 | 4,500,000,000 | 4,665,375,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第349回 | 5,000,000,000 | 5,185,200,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第350回 | 7,950,000,000 | 8,246,217,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第351回 | 5,100,000,000 | 5,288,649,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第352回 | 4,800,000,000 | 4,975,872,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第353回 | 5,100,000,000 | 5,284,620,000 |  |
| 国庫債券 利付(10年)第354回 | 3,850,000,000 | 3,987,329,500 |  |
| 国庫債券 利付(30年)第1回   | 100,000,000   | 130,773,000   |  |
| 国庫債券 利付(30年)第2回   | 200,000,000   | 255,496,000   |  |
| 国庫債券 利付(30年)第3回   | 160,000,000   | 203,484,800   |  |
| 国庫債券 利付(30年)第4回   | 900,000,000   | 1,214,685,000 |  |
| 国庫債券 利付(30年)第5回   | 150,000,000   | 191,953,500   |  |
| 国庫債券 利付(30年)第6回   | 700,000,000   | 919,492,000   |  |
| 国庫債券 利付(30年)第7回   | 600,000,000   | 786,648,000   |  |
| 国庫債券 利付(30年)第8回   | 100,000,000   | 125,336,000   |  |
| 国庫債券 利付(30年)第9回   | 265,000,000   | 318,280,900   |  |
| 国庫債券 利付(30年)第10回  | 250,000,000   | 290,535,000   |  |
| 国庫債券 利付(30年)第11回  | 160,000,000   | 199,537,600   |  |

|      |             |               |               |
|------|-------------|---------------|---------------|
| 国庫債券 | 利付(30年)第12回 | 220,000,000   | 287,438,800   |
| 国庫債券 | 利付(30年)第13回 | 290,000,000   | 376,040,100   |
| 国庫債券 | 利付(30年)第14回 | 800,000,000   | 1,086,792,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第15回 | 900,000,000   | 1,240,758,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第16回 | 915,000,000   | 1,265,463,300 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第17回 | 1,200,000,000 | 1,647,600,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第18回 | 1,500,000,000 | 2,041,980,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第19回 | 1,600,000,000 | 2,185,792,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第20回 | 1,400,000,000 | 1,962,618,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第21回 | 1,400,000,000 | 1,924,188,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第22回 | 600,000,000   | 846,486,000   |
| 国庫債券 | 利付(30年)第23回 | 840,000,000   | 1,189,339,200 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第24回 | 700,000,000   | 994,637,000   |
| 国庫債券 | 利付(30年)第25回 | 500,000,000   | 695,110,000   |
| 国庫債券 | 利付(30年)第26回 | 850,000,000   | 1,199,120,500 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第27回 | 1,550,000,000 | 2,226,575,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第28回 | 1,200,000,000 | 1,736,472,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第29回 | 1,500,000,000 | 2,156,355,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第30回 | 1,700,000,000 | 2,423,248,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第31回 | 1,600,000,000 | 2,262,016,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第32回 | 1,900,000,000 | 2,740,731,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第33回 | 2,100,000,000 | 2,915,808,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第34回 | 2,100,000,000 | 3,019,737,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第35回 | 2,300,000,000 | 3,228,027,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第36回 | 2,300,000,000 | 3,244,817,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第37回 | 2,300,000,000 | 3,210,294,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第38回 | 1,600,000,000 | 2,207,440,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第39回 | 1,600,000,000 | 2,250,608,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第40回 | 1,100,000,000 | 1,524,501,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第41回 | 1,500,000,000 | 2,047,050,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第42回 | 1,600,000,000 | 2,189,248,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第43回 | 1,300,000,000 | 1,783,509,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第44回 | 1,400,000,000 | 1,925,812,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第45回 | 1,700,000,000 | 2,258,960,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第46回 | 1,800,000,000 | 2,397,402,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第47回 | 1,700,000,000 | 2,311,762,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第48回 | 1,900,000,000 | 2,491,850,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第49回 | 1,900,000,000 | 2,497,303,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第50回 | 1,600,000,000 | 1,858,192,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第51回 | 1,600,000,000 | 1,651,152,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第52回 | 1,900,000,000 | 2,059,372,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第53回 | 1,700,000,000 | 1,888,105,000 |

|      |             |               |               |
|------|-------------|---------------|---------------|
| 国庫債券 | 利付(30年)第54回 | 1,700,000,000 | 1,979,021,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第55回 | 1,500,000,000 | 1,748,340,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第56回 | 1,900,000,000 | 2,214,317,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第57回 | 1,400,000,000 | 1,631,378,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第58回 | 2,100,000,000 | 2,449,944,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第59回 | 1,600,000,000 | 1,825,136,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第60回 | 1,050,000,000 | 1,256,829,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第61回 | 1,200,000,000 | 1,369,740,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第62回 | 1,300,000,000 | 1,410,695,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第63回 | 900,000,000   | 950,580,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第48回 | 200,000,000   | 207,154,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第49回 | 200,000,000   | 207,352,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第50回 | 183,000,000   | 189,163,440   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第51回 | 310,000,000   | 322,706,900   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第52回 | 100,000,000   | 104,908,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第53回 | 250,000,000   | 263,800,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第54回 | 100,000,000   | 105,750,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第55回 | 231,000,000   | 244,568,940   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第56回 | 120,000,000   | 127,749,600   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第57回 | 210,000,000   | 222,973,800   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第58回 | 180,000,000   | 192,196,800   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第59回 | 230,000,000   | 245,396,200   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第60回 | 780,000,000   | 824,460,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第61回 | 300,000,000   | 314,232,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第62回 | 440,000,000   | 459,021,200   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第63回 | 300,000,000   | 324,384,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第64回 | 400,000,000   | 436,344,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第65回 | 455,000,000   | 499,039,450   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第66回 | 300,000,000   | 327,735,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第67回 | 310,000,000   | 341,762,600   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第68回 | 290,000,000   | 323,709,600   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第69回 | 560,000,000   | 622,524,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第70回 | 540,000,000   | 611,712,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第71回 | 200,000,000   | 224,618,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第72回 | 670,000,000   | 753,468,600   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第73回 | 1,600,000,000 | 1,801,264,000 |
| 国庫債券 | 利付(20年)第74回 | 900,000,000   | 1,018,053,000 |
| 国庫債券 | 利付(20年)第75回 | 600,000,000   | 682,446,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第76回 | 910,000,000   | 1,024,796,500 |
| 国庫債券 | 利付(20年)第77回 | 700,000,000   | 792,246,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第78回 | 800,000,000   | 905,880,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第79回 | 860,000,000   | 978,895,000   |
| 国庫債券 | 利付(20年)第80回 | 900,000,000   | 1,029,726,000 |

|      |              |               |               |  |
|------|--------------|---------------|---------------|--|
| 国庫債券 | 利付(20年)第81回  | 360,000,000   | 411,858,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第82回  | 820,000,000   | 943,172,200   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第83回  | 1,370,000,000 | 1,584,487,200 |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第84回  | 1,200,000,000 | 1,380,168,000 |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第85回  | 400,000,000   | 465,136,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第86回  | 1,400,000,000 | 1,646,666,000 |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第87回  | 500,000,000   | 584,760,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第88回  | 1,100,000,000 | 1,301,476,000 |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第89回  | 470,000,000   | 552,823,400   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第90回  | 1,500,000,000 | 1,773,765,000 |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第91回  | 250,000,000   | 297,427,500   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第92回  | 1,550,000,000 | 1,831,604,000 |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第93回  | 300,000,000   | 354,081,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第94回  | 200,000,000   | 237,598,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第95回  | 700,000,000   | 846,965,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第96回  | 400,000,000   | 477,592,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第97回  | 1,300,000,000 | 1,569,997,000 |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第98回  | 300,000,000   | 359,835,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第99回  | 2,100,000,000 | 2,530,059,000 |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第100回 | 1,520,000,000 | 1,852,484,800 |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第101回 | 250,000,000   | 309,060,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第102回 | 500,000,000   | 620,865,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第103回 | 600,000,000   | 739,638,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第104回 | 400,000,000   | 485,888,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第105回 | 1,900,000,000 | 2,316,784,000 |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第106回 | 400,000,000   | 491,444,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第107回 | 300,000,000   | 367,320,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第108回 | 1,600,000,000 | 1,928,624,000 |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第109回 | 900,000,000   | 1,088,289,000 |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第110回 | 1,100,000,000 | 1,351,592,000 |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第111回 | 800,000,000   | 994,456,000   |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第112回 | 1,800,000,000 | 2,219,526,000 |  |
| 国庫債券 | 利付(20年)第113回 | 2,000,000,000 | 2,475,880,000 |  |
|      |              | 1,700,000,000 | 2,112,573,000 |  |

|                   |               |               |  |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| 国庫債券 利付(20年)第114回 |               |               |  |
| 国庫債券 利付(20年)第115回 | 1,000,000,000 | 1,253,200,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第116回 | 1,100,000,000 | 1,383,855,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第117回 | 1,400,000,000 | 1,746,220,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第118回 | 500,000,000   | 620,485,000   |  |
| 国庫債券 利付(20年)第119回 | 800,000,000   | 975,168,000   |  |
| 国庫債券 利付(20年)第120回 | 800,000,000   | 957,568,000   |  |
| 国庫債券 利付(20年)第121回 | 1,700,000,000 | 2,097,919,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第122回 | 1,100,000,000 | 1,345,102,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第123回 | 1,500,000,000 | 1,891,560,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第124回 | 1,000,000,000 | 1,249,540,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第125回 | 900,000,000   | 1,149,408,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第126回 | 1,000,000,000 | 1,253,630,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第127回 | 1,200,000,000 | 1,490,268,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第128回 | 1,800,000,000 | 2,242,422,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第129回 | 800,000,000   | 987,040,000   |  |
| 国庫債券 利付(20年)第130回 | 1,400,000,000 | 1,732,332,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第131回 | 800,000,000   | 980,112,000   |  |
| 国庫債券 利付(20年)第132回 | 1,300,000,000 | 1,597,856,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第133回 | 1,400,000,000 | 1,738,254,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第134回 | 1,400,000,000 | 1,742,944,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第135回 | 700,000,000   | 862,561,000   |  |
| 国庫債券 利付(20年)第136回 | 700,000,000   | 853,657,000   |  |
| 国庫債券 利付(20年)第137回 | 1,000,000,000 | 1,235,380,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第138回 | 800,000,000   | 967,552,000   |  |
| 国庫債券 利付(20年)第139回 | 1,000,000,000 | 1,222,410,000 |  |
|                   | 2,300,000,000 | 2,848,435,000 |  |

|                   |               |               |  |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| 国庫債券 利付(20年)第140回 |               |               |  |
| 国庫債券 利付(20年)第141回 | 2,600,000,000 | 3,227,666,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第142回 | 950,000,000   | 1,192,117,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第143回 | 1,300,000,000 | 1,599,728,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第144回 | 1,300,000,000 | 1,581,944,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第145回 | 2,300,000,000 | 2,868,353,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第146回 | 2,400,000,000 | 2,999,784,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第147回 | 2,200,000,000 | 2,725,976,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第148回 | 2,100,000,000 | 2,578,149,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第149回 | 2,350,000,000 | 2,890,124,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第150回 | 1,830,000,000 | 2,228,464,200 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第151回 | 2,500,000,000 | 2,972,000,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第152回 | 1,700,000,000 | 2,023,000,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第153回 | 2,450,000,000 | 2,959,526,500 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第154回 | 3,000,000,000 | 3,579,930,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第155回 | 2,800,000,000 | 3,255,812,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第156回 | 2,600,000,000 | 2,767,284,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第157回 | 2,590,000,000 | 2,667,933,100 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第158回 | 2,800,000,000 | 3,025,540,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第159回 | 2,700,000,000 | 2,962,008,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第160回 | 1,500,000,000 | 1,670,835,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第161回 | 2,100,000,000 | 2,303,511,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第162回 | 1,700,000,000 | 1,863,744,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第163回 | 1,900,000,000 | 2,083,616,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第164回 | 2,600,000,000 | 2,804,464,000 |  |
| 国庫債券 利付(20年)第165回 | 2,200,000,000 | 2,373,118,000 |  |
|                   | 2,300,000,000 | 2,567,283,000 |  |

|       |                         |                  |                 |             |  |
|-------|-------------------------|------------------|-----------------|-------------|--|
| 小計    | 国庫債券 利付(20年)第166回       |                  |                 |             |  |
|       | 国庫債券 利付(20年)第167回       | 2,100,000,000    | 2,263,149,000   |             |  |
|       | 国庫債券 利付(20年)第168回       | 2,000,000,000    | 2,116,920,000   |             |  |
|       | 国庫債券 利付(20年)第169回       | 1,100,000,000    | 1,142,658,000   |             |  |
|       | メキシコ合衆国 第22回円貨社債(2016)  | 300,000,000      | 301,707,000     |             |  |
|       | メキシコ合衆国 第25回円貨社債(2018)  | 100,000,000      | 99,845,000      |             |  |
|       | ポーランド共和国 第15回円貨債券(2013) | 100,000,000      | 100,587,000     |             |  |
|       | 銘柄数:260                 | 461,699,000,000  | 524,239,680,130 |             |  |
|       | 組入時価比率:79.3%            |                  | 80.1%           |             |  |
| 合計    |                         | 524,239,680,130  |                 |             |  |
| 地方債証券 | 日本円                     | 東京都 公募第690回      | 200,000,000     | 203,334,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第703回      | 100,000,000     | 102,275,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第707回      | 100,000,000     | 102,200,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第708回      | 100,000,000     | 102,463,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第710回      | 100,000,000     | 102,244,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第712回      | 100,000,000     | 102,339,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第715回      | 100,000,000     | 102,498,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第716回      | 200,000,000     | 205,062,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第731回      | 100,000,000     | 102,854,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第745回      | 300,000,000     | 309,057,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第760回      | 100,000,000     | 100,105,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第761回      | 100,000,000     | 100,315,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第769回      | 500,000,000     | 506,750,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募(30年)第7回   | 100,000,000     | 141,675,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第10回       | 200,000,000     | 279,658,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第1回        | 300,000,000     | 317,445,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募(20年)第3回   | 200,000,000     | 220,434,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第7回        | 100,000,000     | 112,938,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募(20年)第16回  | 200,000,000     | 236,148,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募(20年)第17回  | 200,000,000     | 237,628,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募第23回       | 100,000,000     | 122,469,000 |  |
|       |                         | 東京都 公募(20年)第26回  | 100,000,000     | 120,537,000 |  |
|       |                         | 北海道 公募平成24年度第6回  | 100,000,000     | 102,460,000 |  |
|       |                         | 北海道 公募平成24年度第9回  | 100,000,000     | 102,440,000 |  |
|       |                         | 北海道 公募平成25年度第1回  | 300,000,000     | 306,138,000 |  |
|       |                         | 北海道 公募平成26年度第13回 | 100,000,000     | 102,309,000 |  |
|       |                         | 北海道 公募平成27年度第7回  | 100,000,000     | 102,983,000 |  |
|       |                         | 北海道 公募平成28年度第13回 | 200,000,000     | 200,036,000 |  |

|      |              |               |               |
|------|--------------|---------------|---------------|
| 北海道  | 公募平成29年度第5回  | 200,000,000   | 201,920,000   |
| 北海道  | 公募平成29年度第6回  | 700,000,000   | 699,902,000   |
| 北海道  | 公募平成29年度第7回  | 100,000,000   | 101,193,000   |
| 北海道  | 公募平成29年度第9回  | 100,000,000   | 101,166,000   |
| 宮城県  | 公募第32回2号     | 100,000,000   | 100,525,000   |
| 神奈川県 | 公募第184回      | 100,000,000   | 101,834,000   |
| 神奈川県 | 公募第188回      | 200,000,000   | 205,310,000   |
| 神奈川県 | 公募第196回      | 100,000,000   | 102,396,000   |
| 神奈川県 | 公募第200回      | 100,000,000   | 103,311,000   |
| 神奈川県 | 公募第205回      | 100,000,000   | 102,985,000   |
| 神奈川県 | 公募第206回      | 100,000,000   | 103,106,000   |
| 神奈川県 | 公募第210回      | 200,000,000   | 204,662,000   |
| 神奈川県 | 公募第231回      | 200,000,000   | 202,958,000   |
| 神奈川県 | 公募(30年)第3回   | 100,000,000   | 141,089,000   |
| 神奈川県 | 公募第7回        | 300,000,000   | 349,242,000   |
| 神奈川県 | 公募(20年)第14回  | 100,000,000   | 120,018,000   |
| 神奈川県 | 公募(20年)第17回  | 200,000,000   | 243,580,000   |
| 大阪府  | 公募第346回      | 100,000,000   | 101,757,000   |
| 大阪府  | 公募第356回      | 100,000,000   | 102,454,000   |
| 大阪府  | 公募第378回      | 104,000,000   | 107,054,480   |
| 大阪府  | 公募第381回      | 100,000,000   | 103,035,000   |
| 大阪府  | 公募第382回      | 100,000,000   | 103,048,000   |
| 大阪府  | 公募第383回      | 100,000,000   | 103,198,000   |
| 大阪府  | 公募第384回      | 100,000,000   | 103,143,000   |
| 大阪府  | 公募第387回      | 300,000,000   | 307,644,000   |
| 大阪府  | 公募第389回      | 100,000,000   | 102,675,000   |
| 大阪府  | 公募第417回      | 102,000,000   | 103,613,640   |
| 大阪府  | 公募第423回      | 100,000,000   | 101,155,000   |
| 大阪府  | 公募第429回      | 179,000,000   | 181,357,430   |
| 大阪府  | 公募第5回        | 100,000,000   | 121,526,000   |
| 大阪府  | 公募第8回        | 100,000,000   | 120,556,000   |
| 大阪府  | 公募(5年)第130回  | 600,000,000   | 600,114,000   |
| 大阪府  | 公募(5年)第137回  | 1,024,000,000 | 1,024,030,720 |
| 大阪府  | 公募(5年)第141回  | 230,000,000   | 230,006,900   |
| 京都府  | 公募平成24年度第2回  | 100,000,000   | 102,523,000   |
| 京都府  | 公募平成24年度第6回  | 100,000,000   | 102,498,000   |
| 京都府  | 公募平成26年度第5回  | 100,000,000   | 118,942,000   |
| 京都府  | 公募平成26年度第7回  | 200,000,000   | 205,576,000   |
| 兵庫県  | 公募平成26年度第17回 | 100,000,000   | 102,462,000   |
| 兵庫県  | 公募平成29年度第22回 | 100,000,000   | 101,244,000   |
| 兵庫県  | 公募(30年)第2回   | 100,000,000   | 141,031,000   |
| 兵庫県  | 公募(15年)第1回   | 300,000,000   | 333,648,000   |

|                       |             |             |
|-----------------------|-------------|-------------|
| 兵庫県 公募(15年)第3回        | 200,000,000 | 220,580,000 |
| 兵庫県 公募(12年)第3回        | 300,000,000 | 309,243,000 |
| 兵庫県 公募第2回             | 100,000,000 | 118,656,000 |
| 兵庫県 公募第9回             | 100,000,000 | 121,398,000 |
| 兵庫県 公募(20年)第11回       | 200,000,000 | 237,010,000 |
| 兵庫県 公募(20年)第14回       | 100,000,000 | 119,875,000 |
| 静岡県 公募平成24年度第5回       | 100,060,000 | 102,490,457 |
| 静岡県 公募平成24年度第10回      | 100,000,000 | 102,414,000 |
| 静岡県 公募平成25年度第5回       | 101,000,000 | 104,613,780 |
| 静岡県 公募平成26年度第3回       | 165,000,000 | 170,248,650 |
| 静岡県 公募平成26年度第8回       | 100,000,000 | 102,798,000 |
| 静岡県 公募平成26年度第9回       | 200,000,000 | 205,580,000 |
| 静岡県 公募平成27年度第11回      | 115,400,000 | 115,994,310 |
| 静岡県 公募平成28年度第2回       | 300,000,000 | 300,957,000 |
| 静岡県 公募平成29年度第3回       | 100,000,000 | 101,007,000 |
| 静岡県 公募(31年)第1回        | 174,000,000 | 174,642,060 |
| 静岡県 公募(20年)第11回       | 100,000,000 | 119,064,000 |
| 静岡県 公募(20年)第14回       | 100,000,000 | 120,486,000 |
| 愛知県 公募平成20年度第8回       | 100,000,000 | 118,352,000 |
| 愛知県 公募平成22年度第9回       | 100,000,000 | 101,239,000 |
| 愛知県 公募平成23年度第19回      | 100,000,000 | 102,488,000 |
| 愛知県 公募平成24年度第2回       | 100,000,000 | 102,586,000 |
| 愛知県 公募(20年)平成24年度第4回  | 100,000,000 | 119,838,000 |
| 愛知県 公募(15年)平成24年度第14回 | 400,000,000 | 441,992,000 |
| 愛知県 公募平成24年度第17回      | 100,000,000 | 122,036,000 |
| 愛知県 公募(30年)平成25年度第8回  | 120,000,000 | 165,871,200 |
| 愛知県 公募平成26年度第8回       | 100,000,000 | 134,724,000 |
| 愛知県 公募平成26年度第13回      | 100,000,000 | 117,910,000 |
| 愛知県 公募(15年)平成27年度第2回  | 100,000,000 | 106,654,000 |
| 愛知県 公募平成27年度第15回      | 100,000,000 | 102,836,000 |
| 愛知県 公募平成29年度第9回       | 100,000,000 | 100,874,000 |
| 広島県 公募平成22年度第6回       | 300,000,000 | 305,283,000 |
| 広島県 公募平成24年度第4回       | 100,000,000 | 102,614,000 |
| 広島県 公募平成25年度第3回       | 200,000,000 | 206,440,000 |
| 広島県 公募平成26年度第5回       | 109,650,000 | 111,540,366 |
| 広島県 公募平成29年度第4回       | 111,300,000 | 112,931,658 |
| 埼玉県 公募平成24年度第4回       | 300,000,000 | 307,185,000 |
| 埼玉県 公募平成25年度第4回       | 100,000,000 | 103,556,000 |
| 埼玉県 公募平成25年度第6回       | 148,000,000 | 152,808,520 |
| 埼玉県 公募平成25年度第10回      | 100,000,000 | 102,974,000 |

|           |                       |             |             |
|-----------|-----------------------|-------------|-------------|
| 埼玉県       | 公募平成25年度第11回          | 100,000,000 | 102,957,000 |
| 埼玉県       | 公募平成26年度第3回           | 100,000,000 | 103,126,000 |
| 埼玉県       | 公募平成26年度第6回           | 200,000,000 | 205,498,000 |
| 埼玉県       | 公募平成26年度第7回           | 400,000,000 | 409,876,000 |
| 埼玉県       | 公募平成26年度第9回           | 100,000,000 | 102,291,000 |
| 埼玉県       | 公募平成27年度第9回           | 100,000,000 | 101,417,000 |
| 埼玉県       | 公募平成30年度第7回           | 200,000,000 | 200,122,000 |
| 埼玉県       | 公募(20年)第20回           | 100,000,000 | 107,313,000 |
| 福岡県       | 公募平成22年度第5回           | 100,000,000 | 101,085,000 |
| 福岡県       | 公募平成23年度第5回           | 100,000,000 | 102,186,000 |
| 福岡県       | 公募平成26年度第1回           | 100,000,000 | 103,115,000 |
| 福岡県       | 公募平成27年度第1回           | 300,000,000 | 309,861,000 |
| 福岡県       | 公募平成29年度第1回           | 100,000,000 | 101,274,000 |
| 福岡県       | 公募平成23年度第1回           | 100,000,000 | 110,507,000 |
| 福岡県       | 公募(30年)平成19年度第1回      | 100,000,000 | 142,228,000 |
| 福岡県       | 公募(30年)平成26年度第1回      | 100,000,000 | 135,025,000 |
| 福岡県       | 公募(30年・定時償還)平成29年度第2回 | 100,000,000 | 114,901,000 |
| 福岡県       | 公募(20年)平成20年度第2回      | 100,000,000 | 118,444,000 |
| 福岡県       | 公募(20年)平成24年度第2回      | 100,000,000 | 119,442,000 |
| 千葉県       | 公募平成24年度第1回           | 100,000,000 | 102,701,000 |
| 千葉県       | 公募平成24年度第2回           | 100,000,000 | 102,461,000 |
| 千葉県       | 公募平成24年度第7回           | 100,000,000 | 102,436,000 |
| 千葉県       | 公募平成24年度第8回           | 100,000,000 | 102,844,000 |
| 千葉県       | 公募平成25年度第3回           | 100,000,000 | 103,361,000 |
| 千葉県       | 公募平成25年度第4回           | 100,000,000 | 103,554,000 |
| 千葉県       | 公募平成26年度第3回           | 200,000,000 | 205,896,000 |
| 千葉県       | 公募平成28年度第4回           | 200,000,000 | 200,770,000 |
| 千葉県       | 公募(20年)第8回            | 100,000,000 | 121,778,000 |
| 千葉県       | 公募(20年)第17回           | 100,000,000 | 118,395,000 |
| 群馬県       | 公募第8回                 | 100,000,000 | 102,295,000 |
| 群馬県       | 公募第12回                | 100,000,000 | 103,001,000 |
| 群馬県       | 公募(20年)第3回            | 100,000,000 | 119,896,000 |
| 岐阜県       | 公募平成26年度第1回           | 186,670,000 | 191,810,891 |
| 大分県       | 公募平成23年度第1回           | 902,000,000 | 921,438,100 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第92回                | 110,000,000 | 111,394,800 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第93回                | 300,000,000 | 304,920,000 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第94回                | 300,000,000 | 305,199,000 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第96回                | 100,000,000 | 102,012,000 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第101回               | 300,000,000 | 306,231,000 |

|                |        |               |               |
|----------------|--------|---------------|---------------|
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第102 | 150,000,000   | 153,178,500   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第103 | 100,000,000   | 102,144,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第104 | 200,000,000   | 204,590,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第108 | 200,000,000   | 205,146,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第110 | 200,000,000   | 204,832,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第111 | 200,000,000   | 204,952,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第112 | 100,000,000   | 102,395,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第113 | 800,000,000   | 818,272,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第114 | 243,700,000   | 249,780,315   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第115 | 100,000,000   | 102,507,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第116 | 200,000,000   | 205,150,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第118 | 100,000,000   | 102,844,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第119 | 200,000,000   | 205,548,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第120 | 300,000,000   | 307,239,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第121 | 100,000,000   | 102,065,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第122 | 400,000,000   | 409,172,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第124 | 100,000,000   | 103,517,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第126 | 100,000,000   | 103,261,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第128 | 300,000,000   | 308,286,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第129 | 100,000,000   | 103,032,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第130 | 100,000,000   | 103,311,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第132 | 100,000,000   | 102,979,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第136 | 200,000,000   | 205,896,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第137 | 200,000,000   | 205,530,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第139 | 155,000,000   | 159,247,000   |
| 共同発行市場地方債<br>回 | 公募第143 | 540,000,000   | 552,933,000   |
|                |        | 1,000,000,000 | 1,022,270,000 |

|                     |             |             |  |
|---------------------|-------------|-------------|--|
| 共同発行市場地方債 公募第145回   |             |             |  |
| 共同発行市場地方債 公募第156回   | 100,000,000 | 100,451,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第157回   | 300,000,000 | 300,978,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第161回   | 300,000,000 | 300,624,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第172回   | 200,000,000 | 202,942,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第184回   | 100,000,000 | 101,175,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第190回   | 410,000,000 | 413,981,100 |  |
| 堺市 公募平成22年度第1回      | 100,000,000 | 120,641,000 |  |
| 堺市 公募平成22年度第2回      | 100,000,000 | 101,639,000 |  |
| 堺市 公募平成26年度第1回      | 100,000,000 | 130,930,000 |  |
| 島根県 公募平成22年度第1回     | 100,000,000 | 101,332,000 |  |
| 島根県 公募平成28年度第3回     | 100,000,000 | 100,013,000 |  |
| 佐賀県 公募平成28年度第1回     | 100,000,000 | 100,332,000 |  |
| 福島県 公募平成26年度第1回     | 200,000,000 | 205,068,000 |  |
| 滋賀県 公募平成25年度第1回     | 100,000,000 | 102,728,000 |  |
| 滋賀県 公募平成26年度第1回     | 142,000,000 | 145,598,280 |  |
| 栃木県 公募平成24年度第1回     | 100,000,000 | 102,553,000 |  |
| 栃木県 公募平成25年度第1回     | 100,000,000 | 102,728,000 |  |
| 新潟市 公募平成25年度第1回     | 233,200,000 | 240,375,564 |  |
| 新潟市 公募平成29年度第1回     | 100,000,000 | 101,398,000 |  |
| 奈良県 公募平成28年度第1回     | 100,000,000 | 100,013,000 |  |
| 浜松市 公募平成26年度第1回     | 100,000,000 | 101,748,000 |  |
| 大阪市 公募平成25年度第6回     | 100,000,000 | 102,901,000 |  |
| 大阪市 公募平成26年度第5回     | 100,000,000 | 102,947,000 |  |
| 大阪市 公募（5年）平成28年度第5回 | 100,000,000 | 100,013,000 |  |
| 大阪市 公募（15年）第1回      | 100,000,000 | 111,800,000 |  |
| 大阪市 公募（20年）第1回      | 300,000,000 | 355,374,000 |  |
| 大阪市 公募（20年）第5回      | 100,000,000 | 121,739,000 |  |
| 大阪市 公募（20年）第6回      | 100,000,000 | 119,924,000 |  |
| 大阪市 公募（20年）第17回     | 100,000,000 | 120,454,000 |  |
| 名古屋市 公募第478回        | 100,000,000 | 102,688,000 |  |
| 名古屋市 公募第481回        | 100,000,000 | 102,446,000 |  |
| 名古屋市 公募第488回        | 300,000,000 | 308,883,000 |  |
| 名古屋市 公募（12年）第1回     | 200,000,000 | 211,822,000 |  |
| 名古屋市 公募（15年）第2回     | 100,000,000 | 108,046,000 |  |
| 京都市 公募平成23年度第4回     | 100,000,000 | 102,457,000 |  |
| 京都市 公募平成29年度第4回     | 101,280,000 | 102,925,800 |  |
| 京都市 公募（20年）第2回      | 100,000,000 | 112,697,000 |  |

|          |                    |             |             |  |
|----------|--------------------|-------------|-------------|--|
| 京都市      | 公募(20年)第13回        | 100,000,000 | 117,884,000 |  |
| 神戸市      | 公募平成26年度第17回       | 300,000,000 | 304,365,000 |  |
| 神戸市      | 公募平成28年度第1回        | 200,000,000 | 200,650,000 |  |
| 横浜市      | 公募平成22年度第5回        | 100,000,000 | 101,611,000 |  |
| 横浜市      | 公募公債平成24年度2回       | 200,000,000 | 205,072,000 |  |
| 横浜市      | 公募公債平成25年度1回       | 200,000,000 | 204,892,000 |  |
| 横浜市      | 公募公債平成25年度5回       | 200,000,000 | 205,456,000 |  |
| 横浜市      | 公募公債平成26年度5回       | 200,000,000 | 204,856,000 |  |
| 横浜市      | 公募平成28年度第5回        | 300,000,000 | 304,335,000 |  |
| 横浜市      | 公募平成29年度第3回        | 100,000,000 | 101,433,000 |  |
| 横浜市      | 公募(30年)第2回         | 200,000,000 | 270,902,000 |  |
| 横浜市      | 公募(20年)第18回        | 100,000,000 | 120,845,000 |  |
| 横浜市      | 公募(20年)第26回        | 100,000,000 | 121,301,000 |  |
| 横浜市      | 公募(20年)第30回        | 100,000,000 | 118,019,000 |  |
| 札幌市      | 公募(15年)平成23年度第9回   | 100,000,000 | 110,814,000 |  |
| 札幌市      | 公募(20年)平成24年度第11回  | 100,000,000 | 121,643,000 |  |
| 札幌市      | 公募平成26年度第4回        | 100,000,000 | 102,560,000 |  |
| 札幌市      | 公募平成26年度第9回        | 200,000,000 | 204,440,000 |  |
| 川崎市      | 公募第85回             | 100,000,000 | 102,367,000 |  |
| 川崎市      | 公募(20年)第17回        | 100,000,000 | 118,346,000 |  |
| 北九州市     | 公募(20年)第14回        | 100,000,000 | 120,433,000 |  |
| 福岡市      | 公募(20年)平成23年度第4回   | 100,000,000 | 120,986,000 |  |
| 福岡市      | 公募平成26年度第2回        | 100,000,000 | 119,275,000 |  |
| 福岡市      | 公募平成26年度第5回        | 100,000,000 | 102,719,000 |  |
| 福岡市      | 公募平成26年度第8回        | 160,000,000 | 164,035,200 |  |
| 広島市      | 公募平成26年度第2回        | 100,000,000 | 102,363,000 |  |
| 広島市      | 公募平成27年度第2回        | 500,000,000 | 514,135,000 |  |
| 広島市      | 公募(10年)平成30年度第6回   | 241,000,000 | 243,041,270 |  |
| 千葉市      | 公募平成24年度第1回        | 100,000,000 | 102,701,000 |  |
| 三重県      | 公募平成24年度第1回        | 140,660,000 | 144,190,566 |  |
| 三重県      | 公募平成28年度第1回        | 155,000,000 | 156,466,300 |  |
| 鹿児島県     | 公募(5年)平成28年度第1回    | 100,000,000 | 100,012,000 |  |
| 福井県      | 公募平成22年度第2回        | 100,000,000 | 102,294,000 |  |
| 福井県      | 公募平成24年度第4回        | 100,000,000 | 101,667,000 |  |
| 福井県      | 公募平成27年度第4回        | 200,000,000 | 200,720,000 |  |
| 徳島県      | 公募平成22年度第1回        | 400,000,000 | 405,228,000 |  |
| 山梨県      | 公募平成24年度第1回        | 200,000,000 | 205,026,000 |  |
| 岡山県      | 公募平成28年度第2回        | 168,900,000 | 171,053,475 |  |
| 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 | 120,847,000 |  |

|                             |             |                             |                |                |      |
|-----------------------------|-------------|-----------------------------|----------------|----------------|------|
| 小計                          |             | 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    | 367,497,000    |      |
|                             |             | 福岡北九州高速道路債券 第117回           | 100,000,000    | 120,109,000    |      |
|                             |             | 福岡北九州高速道路債券 第136回           | 100,000,000    | 107,783,000    |      |
|                             |             | 銘柄数：255<br>組入時価比率：6.8%      | 42,722,820,000 | 45,117,949,332 | 6.9% |
|                             | 合計          |                             |                | 45,117,949,332 |      |
| 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    | 103,747,000    |      |
|                             |             | 新関西国際空港債券 政府保証第1回           | 151,000,000    | 155,039,250    |      |
|                             |             | 新関西国際空港債券 政府保証第2回           | 191,000,000    | 198,095,650    |      |
|                             |             | 新関西国際空港社債 財投機関債第12回         | 100,000,000    | 109,426,000    |      |
|                             |             | 新関西国際空港社債 財投機関債第22回         | 200,000,000    | 200,170,000    |      |
|                             |             | 日本政策投資銀行債券 政府保証第22回         | 100,000,000    | 108,697,000    |      |
|                             |             | 日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回        | 300,000,000    | 307,071,000    |      |
|                             |             | 日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回        | 100,000,000    | 109,300,000    |      |
|                             |             | 日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回        | 300,000,000    | 303,720,000    |      |
|                             |             | 日本政策投資銀行社債 財投機関債第96回        | 100,000,000    | 100,997,000    |      |
|                             |             | 日本政策投資銀行社債 政府保証第16回         | 102,000,000    | 104,839,680    |      |
|                             |             | 日本政策投資銀行社債 政府保証第19回         | 159,000,000    | 163,283,460    |      |
|                             |             | 日本政策投資銀行社債 政府保証第38回         | 1,500,000,000  | 1,504,980,000  |      |
|                             |             | 日本政策投資銀行社債 政府保証第42回         | 300,000,000    | 304,329,000    |      |
|                             |             | 道路債券 財投機関債第17回              | 300,000,000    | 315,141,000    |      |
|                             |             | 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    | 138,743,000    |      |
|                             |             | 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    | 231,244,000    |      |
|                             |             | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第17回 | 100,000,000    | 116,165,000    |      |
|                             |             | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第23回 | 200,000,000    | 236,376,000    |      |
|                             |             | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第33回 | 200,000,000    | 335,318,000    |      |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第39回 | 200,000,000 | 241,012,000                 |                |                |      |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第47回 | 100,000,000 | 122,084,000                 |                |                |      |

|                              |             |             |  |
|------------------------------|-------------|-------------|--|
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第80回  | 100,000,000 | 102,480,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第84回  | 400,000,000 | 410,216,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第86回  | 200,000,000 | 204,722,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第89回  | 100,000,000 | 120,323,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第100回 | 200,000,000 | 205,120,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第102回 | 100,000,000 | 102,335,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第103回 | 350,000,000 | 424,809,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第105回 | 100,000,000 | 123,557,000 |  |
| 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 | 103,080,000 |  |
| 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 | 205,212,000 |  |
| 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 | 204,916,000 |  |
| 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 | 205,616,000 |  |
| 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 | 383,793,000 |  |
| 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 | 129,940,000 |  |
| 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 | 108,115,000 |  |
| 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 | 105,892,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第6回   | 100,000,000 | 102,960,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第9回   | 100,000,000 | 103,114,000 |  |
| 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 | 242,002,000 |  |
| 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 | 242,658,000 |  |
| 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 | 245,120,000 |  |
| 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 | 244,054,000 |  |
| 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 | 240,748,000 |  |
| 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 | 137,956,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第137回 | 840,000,000 | 859,908,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第149回 | 140,000,000 | 143,445,400 |  |
|                              | 100,000,000 | 102,402,000 |  |

|                              |               |               |  |
|------------------------------|---------------|---------------|--|
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回 |               |               |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回 | 140,000,000   | 143,465,000   |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第163回 | 1,000,000,000 | 1,027,280,000 |  |
| 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   | 134,227,000   |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回 | 100,000,000   | 102,710,000   |  |
| 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   | 120,129,000   |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回 | 218,000,000   | 223,842,400   |  |
| 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   | 119,306,000   |  |
| 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   | 409,632,000   |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第173回 | 200,000,000   | 205,618,000   |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回 | 200,000,000   | 205,598,000   |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第180回 | 200,000,000   | 205,502,000   |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回 | 900,000,000   | 928,539,000   |  |
| 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   | 122,102,000   |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回 | 196,000,000   | 200,541,320   |  |
| 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   | 410,436,000   |  |
| 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 | 1,037,230,000 |  |
| 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   | 282,058,560   |  |
| 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   | 310,161,000   |  |
| 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   | 141,621,010   |  |
| 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   | 149,877,800   |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第216回 | 100,000,000   | 120,550,000   |  |
| 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   | 134,044,000   |  |
| 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   | 120,603,000   |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回 | 100,000,000   | 103,542,000   |  |
| 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   | 134,365,000   |  |
|                              | 190,000,000   | 196,102,800   |  |

|                              |             |             |  |
|------------------------------|-------------|-------------|--|
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回 |             |             |  |
| 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 | 102,663,000 |  |
| 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 | 579,405,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第271回 | 151,000,000 | 151,487,730 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第321回 | 500,000,000 | 507,005,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第335回 | 100,000,000 | 114,645,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第342回 | 131,000,000 | 132,845,790 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第351回 | 100,000,000 | 101,452,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第354回 | 200,000,000 | 202,628,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第13回  | 130,000,000 | 138,984,300 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第28回  | 400,000,000 | 553,192,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第33回  | 100,000,000 | 140,049,000 |  |
| 公営企業債券 30年第4回財投機関債           | 100,000,000 | 139,879,000 |  |
| 地方公営企業等金融機構債券(20年) 第1回       | 100,000,000 | 118,300,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 20年第4回          | 100,000,000 | 120,788,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F16回            | 100,000,000 | 114,525,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 20年第6回          | 300,000,000 | 367,485,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F24回            | 100,000,000 | 105,910,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第27回            | 300,000,000 | 306,156,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第28回            | 500,000,000 | 510,840,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F104回           | 100,000,000 | 107,020,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F106回           | 100,000,000 | 105,657,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F122回           | 100,000,000 | 110,425,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第37回         | 604,000,000 | 620,658,320 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第37回            | 400,000,000 | 409,488,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第38回         | 194,000,000 | 199,187,560 |  |
|                              | 500,000,000 | 530,955,000 |  |

|                                 |             |             |  |
|---------------------------------|-------------|-------------|--|
| 地方公共団体金融機構債券 F 1 3<br>2 回       |             |             |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 3 9 回      | 100,000,000 | 102,641,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 4 0 回      | 101,000,000 | 103,801,740 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 4 1 回      | 102,000,000 | 104,822,340 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第 4 1<br>回         | 600,000,000 | 615,006,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F 1 4<br>2 回       | 100,000,000 | 105,119,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F 1 4<br>4 回       | 200,000,000 | 201,320,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F 1 4<br>5 回       | 200,000,000 | 211,306,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F 1 4<br>7 回       | 100,000,000 | 109,144,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 4 2 回      | 108,000,000 | 111,108,240 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第 4 2<br>回         | 100,000,000 | 102,569,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 4 3 回      | 202,000,000 | 207,502,480 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 4 4 回      | 145,000,000 | 149,555,900 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第 4 4<br>回         | 100,000,000 | 102,666,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 4 5 回      | 223,000,000 | 230,020,040 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F 1 6<br>0 回       | 100,000,000 | 108,419,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 4 9 回      | 13,000,000  | 13,479,180  |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 5 0 回      | 100,000,000 | 103,872,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第 5 1<br>回         | 600,000,000 | 619,818,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第 5 2<br>回         | 300,000,000 | 310,797,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券( 1 5<br>年) 第 2 回   | 200,000,000 | 219,876,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 5 6 回      | 591,000,000 | 612,695,610 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 5 9 回      | 116,000,000 | 120,063,480 |  |
| 地方公共団体金融機構債券( 2 0<br>年) 第 3 8 回 | 100,000,000 | 119,452,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F 2 4<br>0 回       | 300,000,000 | 330,081,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 6 4 回      | 100,000,000 | 102,913,000 |  |
|                                 | 100,000,000 | 102,773,000 |  |

|                         |             |             |  |
|-------------------------|-------------|-------------|--|
| 地方公共団体金融機構債券 第64回       |             |             |  |
| 地方公共団体金融機構債券(20年) 第39回  | 100,000,000 | 118,844,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第65回    | 400,000,000 | 411,752,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第69回    | 320,000,000 | 327,843,200 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第72回    | 189,000,000 | 194,874,120 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第74回       | 300,000,000 | 308,487,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第77回       | 100,000,000 | 102,764,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第78回    | 509,000,000 | 521,994,770 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第79回       | 400,000,000 | 411,168,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券(8年) 第5回 | 500,000,000 | 505,800,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第83回    | 116,000,000 | 116,378,160 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第101回      | 400,000,000 | 405,312,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第110回   | 100,000,000 | 101,316,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第113回   | 110,000,000 | 111,931,600 |  |
| 公営企業債券(20年) 第2回財投機関債    | 100,000,000 | 104,750,000 |  |
| 公営企業債券(20年) 第5回財投機関債    | 200,000,000 | 216,954,000 |  |
| 公営企業債券(20年) 第25回財投機関債   | 100,000,000 | 121,131,000 |  |
| 首都高速道路 第17回             | 200,000,000 | 200,160,000 |  |
| 都市再生債券 財投機関債第55回        | 100,000,000 | 102,189,000 |  |
| 都市再生債券 財投機関債第96回        | 200,000,000 | 205,776,000 |  |
| 都市再生債券 財投機関債第97回        | 100,000,000 | 109,200,000 |  |
| 都市再生債券 財投機関債第109回       | 100,000,000 | 108,767,000 |  |
| 本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回      | 100,000,000 | 112,616,000 |  |
| 民間都市開発推進機構 政府保証第16回     | 360,000,000 | 371,746,800 |  |
| 東京交通債券 第342回            | 200,000,000 | 213,272,000 |  |
| 東京交通債券 第347回            | 157,000,000 | 170,987,130 |  |
| 関西国際空港社債 財投機関債第32回      | 100,000,000 | 102,372,000 |  |
| 福祉医療機構債券 第31回財投機関債      | 100,000,000 | 102,584,000 |  |
| 中部国際空港債券 政府保証第18回       | 368,000,000 | 377,969,120 |  |

|                        |               |               |  |
|------------------------|---------------|---------------|--|
| 預金保険機構債券 政府保証第209回     | 2,000,000,000 | 2,005,200,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回    | 200,000,000   | 232,640,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回   | 100,000,000   | 108,639,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回   | 100,000,000   | 110,487,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回   | 100,000,000   | 120,415,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第73回   | 100,000,000   | 102,263,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回   | 100,000,000   | 122,564,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回   | 300,000,000   | 334,509,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回   | 100,000,000   | 122,594,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第79回   | 100,000,000   | 102,179,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第86回   | 200,000,000   | 204,266,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回   | 200,000,000   | 222,432,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第120回  | 100,000,000   | 122,335,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回  | 100,000,000   | 141,895,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第132回  | 200,000,000   | 217,042,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第137回  | 100,000,000   | 110,691,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第143回  | 100,000,000   | 109,969,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第177回  | 250,000,000   | 256,797,500   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第198回  | 200,000,000   | 201,524,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第223回  | 100,000,000   | 103,701,000   |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第244回  | 130,000,000   | 132,078,700   |  |
| 成田国際空港 第10回            | 100,000,000   | 102,229,000   |  |
| 成田国際空港 第13回一般担保付       | 200,000,000   | 205,458,000   |  |
| 成田国際空港 第17回            | 200,000,000   | 204,612,000   |  |
| 沖縄振興開発金融公庫債券 財投機関債第17回 | 100,000,000   | 102,178,000   |  |
| 商工債券 利付第806回い号         | 300,000,000   | 300,651,000   |  |
| 商工債券 利付第811回い号         | 300,000,000   | 301,188,000   |  |
| 商工債券 利付第815回い号         | 100,000,000   | 100,429,000   |  |
| 商工債券 利付第818回い号         | 100,000,000   | 100,448,000   |  |

|                             |               |               |
|-----------------------------|---------------|---------------|
| 商工債券 利付第819回い号              | 300,000,000   | 301,485,000   |
| しんきん中金債券 利付第316回            | 100,000,000   | 100,101,000   |
| しんきん中金債券 利付第317回            | 800,000,000   | 800,720,000   |
| しんきん中金債券 利付第327回            | 200,000,000   | 200,228,000   |
| しんきん中金債券 利付第335回            | 200,000,000   | 200,532,000   |
| 商工債券 利付(3年)第223回            | 500,000,000   | 500,995,000   |
| 商工債券 利付(10年)第15回            | 200,000,000   | 203,278,000   |
| 国際協力機構債券 第6回財投機関債           | 100,000,000   | 122,255,000   |
| 東日本高速道路 第34回                | 100,000,000   | 100,368,000   |
| 東日本高速道路 第36回                | 200,000,000   | 200,266,000   |
| 中日本高速道路 第63回                | 100,000,000   | 103,053,000   |
| 中日本高速道路 第66回                | 1,200,000,000 | 1,200,864,000 |
| 西日本高速道路 第20回                | 200,000,000   | 205,880,000   |
| 西日本高速道路 第22回                | 400,000,000   | 412,736,000   |
| 西日本高速道路 第23回                | 100,000,000   | 102,684,000   |
| 西日本高速道路 第30回                | 300,000,000   | 301,995,000   |
| 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   | 103,017,000   |
| 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   | 205,580,000   |
| 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   | 118,717,000   |
| 貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券           | 9,900,000     | 9,912,573     |
| 貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券          | 33,978,000    | 34,505,338    |
| 貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券          | 62,425,000    | 64,272,155    |
| 貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券          | 62,952,000    | 63,352,374    |
| 貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券         | 38,979,000    | 40,082,105    |
| 貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券          | 43,104,000    | 45,327,735    |
| 貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券         | 13,433,000    | 14,004,305    |
| 貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券          | 28,974,000    | 30,152,082    |
| 貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券          | 33,016,000    | 34,893,289    |
| 貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券          | 37,020,000    | 38,111,349    |
| 貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券          | 61,252,000    | 63,697,179    |
| 貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券          | 63,535,000    | 65,767,619    |
| 貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券          | 57,284,000    | 60,378,481    |

|                        |             |             |
|------------------------|-------------|-------------|
| 貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券    | 96,534,000  | 101,492,951 |
| 貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券    | 15,861,000  | 16,655,794  |
| 貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券   | 24,519,000  | 26,777,445  |
| 貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券   | 82,539,000  | 89,303,071  |
| 貸付債権担保5種第16回住宅金融支援機構債券 | 17,566,000  | 18,045,024  |
| 貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券   | 87,842,000  | 93,486,726  |
| 貸付債権担保5種第17回住宅金融支援機構債券 | 35,410,000  | 36,397,230  |
| 貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券   | 106,173,000 | 113,871,604 |
| 貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券   | 77,490,000  | 82,509,802  |
| 貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券   | 44,226,000  | 47,945,406  |
| 貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券   | 98,430,000  | 105,492,352 |
| 貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券   | 109,392,000 | 115,426,062 |
| 貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券   | 146,286,000 | 154,912,485 |
| 貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券   | 143,148,000 | 152,501,290 |
| 貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券   | 92,150,000  | 97,814,460  |
| 貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券   | 35,747,000  | 38,137,401  |
| 貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券   | 84,766,000  | 90,726,745  |
| 貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券   | 47,956,000  | 50,431,968  |
| 貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券   | 102,320,000 | 107,581,294 |
| 貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券   | 46,404,000  | 48,739,049  |
| 貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券     | 26,342,000  | 27,191,002  |
| 貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券   | 138,987,000 | 147,151,096 |
| 貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券   | 30,629,000  | 33,125,569  |
| 貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券   | 32,375,000  | 35,052,736  |
| 貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券   | 32,453,000  | 34,824,989  |
| 貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券   | 34,948,000  | 37,504,795  |
|                        | 93,756,000  | 99,975,773  |

|                        |             |             |  |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券   |             |             |  |
| 貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券   | 134,178,000 | 143,024,355 |  |
| 貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券   | 44,624,000  | 47,607,114  |  |
| 貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券   | 90,112,000  | 95,178,997  |  |
| 貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券    | 12,474,000  | 12,821,899  |  |
| 貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券 | 75,435,000  | 76,982,171  |  |
| 貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券 | 30,774,000  | 31,397,788  |  |
| 貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券   | 86,576,000  | 93,581,729  |  |
| 貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券   | 87,684,000  | 94,451,451  |  |
| 貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券   | 173,510,000 | 183,877,222 |  |
| 貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券   | 94,382,000  | 100,749,953 |  |
| 貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券   | 154,332,000 | 163,318,752 |  |
| 貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券   | 134,733,000 | 141,526,237 |  |
| 貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券   | 104,506,000 | 111,149,446 |  |
| 貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券   | 89,234,000  | 94,471,143  |  |
| 貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券   | 216,136,000 | 227,078,965 |  |
| 貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券   | 377,384,000 | 395,962,614 |  |
| 貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券   | 56,691,000  | 59,356,610  |  |
| 貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券   | 59,306,000  | 62,134,896  |  |
| 貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券   | 60,531,000  | 63,182,863  |  |
| 貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券   | 126,044,000 | 130,868,964 |  |
| 貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券   | 132,054,000 | 136,180,687 |  |
| 貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券   | 71,117,000  | 74,081,867  |  |
| 貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券   | 74,710,000  | 77,637,884  |  |
| 貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券   | 221,895,000 | 231,687,226 |  |
| 貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券   | 226,929,000 | 237,991,788 |  |
|                        | 151,860,000 | 159,147,761 |  |

|     |     |                            |                |                        |  |
|-----|-----|----------------------------|----------------|------------------------|--|
|     |     | 貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券       |                |                        |  |
|     |     | 貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券      | 74,670,000     | 78,071,965             |  |
|     |     | 貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券      | 74,979,000     | 78,600,485             |  |
|     |     | 貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券      | 265,494,000    | 271,223,360            |  |
|     |     | 貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券      | 177,988,000    | 182,558,731            |  |
|     |     | 貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券      | 179,058,000    | 183,521,915            |  |
|     |     | 貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券      | 89,748,000     | 92,104,782             |  |
|     |     | 貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券      | 179,806,000    | 184,425,216            |  |
|     |     | 貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券      | 90,660,000     | 92,475,919             |  |
|     |     | 貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券      | 90,832,000     | 92,835,753             |  |
|     |     | 貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券      | 92,029,000     | 94,252,420             |  |
|     |     | 貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券      | 369,588,000    | 377,523,054            |  |
|     |     | 貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券      | 278,835,000    | 285,501,944            |  |
|     |     | 貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券      | 186,402,000    | 190,596,045            |  |
|     |     | 貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券      | 187,900,000    | 192,875,592            |  |
|     |     | 貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券      | 192,306,000    | 196,171,350            |  |
|     |     | 貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券      | 96,265,000     | 98,299,079             |  |
|     |     | 貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券      | 96,582,000     | 98,884,514             |  |
|     |     | 貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券      | 97,771,000     | 99,608,117             |  |
|     |     | 貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券      | 295,143,000    | 299,682,299            |  |
|     |     | 貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券      | 297,294,000    | 302,279,620            |  |
|     | 小計  | 銘柄数：289<br>組入時価比率：8.8%     | 54,781,662,000 | 58,065,386,385<br>8.9% |  |
|     | 合計  |                            |                | 58,065,386,385         |  |
| 社債券 | 日本円 | フランス相互信用連合銀行(BFCM)第14回円貨社債 | 200,000,000    | 201,882,000            |  |
|     |     | ピー・ピー・シー・イー・エス・エー第11回円貨社債  | 100,000,000    | 100,430,000            |  |
|     |     | ピー・ピー・シー・イー・エス・エー第14回円貨社債  | 100,000,000    | 100,765,000            |  |

|                                     |             |             |  |
|-------------------------------------|-------------|-------------|--|
| ビー・ピー・シー・イー・エス・<br>エー 第1回非上位円貨社債    | 200,000,000 | 201,268,000 |  |
| クレディ・アグリコル・エス・<br>エー 第6回円貨社債(2014)  | 100,000,000 | 103,283,000 |  |
| クレディ・アグリコル・エス・<br>エー 第15回円貨社債(2018) | 100,000,000 | 99,917,000  |  |
| クレディ・アグリコル・エス・<br>エー 第16回円貨社債(2018) | 100,000,000 | 101,426,000 |  |
| スタンダード・チャータード 第3<br>回円貨社債(2015)     | 100,000,000 | 101,572,000 |  |
| エイチエスピーシー・ホールディン<br>グス・ピーエルシー 第2回円  | 100,000,000 | 102,258,000 |  |
| エイチエスピーシー・ホールディン<br>グス・ピーエルシー 第3回円  | 100,000,000 | 104,836,000 |  |
| ロイズ・バンキング・グループ・<br>ピーエルシー 第1回円貨社債   | 100,000,000 | 100,425,000 |  |
| ロイズ・バンキング・グループ・<br>ピーエルシー 第6回円貨社債   | 100,000,000 | 100,143,000 |  |
| ロイズ・バンキング・グループ・<br>ピーエルシー 第7回円貨社債   | 100,000,000 | 99,403,000  |  |
| サンタンデル銀行 第1回円貨社<br>債                | 100,000,000 | 100,457,000 |  |
| フランス電力 第4回円貨社債(2<br>017)            | 100,000,000 | 103,839,000 |  |
| 現代キャピタル・サービス・イン<br>ク 第15回円貨社債       | 200,000,000 | 201,974,000 |  |
| ビー・エヌ・ビー・パリバ 第1回<br>円貨社債(2017)      | 100,000,000 | 102,240,000 |  |
| ウエストバック・バンキング・コー<br>ポレーション 第12回円貨社  | 200,000,000 | 201,270,000 |  |
| オーストラリア・ニュージーランド<br>銀行 第10回円貨社債     | 200,000,000 | 201,218,000 |  |
| ソシエテ・ジェネラル 第1回非上<br>位円貨社債(2017)     | 100,000,000 | 100,217,000 |  |
| 大和ハウス工業 第5回特定社債間<br>限定同順位特約付        | 100,000,000 | 100,682,000 |  |
| 大和ハウス工業 第9回社債間限定<br>同順位特約付          | 100,000,000 | 102,060,000 |  |
| 森永乳業 第13回社債間限定同順<br>位特約付            | 100,000,000 | 103,472,000 |  |
| 明治ホールディングス 第8回社債<br>間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 100,105,000 |  |
| アサヒグループホールディングス<br>第8回特定社債間限定同順位特   | 100,000,000 | 100,762,000 |  |
| キリンホールディングス 第10回<br>社債間限定同順位特約付     | 200,000,000 | 204,850,000 |  |
| 味の素 第24回特定社債間限定同<br>順位特約付           | 200,000,000 | 200,896,000 |  |
| 日本たばこ産業 第13回                        | 100,000,000 | 101,458,000 |  |
| トヨタ紡織 第2回社債間限定同順<br>位特約付            | 100,000,000 | 102,572,000 |  |
| 野村不動産ホールディングス 第5<br>回社債間限定同順位特約付    | 100,000,000 | 104,030,000 |  |

|                                     |             |             |  |
|-------------------------------------|-------------|-------------|--|
| 森ヒルズリート投資法人 第17回<br>特定投資法人債間限定同順位特  | 200,000,000 | 200,628,000 |  |
| 森ビル 第23回社債間限定同順位<br>特約付             | 100,000,000 | 103,980,000 |  |
| 東急不動産ホールディングス 第2<br>回社債間限定同順位特約付    | 100,000,000 | 103,224,000 |  |
| 東レ 第33回社債間限定同順位特<br>約付              | 100,000,000 | 101,462,000 |  |
| 日本土地建物 第4回社債間限定同<br>順位特約付           | 200,000,000 | 205,476,000 |  |
| 王子ホールディングス 第34回社<br>債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 101,761,000 |  |
| レンゴー 第18回特定社債間限定<br>同順位特約付          | 100,000,000 | 100,767,000 |  |
| 住友化学 第56回社債間限定同順<br>位特約付            | 100,000,000 | 101,535,000 |  |
| 三井化学 第47回社債間限定同順<br>位特約付            | 100,000,000 | 100,474,000 |  |
| 三井化学 第48回社債間限定同順<br>位特約付            | 100,000,000 | 101,273,000 |  |
| 三菱ケミカルホールディングス 第<br>14回社債間限定同順位特約付  | 200,000,000 | 201,466,000 |  |
| 電通 第1回社債間限定同順位特約<br>付               | 100,000,000 | 100,184,000 |  |
| 電通 第3回社債間限定同順位特約<br>付               | 100,000,000 | 102,400,000 |  |
| ツムラ 第1回社債間限定同順位特<br>約付              | 100,000,000 | 100,537,000 |  |
| 第一三共 第4回社債間限定同順位<br>特約付             | 100,000,000 | 103,094,000 |  |
| 楽天 第13回社債間限定同順位特<br>約付              | 100,000,000 | 100,672,000 |  |
| JXホールディングス 第9回社債<br>間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 103,273,000 |  |
| 横浜ゴム 第10回社債間限定同順<br>位特約付            | 100,000,000 | 100,641,000 |  |
| 住友ゴム工業 第24回社債間限定<br>同順位特約付          | 100,000,000 | 103,101,000 |  |
| 日本特殊陶業 第8回社債間限定同<br>順位特約付           | 100,000,000 | 100,133,000 |  |
| 新日鐵住金 第7回社債間限定同順<br>位特約付            | 100,000,000 | 100,095,000 |  |
| 新日鐵住金 第8回社債間限定同順<br>位特約付            | 100,000,000 | 100,474,000 |  |
| 新日鐵住金 第9回社債間限定同順<br>位特約付            | 100,000,000 | 101,405,000 |  |
| 新日本製鐵 第67回社債間限定同<br>順位特約付           | 100,000,000 | 101,912,000 |  |
| 神戸製鋼所 第62回社債間限定同<br>順位特約付           | 100,000,000 | 100,512,000 |  |
| ジェイ エフ イー ホールディン<br>グス 第22回(JFEス保証) | 100,000,000 | 102,733,000 |  |
|                                     | 100,000,000 | 100,260,000 |  |

|                                    |             |             |  |
|------------------------------------|-------------|-------------|--|
| DOWAホールディングス 第4回<br>社債間限定同順位特約付    |             |             |  |
| 住友電気工業 第26回社債間限定<br>同順位特約付         | 200,000,000 | 202,672,000 |  |
| 日立製作所 第17回社債間限定同<br>順位特約付          | 200,000,000 | 221,512,000 |  |
| 三菱電機 第45回社債間限定同順<br>位特約付           | 100,000,000 | 100,642,000 |  |
| 日本電産 第3回社債間限定同順位<br>特約付            | 100,000,000 | 102,708,000 |  |
| 日本電気 第48回社債間限定同順<br>位特約付           | 100,000,000 | 101,618,000 |  |
| 富士通 第34回社債間限定同順位<br>特約付            | 100,000,000 | 100,676,000 |  |
| パナソニック 第16回社債間限定<br>同順位特約付         | 100,000,000 | 100,743,000 |  |
| パナソニック 第17回社債間限定<br>同順位特約付         | 200,000,000 | 203,830,000 |  |
| ソニー 第32回                           | 200,000,000 | 201,568,000 |  |
| 東海理化電機製作所 第1回社債間<br>限定同順位特約付       | 100,000,000 | 101,532,000 |  |
| 三菱重工業 第26回社債間限定同<br>順位特約付          | 100,000,000 | 103,071,000 |  |
| 三菱重工業 第35回社債間限定同<br>順位特約付          | 100,000,000 | 101,181,000 |  |
| J A三井リース 第7回社債間限定<br>同順位特約付        | 100,000,000 | 100,307,000 |  |
| J A三井リース 第8回社債間限定<br>同順位特約付        | 100,000,000 | 100,766,000 |  |
| 三井住友トラスト・パナソニック<br>ファイナンス 第2回社債間限定 | 100,000,000 | 100,429,000 |  |
| トヨタ自動車 第14回社債間限定<br>同等特約付          | 100,000,000 | 103,275,000 |  |
| アイシン精機 第15回社債間限定<br>同順位特約付         | 100,000,000 | 102,422,000 |  |
| ドンキホーテホールディングス 第<br>12回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,761,000 |  |
| ニコン 第20回特定社債間限定同<br>順位特約付          | 100,000,000 | 101,433,000 |  |
| 大日本印刷 第3回社債間限定同順<br>位特約付           | 100,000,000 | 101,673,000 |  |
| 伊藤忠商事 第59回社債間限定同<br>順位特約付          | 200,000,000 | 204,626,000 |  |
| 丸紅 第101回社債間限定同順位<br>特約付            | 100,000,000 | 100,705,000 |  |
| 豊田通商 第18回社債間限定同順<br>位特約付           | 100,000,000 | 105,460,000 |  |
| 豊田通商 第19回社債間限定同順<br>位特約付           | 200,000,000 | 210,696,000 |  |
| 三井物産 第71回社債間限定同順<br>位特約付           | 100,000,000 | 109,323,000 |  |
| 住友商事 第45回社債間限定同順<br>位特約付           | 100,000,000 | 102,772,000 |  |

|                              |             |             |  |
|------------------------------|-------------|-------------|--|
| 住友商事 第49回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 109,740,000 |  |
| 高島屋 第11回社債間限定同順位特約付          | 200,000,000 | 201,520,000 |  |
| 丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付       | 200,000,000 | 202,436,000 |  |
| クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 103,250,000 |  |
| クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 103,211,000 |  |
| 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 | 102,783,000 |  |
| りそなホールディングス 第11回社債間限定同順位特約付  | 100,000,000 | 99,953,000  |  |
| 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 | 100,276,000 |  |
| 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 | 206,108,000 |  |
| 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 | 117,855,000 |  |
| 東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付     | 100,000,000 | 106,718,000 |  |
| 三菱東京UFJ銀行 第119回特定社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 101,112,000 |  |
| 三菱東京UFJ銀行 第159回特定社債間限定同順位特約付 | 200,000,000 | 201,140,000 |  |
| 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 | 307,365,000 |  |
| 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 | 103,043,000 |  |
| 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 | 108,811,000 |  |
| 三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付           | 100,000,000 | 102,532,000 |  |
| 三井住友信託銀行 第1回劣後特約付            | 300,000,000 | 310,227,000 |  |
| セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 102,443,000 |  |
| セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 101,884,000 |  |
| 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 | 205,526,000 |  |
| 三井住友銀行 第24回劣後特約付             | 100,000,000 | 102,527,000 |  |
| 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 | 101,118,000 |  |
| リコーリース 第28回社債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 101,355,000 |  |
| アコム 第76回特定社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 99,970,000  |  |
| アコム 第77回特定社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 100,153,000 |  |
| ジャックス 第12回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 101,027,000 |  |

|                                 |             |             |  |
|---------------------------------|-------------|-------------|--|
| ジャックス 第19回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 100,433,000 |  |
| 日立キャピタル 第52回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 100,780,000 |  |
| 日立キャピタル 第57回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 102,223,000 |  |
| 三菱UFJリース 第52回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 101,585,000 |  |
| 三菱UFJリース 第55回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 100,016,000 |  |
| 三菱UFJリース 第30回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 100,711,000 |  |
| 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 | 103,898,000 |  |
| 三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無          | 100,000,000 | 106,543,000 |  |
| 三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無         | 100,000,000 | 102,596,000 |  |
| 三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無         | 100,000,000 | 100,845,000 |  |
| 東京建物 第25回社債間限定同順位特約付            | 100,000,000 | 101,621,000 |  |
| ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 101,742,000 |  |
| 住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 103,693,000 |  |
| 住友不動産 第97回社債間限定同順位特約付           | 200,000,000 | 206,888,000 |  |
| 住友不動産 第100回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 103,194,000 |  |
| 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 | 103,753,000 |  |
| 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 | 120,310,000 |  |
| 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 | 103,025,000 |  |
| 東武鉄道 第102回社債間限定同順位特約付           | 200,000,000 | 215,188,000 |  |
| 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 | 204,640,000 |  |
| 東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 102,567,000 |  |
| 東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 112,877,000 |  |
| 小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付           | 200,000,000 | 219,150,000 |  |
| 小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 105,207,000 |  |
| 東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付         | 200,000,000 | 211,566,000 |  |
| 東日本旅客鉄道 第39回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 111,245,000 |  |
|                                 | 200,000,000 | 241,038,000 |  |

|                               |             |             |  |
|-------------------------------|-------------|-------------|--|
| 東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付       |             |             |  |
| 東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 118,952,000 |  |
| 東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 110,726,000 |  |
| 東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 123,011,000 |  |
| 東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 122,590,000 |  |
| 西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付       | 300,000,000 | 352,692,000 |  |
| 西日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 102,062,000 |  |
| 東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付        | 200,000,000 | 243,122,000 |  |
| 東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 114,015,000 |  |
| 東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 129,210,000 |  |
| 東京地下鉄 第22回                    | 100,000,000 | 100,763,000 |  |
| 東京地下鉄 第23回                    | 100,000,000 | 105,973,000 |  |
| 東京地下鉄 第24回                    | 100,000,000 | 114,795,000 |  |
| 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 | 207,286,000 |  |
| 名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 105,147,000 |  |
| 日本通運 第11回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 100,586,000 |  |
| 日本通運 第12回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 103,471,000 |  |
| 日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 112,914,000 |  |
| 横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 102,330,000 |  |
| 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 | 104,703,000 |  |
| 三菱倉庫 第14回                     | 100,000,000 | 100,610,000 |  |
| 澁澤倉庫 第8回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 100,508,000 |  |
| 日本電信電話 第60回                   | 100,000,000 | 101,648,000 |  |
| K D D I 第20回社債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 103,088,000 |  |
| 東京電力 第548回                    | 100,000,000 | 113,937,000 |  |
| 東京電力 第560回                    | 100,000,000 | 112,273,000 |  |
| 中部電力 第500回                    | 200,000,000 | 207,268,000 |  |
| 中部電力 第524回                    | 100,000,000 | 101,978,000 |  |
| 中部電力 第530回                    | 200,000,000 | 201,028,000 |  |
| 関西電力 第484回                    | 100,000,000 | 101,085,000 |  |
| 関西電力 第496回                    | 100,000,000 | 103,888,000 |  |

|                      |             |             |
|----------------------|-------------|-------------|
| 関西電力 第497回           | 200,000,000 | 209,104,000 |
| 関西電力 第511回           | 100,000,000 | 101,013,000 |
| 関西電力 第514回           | 200,000,000 | 201,046,000 |
| 関西電力 第527回           | 200,000,000 | 201,288,000 |
| 中国電力 第330回           | 100,000,000 | 103,219,000 |
| 中国電力 第377回           | 400,000,000 | 416,388,000 |
| 中国電力 第378回           | 100,000,000 | 103,722,000 |
| 中国電力 第400回           | 100,000,000 | 101,060,000 |
| 北陸電力 第301回           | 100,000,000 | 103,828,000 |
| 北陸電力 第304回           | 100,000,000 | 103,660,000 |
| 北陸電力 第307回           | 100,000,000 | 105,843,000 |
| 北陸電力 第308回           | 100,000,000 | 103,207,000 |
| 東北電力 第473回           | 100,000,000 | 100,906,000 |
| 東北電力 第475回           | 100,000,000 | 103,201,000 |
| 東北電力 第481回           | 200,000,000 | 206,920,000 |
| 東北電力 第484回           | 100,000,000 | 104,535,000 |
| 四国電力 第281回           | 200,000,000 | 208,118,000 |
| 九州電力 第424回           | 300,000,000 | 314,007,000 |
| 九州電力 第428回           | 105,000,000 | 108,990,000 |
| 九州電力 第449回           | 200,000,000 | 202,678,000 |
| 九州電力 第451回           | 100,000,000 | 101,505,000 |
| 北海道電力 第323回          | 100,000,000 | 109,624,000 |
| 北海道電力 第338回          | 100,000,000 | 105,036,000 |
| 電源開発 第37回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 101,811,000 |
| 電源開発 第39回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 103,631,000 |
| 電源開発 第40回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 103,681,000 |
| 電源開発 第41回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 103,230,000 |
| 電源開発 第59回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 101,607,000 |
| 東京電力パワーグリッド 第2回      | 100,000,000 | 100,817,000 |
| 東京電力パワーグリッド 第6回      | 100,000,000 | 101,203,000 |
| 東京電力パワーグリッド 第11回     | 300,000,000 | 301,143,000 |
| 東京電力パワーグリッド 第14回     | 100,000,000 | 100,287,000 |
| 東京瓦斯 第34回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 102,153,000 |
| 東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 135,019,000 |
| 東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 99,280,000  |
| 大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 104,539,000 |
| 東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 105,116,000 |

|    |                              |                |                 |      |
|----|------------------------------|----------------|-----------------|------|
|    | 北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000    | 100,378,000     |      |
|    | 広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000    | 101,211,000     |      |
|    | 東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000    | 100,478,000     |      |
|    | ファーストリテイリング 第3回特定社債間限定同順位特約付 | 100,000,000    | 101,381,000     |      |
|    | ファーストリテイリング 第4回特定社債間限定同順位特約付 | 100,000,000    | 103,807,000     |      |
|    | 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    | 101,384,000     |      |
| 小計 | 銘柄数：210<br>組入時価比率：4.1%       | 26,005,000,000 | 26,983,713,000  | 4.1% |
| 合計 |                              |                | 26,983,713,000  |      |
| 合計 |                              |                | 654,406,728,847 |      |

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(2019年 9月 6日現在)

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産の部            |                |
| 流動資産            |                |
| 預金              | 1,528,638,807  |
| コール・ローン         | 745,129,183    |
| 国債証券            | 59,079,308,478 |
| 派生商品評価勘定        | 2,736,396      |
| 未収入金            | 609,245,639    |
| 未収利息            | 314,494,899    |
| 前払費用            | 21,763,411     |
| 差入委託証拠金         | 273,299        |
| 流動資産合計          | 62,301,590,112 |
| 資産合計            | 62,301,590,112 |
| 負債の部            |                |
| 流動負債            |                |
| 派生商品評価勘定        | 411,388,986    |
| 未払金             | 2,518,228,916  |
| 未払解約金           | 95,692,199     |
| 未払利息            | 1,239          |
| その他未払費用         | 715,000        |
| 流動負債合計          | 3,026,026,340  |
| 負債合計            | 3,026,026,340  |
| 純資産の部           |                |
| 元本等             |                |
| 元本              | 48,914,123,681 |
| 剰余金             |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 10,361,440,091 |

(2019年 9月 6日現在)

|         |                |
|---------|----------------|
| 元本等合計   | 59,275,563,772 |
| 純資産合計   | 59,275,563,772 |
| 負債純資産合計 | 62,301,590,112 |

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

(貸借対照表に関する注記)

| 2019年 9月 6日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 1.2118円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (12,118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 2018年 9月 7日<br>至 2019年 9月 6日 |  |
|--------------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針                | <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> |
| 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク       |  |

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 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

| 2019年 9月 6日現在  |  |
|--|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額                                   |  |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ |  |
| ん。   |  |
| 2. 時価の算定方法   |  |
| 国債証券   |  |
| (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。                       |  |
| 派生商品評価勘定   |  |
| デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。                        |  |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務                                  |  |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており |  |
| ます。  |  |

### (その他の注記)

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2019年 9月 6日現在                      |                 |
|------------------------------------|-----------------|
| 期首                                 | 2018年 9月 7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   | 44,861,179,119円 |
| 同期中における追加設定元本額                     | 21,801,595,426円 |
| 同期中における一部解約元本額                     | 17,748,650,864円 |
| 期末元本額                              | 48,914,123,681円 |
| 期末元本額の内訳*                          |                 |
| 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型      | 937,425,045円    |
| 野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型           | 728,486,830円    |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型 | 17,679,500円     |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型 | 4,514,688円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型 | 2,801,950円      |

|                                      |                 |
|--------------------------------------|-----------------|
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型   | 1,749,200円      |
| 野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)        | 3,501,353,488円  |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                    | 16,264,826円     |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                    | 6,037,756円      |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                    | 14,347,908円     |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                    | 2,609,439円      |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                    | 4,361,107円      |
| 野村外国債券インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)        | 31,138,171,459円 |
| 野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け) | 9,316,909,600円  |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型             | 3,001,008,891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)     | 220,401,994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(2019年9月6日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2019年9月6日現在)

| 種類   | 通貨  | 銘柄               | 券面総額         | 評価額          | 備考 |
|------|-----|------------------|--------------|--------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | US TREASURY BOND | 70,000.00    | 82,826.94    |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 2,000,000.00 | 2,087,187.40 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 610,000.00   | 778,893.75   |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 2,680,000.00 | 3,592,351.32 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 1,800,000.00 | 2,436,890.58 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 2,280,000.00 | 3,031,865.56 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 20,000.00    | 26,329.68    |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 80,000.00    | 105,987.49   |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 510,000.00   | 593,512.50   |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 3,450,000.00 | 4,606,288.89 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 1,800,000.00 | 1,806,328.08 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 2,000,000.00 | 1,993,359.20 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 1,400,000.00 | 1,394,312.50 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 1,700,000.00 | 1,700,199.07 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 1,000,000.00 | 1,003,281.20 |    |

|                 |              |              |  |
|-----------------|--------------|--------------|--|
| US TREASURY N/B | 2,200,000.00 | 2,222,257.62 |  |
| US TREASURY N/B | 2,100,000.00 | 2,158,980.39 |  |
| US TREASURY N/B | 3,580,000.00 | 3,596,781.25 |  |
| US TREASURY N/B | 4,000,000.00 | 4,045,468.40 |  |
| US TREASURY N/B | 3,700,000.00 | 3,683,234.19 |  |
| US TREASURY N/B | 3,000,000.00 | 3,020,038.80 |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00 | 995,859.30   |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,035,390.60 |  |
| US TREASURY N/B | 3,500,000.00 | 3,532,812.50 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,037,265.60 |  |
| US TREASURY N/B | 2,900,000.00 | 2,874,625.00 |  |
| US TREASURY N/B | 6,150,000.00 | 6,214,622.97 |  |
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00 | 1,533,456.90 |  |
| US TREASURY N/B | 4,000,000.00 | 3,965,624.80 |  |
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00 | 1,517,109.30 |  |
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00 | 1,486,992.15 |  |
| US TREASURY N/B | 2,100,000.00 | 2,157,175.65 |  |
| US TREASURY N/B | 1,700,000.00 | 1,716,070.27 |  |
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00 | 1,490,390.55 |  |
| US TREASURY N/B | 800,000.00   | 822,718.72   |  |
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00 | 1,511,250.00 |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00 | 1,004,453.10 |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00 | 1,010,625.00 |  |
| US TREASURY N/B | 600,000.00   | 607,171.86   |  |
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00 | 1,508,906.25 |  |
| US TREASURY N/B | 3,200,000.00 | 3,221,000.00 |  |
| US TREASURY N/B | 3,000,000.00 | 3,019,921.80 |  |
| US TREASURY N/B | 3,400,000.00 | 3,423,109.12 |  |
| US TREASURY N/B | 2,700,000.00 | 2,748,937.50 |  |
| US TREASURY N/B | 1,200,000.00 | 1,208,906.16 |  |
| US TREASURY N/B | 3,000,000.00 | 3,045,234.30 |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00 | 1,011,015.60 |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00   | 301,359.36   |  |
| US TREASURY N/B | 3,100,000.00 | 3,136,327.97 |  |
| US TREASURY N/B | 700,000.00   | 708,695.26   |  |

|                 |              |              |  |
|-----------------|--------------|--------------|--|
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00 | 1,518,867.15 |  |
| US TREASURY N/B | 2,150,000.00 | 2,160,581.87 |  |
| US TREASURY N/B | 2,260,000.00 | 2,308,554.51 |  |
| US TREASURY N/B | 110,000.00   | 111,985.14   |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00 | 1,039,062.50 |  |
| US TREASURY N/B | 1,100,000.00 | 1,101,632.73 |  |
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00 | 1,515,820.20 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,012,031.20 |  |
| US TREASURY N/B | 2,500,000.00 | 2,491,601.50 |  |
| US TREASURY N/B | 3,500,000.00 | 3,471,562.50 |  |
| US TREASURY N/B | 1,200,000.00 | 1,247,625.00 |  |
| US TREASURY N/B | 3,000,000.00 | 2,990,859.30 |  |
| US TREASURY N/B | 2,500,000.00 | 2,623,632.75 |  |
| US TREASURY N/B | 700,000.00   | 704,812.50   |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00 | 1,051,953.10 |  |
| US TREASURY N/B | 3,000,000.00 | 3,081,796.80 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,115,468.60 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,065,781.20 |  |
| US TREASURY N/B | 3,000,000.00 | 3,101,250.00 |  |
| US TREASURY N/B | 3,400,000.00 | 3,589,390.54 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,059,062.40 |  |
| US TREASURY N/B | 3,500,000.00 | 3,585,859.20 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,071,875.00 |  |
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00 | 1,571,015.55 |  |
| US TREASURY N/B | 4,000,000.00 | 4,101,250.00 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,028,125.00 |  |
| US TREASURY N/B | 3,000,000.00 | 3,094,921.80 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,040,312.40 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,065,312.40 |  |
| US TREASURY N/B | 4,000,000.00 | 4,158,124.80 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,056,562.40 |  |
| US TREASURY N/B | 800,000.00   | 828,312.48   |  |
| US TREASURY N/B | 2,780,000.00 | 2,861,010.86 |  |
| US TREASURY N/B | 600,000.00   | 643,125.00   |  |
| US TREASURY N/B | 1,640,000.00 | 1,712,775.00 |  |

|                 |              |              |  |
|-----------------|--------------|--------------|--|
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,015,000.00 |  |
| US TREASURY N/B | 4,200,000.00 | 4,231,500.00 |  |
| US TREASURY N/B | 3,800,000.00 | 3,797,921.78 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,067,343.60 |  |
| US TREASURY N/B | 700,000.00   | 736,367.17   |  |
| US TREASURY N/B | 1,800,000.00 | 1,912,359.24 |  |
| US TREASURY N/B | 3,200,000.00 | 3,372,749.76 |  |
| US TREASURY N/B | 600,000.00   | 632,953.08   |  |
| US TREASURY N/B | 4,200,000.00 | 4,600,968.54 |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00 | 1,107,734.30 |  |
| US TREASURY N/B | 2,100,000.00 | 2,330,507.76 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,266,718.60 |  |
| US TREASURY N/B | 3,000,000.00 | 3,277,734.30 |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00   | 729,453.10   |  |
| US TREASURY N/B | 340,000.00   | 507,025.00   |  |
| US TREASURY N/B | 2,060,000.00 | 2,938,879.63 |  |
| US TREASURY N/B | 400,000.00   | 507,250.00   |  |
| US TREASURY N/B | 2,300,000.00 | 3,206,163.89 |  |
| US TREASURY N/B | 2,150,000.00 | 3,151,765.62 |  |
| US TREASURY N/B | 2,340,000.00 | 3,134,320.25 |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00   | 449,437.50   |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00   | 603,906.25   |  |
| US TREASURY N/B | 800,000.00   | 968,187.44   |  |
| US TREASURY N/B | 700,000.00   | 918,257.76   |  |
| US TREASURY N/B | 1,800,000.00 | 1,967,625.00 |  |
| US TREASURY N/B | 2,540,000.00 | 3,035,300.00 |  |
| US TREASURY N/B | 2,760,000.00 | 3,227,043.61 |  |
| US TREASURY N/B | 3,020,000.00 | 3,615,270.08 |  |
| US TREASURY N/B | 1,530,000.00 | 1,673,317.85 |  |
| US TREASURY N/B | 3,400,000.00 | 3,717,953.04 |  |
| US TREASURY N/B | 2,230,000.00 | 2,323,381.25 |  |
| US TREASURY N/B | 2,400,000.00 | 2,817,562.32 |  |
| US TREASURY N/B | 2,020,000.00 | 2,322,210.78 |  |
| US TREASURY N/B | 3,600,000.00 | 4,338,281.16 |  |
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00 | 1,851,093.75 |  |

|        |                          |                |                |                  |
|--------|--------------------------|----------------|----------------|------------------|
| 小計     | US TREASURY N/B          | 500,000.00     | 603,867.15     |                  |
|        | 銘柄数：121                  | 242,860,000.00 | 259,952,726.34 | (27,833,138,409) |
|        | 組入時価比率：47.0%             |                |                | 47.2%            |
| カナダドル  | CANADIAN GOVERNMENT      | 2,570,000.00   | 2,540,599.20   |                  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT      | 2,000,000.00   | 1,955,880.00   |                  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT      | 1,000,000.00   | 1,013,650.00   |                  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT      | 800,000.00     | 805,016.00     |                  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT      | 1,060,000.00   | 1,118,914.80   |                  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT      | 1,000,000.00   | 1,015,650.00   |                  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT      | 330,000.00     | 492,838.50     |                  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT      | 400,000.00     | 424,780.00     |                  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT      | 620,000.00     | 871,844.00     |                  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT      | 200,000.00     | 309,520.00     |                  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT      | 400,000.00     | 619,808.00     |                  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT      | 780,000.00     | 1,137,271.20   |                  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT      | 1,040,000.00   | 1,347,944.00   |                  |
| 小計     | 銘柄数：13                   | 12,200,000.00  | 13,653,715.70  | (1,104,858,674)  |
|        | 組入時価比率：1.9%              |                |                | 1.9%             |
| メキシコペソ | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 9,200,000.00   | 9,130,908.00   |                  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 2,800,000.00   | 2,816,277.52   |                  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 15,000,000.00  | 14,859,150.00  |                  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 14,000,000.00  | 13,155,380.00  |                  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 10,100,000.00  | 10,427,543.00  |                  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 3,100,000.00   | 3,264,207.00   |                  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 6,000,000.00   | 7,594,380.00   |                  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 5,000,000.00   | 5,599,400.00   |                  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 4,300,000.00   | 4,599,480.38   |                  |
|        | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 9,300,000.00   | 9,690,042.00   |                  |
| 小計     | 銘柄数：10                   | 78,800,000.00  | 81,136,767.90  | (440,572,649)    |
|        | 組入時価比率：0.7%              |                |                | 0.7%             |
| ユーロ    | BELGIUM KINGDOM          | 300,000.00     | 314,225.40     |                  |
|        | BELGIUM KINGDOM          | 340,000.00     | 375,462.00     |                  |
|        | BELGIUM KINGDOM          | 500,000.00     | 561,900.00     |                  |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| BELGIUM KINGDOM          | 700,000.00   | 801,080.00   |
| BELGIUM KINGDOM          | 200,000.00   | 223,047.40   |
| BELGIUM KINGDOM          | 400,000.00   | 415,800.00   |
| BELGIUM KINGDOM          | 230,000.00   | 266,271.00   |
| BELGIUM KINGDOM          | 700,000.00   | 740,310.20   |
| BELGIUM KINGDOM          | 800,000.00   | 881,688.00   |
| BELGIUM KINGDOM          | 950,000.00   | 1,040,685.10 |
| BELGIUM KINGDOM          | 800,000.00   | 890,592.24   |
| BELGIUM KINGDOM          | 1,200,000.00 | 1,357,819.32 |
| BELGIUM KINGDOM          | 550,000.00   | 833,849.88   |
| BELGIUM KINGDOM          | 200,000.00   | 241,621.80   |
| BELGIUM KINGDOM          | 420,000.00   | 543,897.48   |
| BELGIUM KINGDOM          | 300,000.00   | 540,182.40   |
| BELGIUM KINGDOM          | 550,000.00   | 985,735.30   |
| BELGIUM KINGDOM          | 200,000.00   | 252,635.00   |
| BELGIUM KINGDOM          | 200,000.00   | 257,274.80   |
| BELGIUM KINGDOM          | 170,000.00   | 248,783.61   |
| BELGIUM KINGDOM GOVT     | 370,000.00   | 648,937.45   |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 420,000.00   | 446,211.78   |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,500,000.00 | 1,512,808.50 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 730,000.00   | 748,023.70   |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 500,000.00   | 506,290.50   |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,490,000.00 | 1,719,570.40 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 900,000.00   | 925,290.00   |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 900,000.00   | 1,079,238.33 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 300,000.00   | 308,434.74   |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,940,000.00 | 2,324,626.34 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,120,000.00 | 1,335,488.00 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,400,000.00 | 1,617,838.60 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 500,000.00   | 642,221.70   |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,120,000.00 | 1,271,630.08 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,000,000.00 | 1,095,433.00 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,300,000.00 | 1,446,770.00 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,100,000.00 | 1,230,350.00 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 900,000.00   | 1,001,394.36 |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,600,000.00 | 1,780,640.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 330,000.00   | 483,417.00   |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,000,000.00 | 1,179,389.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 900,000.00   | 1,118,160.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,000,000.00 | 1,751,290.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 800,000.00   | 1,531,320.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,150,000.00 | 1,632,507.80 |  |
| BUNDES OblIGATION        | 1,700,000.00 | 1,723,545.00 |  |
| BUNDES OblIGATION        | 1,700,000.00 | 1,731,841.00 |  |
| BUNDES OblIGATION        | 1,100,000.00 | 1,141,602.00 |  |
| BUNDES OblIGATION        | 1,000,000.00 | 1,041,230.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 750,000.00   | 772,845.00   |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 850,000.00   | 908,199.50   |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,300,000.00 | 1,399,112.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,310,000.00 | 1,428,699.10 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 700,000.00   | 781,648.00   |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 400,000.00   | 526,224.00   |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 610,000.00   | 683,120.70   |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 700,000.00   | 780,010.00   |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 440,000.00   | 481,760.40   |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 900,000.00   | 978,822.00   |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 300,000.00   | 317,097.00   |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,270,000.00 | 1,368,691.70 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,300,000.00 | 2,058,082.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 850,000.00   | 935,459.00   |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,000,000.00 | 1,103,700.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 400,000.00   | 424,284.00   |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,100,000.00 | 1,884,234.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 700,000.00   | 1,256,352.72 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00   | 177,782.00   |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 510,000.00   | 979,725.30   |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 60,000.00    | 124,254.18   |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 750,000.00   | 1,351,485.45 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,100,000.00 | 1,827,414.16 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,110,000.00 | 1,891,240.20 |  |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 200,000.00   | 275,664.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 460,000.00   | 479,356.80   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,800,000.00 | 1,820,916.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 170,000.00   | 180,381.73   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 700,000.00   | 746,886.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3,000,000.00 | 3,037,230.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 710,000.00   | 780,211.90   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 500,000.00   | 526,000.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,450,000.00 | 1,467,037.50 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 700,000.00   | 723,520.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,030,000.00 | 1,068,625.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 500,000.00   | 513,450.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 900,000.00   | 939,948.30   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00   | 234,280.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,400,000.00 | 2,471,520.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 150,000.00   | 173,877.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,500,000.00 | 1,636,305.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,000,000.00 | 1,020,600.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 180,000.00   | 245,430.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,200,000.00 | 2,612,500.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 500,000.00   | 583,800.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 700,000.00   | 739,690.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 500,000.00   | 555,000.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 350,000.00   | 436,915.50   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 330,000.00   | 359,865.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 550,000.00   | 587,620.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,600,000.00 | 2,718,040.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3,100,000.00 | 3,449,990.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 800,000.00   | 882,480.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,040,000.00 | 2,741,556.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 500,000.00   | 597,350.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,000,000.00 | 1,411,100.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 700,000.00   | 1,069,740.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00   | 105,510.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,070,000.00 | 1,225,471.00 |  |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,110,000.00 | 1,640,025.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 500,000.00   | 558,050.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,080,000.00 | 1,471,716.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 400,000.00   | 482,240.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 150,000.00   | 231,990.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 300,000.00   | 464,310.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,180,000.00 | 3,384,450.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 960,000.00   | 1,229,472.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 300,000.00   | 351,420.00   |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 10,000.00    | 11,540.00    |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 190,000.00   | 192,203.81   |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 300,000.00   | 306,207.60   |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 300,000.00   | 322,040.10   |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 150,000.00   | 162,354.75   |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 200,000.00   | 225,510.00   |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 310,000.00   | 332,075.72   |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 740,000.00   | 950,202.92   |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 200,000.00   | 236,589.00   |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 160,000.00   | 252,477.60   |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 3,000,000.00 | 3,041,310.00 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 500,000.00   | 509,819.50   |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 3,500,000.00 | 3,834,817.00 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 800,000.00   | 826,080.00   |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 3,010,000.00 | 3,437,802.27 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 500,000.00   | 517,403.50   |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 400,000.00   | 426,509.60   |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 700,000.00   | 750,050.00   |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 1,250,000.00 | 1,319,450.00 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 800,000.00   | 892,040.00   |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 2,300,000.00 | 2,530,782.00 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 1,700,000.00 | 1,872,941.00 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 1,020,000.00 | 1,322,847.48 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 1,350,000.00 | 1,597,050.00 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 660,000.00   | 850,324.20   |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 1,810,000.00 | 2,521,981.60 |  |

|                         |              |              |  |
|-------------------------|--------------|--------------|--|
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1,140,000.00 | 1,225,135.20 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1,000,000.00 | 1,087,614.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1,320,000.00 | 1,454,069.76 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 100,000.00   | 102,250.92   |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 610,000.00   | 669,218.80   |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 800,000.00   | 969,120.00   |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 600,000.00   | 677,205.00   |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 600,000.00   | 847,674.00   |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 910,000.00   | 1,161,933.50 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1,900,000.00 | 2,405,970.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1,200,000.00 | 1,885,602.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1,640,000.00 | 1,961,708.96 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 300,000.00   | 532,991.40   |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1,490,000.00 | 2,580,486.30 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 400,000.00   | 686,460.00   |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 720,000.00   | 1,358,468.64 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1,200,000.00 | 2,025,648.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 600,000.00   | 1,293,835.20 |  |
| IRISH GOVERNMENT        | 800,000.00   | 869,992.00   |  |
| IRISH TSY 0.8% 2022     | 1,300,000.00 | 1,347,047.00 |  |
| IRISH TSY 1.7% 2037     | 550,000.00   | 660,253.00   |  |
| IRISH TSY 1% 2026       | 650,000.00   | 706,901.00   |  |
| IRISH TSY 2% 2045       | 250,000.00   | 324,839.00   |  |
| IRISH TSY 3.4% 2024     | 500,000.00   | 589,790.00   |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 500,000.00   | 538,361.50   |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 500,000.00   | 510,037.50   |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 230,000.00   | 266,823.00   |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 300,000.00   | 385,800.00   |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 300,000.00   | 330,571.20   |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 1,000,000.00 | 1,138,186.00 |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 400,000.00   | 432,340.00   |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 1,000,000.00 | 1,106,209.80 |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 600,000.00   | 910,467.60   |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 850,000.00   | 1,179,630.00 |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 610,000.00   | 1,143,642.03 |  |

|      |                        |                |                  |  |
|------|------------------------|----------------|------------------|--|
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 450,000.00     | 795,099.60       |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 10,000.00      | 14,340.00        |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 800,000.00     | 893,440.00       |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 700,000.00     | 716,467.50       |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 1,120,000.00   | 1,236,805.92     |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 300,000.00     | 327,396.60       |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 400,000.00     | 433,600.00       |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 700,000.00     | 770,735.00       |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 530,000.00     | 722,857.56       |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 230,000.00     | 395,163.69       |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 400,000.00     | 683,615.60       |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 300,000.00     | 394,140.00       |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 330,000.00     | 754,468.44       |  |
|      | REPUBLIC OF IRELAND    | 80,000.00      | 92,761.60        |  |
|      | SPANISH GOVERNMENT     | 90,000.00      | 139,237.47       |  |
|      | SPANISH GOVERNMENT     | 500,000.00     | 838,200.00       |  |
|      | SPANISH GOVERNMENT     | 410,000.00     | 646,003.38       |  |
| 小計   | 銘柄数：195                | 159,640,000.00 | 193,883,166.67   |  |
|      |                        |                | (22,889,846,657) |  |
|      | 組入時価比率：38.6%           |                | 38.7%            |  |
| 英ポンド | UK TREASURY            | 1,600,000.00   | 1,621,792.00     |  |
|      | UK TREASURY            | 920,000.00     | 1,002,312.40     |  |
|      | UK TREASURY            | 1,000,000.00   | 1,039,900.00     |  |
|      | UK TREASURY            | 900,000.00     | 911,205.00       |  |
|      | UK TREASURY            | 550,000.00     | 589,957.50       |  |
|      | UK TREASURY            | 500,000.00     | 513,210.00       |  |
|      | UK TREASURY            | 1,200,000.00   | 1,338,480.00     |  |
|      | UK TREASURY            | 1,370,000.00   | 1,471,092.30     |  |
|      | UK TREASURY            | 300,000.00     | 392,592.00       |  |
|      | UK TREASURY            | 900,000.00     | 987,858.00       |  |
|      | UK TREASURY            | 90,000.00      | 134,804.70       |  |
|      | UK TREASURY            | 300,000.00     | 308,130.00       |  |
|      | UK TREASURY            | 600,000.00     | 870,300.00       |  |
|      | UK TREASURY            | 200,000.00     | 285,740.00       |  |
|      | UK TREASURY            | 200,000.00     | 303,340.00       |  |

|            |                            |               |                 |  |
|------------|----------------------------|---------------|-----------------|--|
|            | UK TREASURY                | 1,160,000.00  | 1,753,108.00    |  |
|            | UK TREASURY                | 470,000.00    | 527,904.00      |  |
|            | UK TREASURY                | 1,550,000.00  | 2,633,450.00    |  |
|            | UK TREASURY                | 400,000.00    | 609,000.00      |  |
|            | UK TREASURY                | 2,080,000.00  | 3,600,480.00    |  |
|            | UK TREASURY                | 1,700,000.00  | 1,849,260.00    |  |
|            | UK TREASURY                | 600,000.00    | 692,700.00      |  |
|            | UK TREASURY                | 840,000.00    | 1,511,076.00    |  |
|            | UK TREASURY                | 860,000.00    | 1,486,166.00    |  |
|            | UK TREASURY                | 280,000.00    | 540,708.00      |  |
|            | UK TSY 3 1/4% 2044         | 100,000.00    | 145,100.00      |  |
|            | UNITED KINGDOM(GOVERNMENT) | 780,000.00    | 1,518,816.00    |  |
| 小計         | 銘柄数：27                     | 21,450,000.00 | 28,638,481.90   |  |
|            |                            |               | (3,778,274,917) |  |
|            | 組入時価比率：6.4%                |               | 6.4%            |  |
| スウェーデンクローネ | SWEDISH GOVERNMENT         | 600,000.00    | 642,180.00      |  |
|            | SWEDISH GOVERNMENT         | 3,500,000.00  | 3,898,650.00    |  |
|            | SWEDISH GOVERNMENT         | 3,000,000.00  | 3,269,574.00    |  |
|            | SWEDISH GOVERNMENT         | 250,000.00    | 293,725.00      |  |
|            | SWEDISH GOVERNMENT         | 2,700,000.00  | 2,982,841.20    |  |
|            | SWEDISH GOVERNMENT         | 4,000,000.00  | 4,383,683.20    |  |
|            | SWEDISH GOVERNMENT         | 1,100,000.00  | 1,816,705.00    |  |
| 小計         | 銘柄数：7                      | 15,150,000.00 | 17,287,358.40   |  |
|            |                            |               | (191,025,310)   |  |
|            | 組入時価比率：0.3%                |               | 0.3%            |  |
| ノルウェークローネ  | NORWEGIAN GOVERNMENT       | 1,050,000.00  | 1,096,882.50    |  |
|            | NORWEGIAN GOVERNMENT       | 1,900,000.00  | 1,961,370.00    |  |
|            | NORWEGIAN GOVERNMENT       | 750,000.00    | 812,025.00      |  |
|            | NORWEGIAN GOVERNMENT       | 1,700,000.00  | 1,743,010.00    |  |
|            | NORWEGIAN GOVERNMENT       | 750,000.00    | 786,000.00      |  |
|            | NORWEGIAN GOVERNMENT       | 1,500,000.00  | 1,613,250.00    |  |
| 小計         | 銘柄数：6                      | 7,650,000.00  | 8,012,537.50    |  |
|            |                            |               | (95,108,820)    |  |
|            | 組入時価比率：0.2%                |               | 0.2%            |  |
| デンマーククローネ  | KINGDOM OF DENMARK         | 1,550,000.00  | 1,570,615.00    |  |
|            | KINGDOM OF DENMARK         | 1,500,000.00  | 1,629,277.20    |  |

|               |                        |               |               |                 |
|---------------|------------------------|---------------|---------------|-----------------|
| 小計            | KINGDOM OF DENMARK     | 1,650,000.00  | 1,817,805.00  |                 |
|               | KINGDOM OF DENMARK     | 3,400,000.00  | 3,952,500.00  |                 |
|               | KINGDOM OF DENMARK     | 2,300,000.00  | 2,532,760.00  |                 |
|               | KINGDOM OF DENMARK     | 3,900,000.00  | 7,833,259.20  |                 |
|               | 銘柄数 : 6                | 14,300,000.00 | 19,336,216.40 | (306,092,305)   |
|               | 組入時価比率 : 0.5%          |               |               | 0.5%            |
| ズロチ           | POLAND GOVERNMENT BOND | 1,600,000.00  | 1,559,422.56  |                 |
|               | POLAND GOVERNMENT BOND | 4,700,000.00  | 4,723,731.24  |                 |
|               | POLAND GOVERNMENT BOND | 2,000,000.00  | 2,066,292.60  |                 |
|               | POLAND GOVERNMENT BOND | 2,800,000.00  | 3,007,200.00  |                 |
|               | POLAND GOVERNMENT BOND | 2,000,000.00  | 2,149,000.00  |                 |
|               | 銘柄数 : 5                | 13,100,000.00 | 13,505,646.40 | (367,488,638)   |
| 組入時価比率 : 0.6% |                        |               | 0.6%          |                 |
| 豪ドル           | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,420,000.00  | 1,435,084.80  |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,200,000.00  | 1,233,354.60  |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 120,000.00    | 136,584.00    |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,200,000.00  | 1,253,520.00  |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 800,000.00    | 935,508.08    |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,000,000.00  | 1,086,550.00  |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 340,000.00    | 385,576.83    |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 520,000.00    | 628,888.00    |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 820,000.00    | 1,051,889.44  |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 900,000.00    | 1,028,895.21  |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 2,820,000.00  | 3,100,308.00  |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,000,000.00  | 1,156,478.60  |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 300,000.00    | 348,120.00    |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,170,000.00  | 1,675,525.99  |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 150,000.00    | 208,280.86    |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 420,000.00    | 546,000.00    |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 300,000.00    | 372,187.83    |                 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 270,000.00    | 347,868.00    |                 |
|               | 銘柄数 : 18               | 14,750,000.00 | 16,930,620.24 | (1,234,411,521) |
|               | 組入時価比率 : 2.1%          |               |               | 2.1%            |
| 小計            |                        |               |               |                 |

|          |                          |                      |  |                                       |
|----------|--------------------------|----------------------|--|---------------------------------------|
| シンガポールドル | SINGAPORE GOVERNMENT     | 400,000.00           | 406,275.20                             |                                       |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT     | 1,030,000.00         | 1,022,275.00                           |                                       |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT     | 1,400,000.00         | 1,459,907.12                           |                                       |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT     | 400,000.00           | 414,960.00                             |                                       |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT     | 730,000.00           | 827,314.11                             |                                       |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT     | 300,000.00           | 322,933.50                             |                                       |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT     | 610,000.00           | 681,980.00                             |                                       |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT     | 700,000.00           | 737,450.00                             |                                       |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT     | 500,000.00           | 577,380.00                             |                                       |
|          | 小計                       | 銘柄数：9<br>組入時価比率：0.8% | 6,070,000.00                           | 6,450,474.93<br>(498,815,226)<br>0.8% |
| ランド      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 800,000.00           | 801,345.60                             |                                       |
|          | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 4,500,000.00         | 4,568,597.10                           |                                       |
|          | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6,900,000.00         | 7,785,091.29                           |                                       |
|          | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6,650,000.00         | 6,278,177.88                           |                                       |
|          | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 2,800,000.00         | 2,394,840.00                           |                                       |
|          | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 3,500,000.00         | 3,332,520.45                           |                                       |
|          | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8,800,000.00         | 7,976,320.00                           |                                       |
|          | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6,000,000.00         | 5,605,619.40                           |                                       |
|          | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 2,100,000.00         | 1,898,050.98                           |                                       |
|          | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7,250,000.00         | 6,536,569.55                           |                                       |
| 小計       | 銘柄数：10<br>組入時価比率：0.6%    | 49,300,000.00        | 47,177,132.25<br>(339,675,352)<br>0.6% |                                       |
| 合計       |                          |                      | 59,079,308,478<br>(59,079,308,478)     |                                       |

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

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類 | 2019年 9月 6日現在 |  |         |
|----|---------------|--|---------|
|    | 契約額等(円)       |  | 時価(円)   |
|    | うち1年超         |  |         |
|    |               |  | 評価損益(円) |
|    |               |  |         |

|            |                |   |                |             |
|------------|----------------|---|----------------|-------------|
| 市場取引以外の取引  |                |   |                |             |
| 為替予約取引     |                |   |                |             |
| 買建         | 466,643,604    | - | 469,380,000    | 2,736,396   |
| 米ドル        | 255,489,600    | - | 256,872,000    | 1,382,400   |
| ユーロ        | 211,154,004    | - | 212,508,000    | 1,353,996   |
| 売建         | 59,271,326,779 | - | 59,682,715,765 | 411,388,986 |
| 米ドル        | 27,896,844,880 | - | 28,063,938,800 | 167,093,920 |
| カナダドル      | 1,082,771,396  | - | 1,094,946,870  | 12,175,474  |
| メキシコペソ     | 420,043,327    | - | 431,943,820    | 11,900,493  |
| ユーロ        | 23,127,638,398 | - | 23,226,808,320 | 99,169,922  |
| 英ポンド       | 3,809,290,158  | - | 3,877,854,396  | 68,564,238  |
| スウェーデンクローナ | 181,361,802    | - | 184,380,300    | 3,018,498   |
| ノルウェークローネ  | 92,300,956     | - | 93,800,740     | 1,499,784   |
| デンマーククローネ  | 278,218,205    | - | 279,165,216    | 947,011     |
| ズロチ        | 360,772,927    | - | 366,171,120    | 5,398,193   |
| 豪ドル        | 1,230,407,454  | - | 1,255,880,520  | 25,473,066  |
| シンガポールドル   | 471,797,489    | - | 476,408,863    | 4,611,374   |
| ランド        | 319,879,787    | - | 331,416,800    | 11,537,013  |
| 合計         | -              | - | -              | 408,652,590 |

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 新興国債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(2019年 9月 6日現在)

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| <b>資産の部</b>     |                |
| 流動資産            |                |
| 預金              | 59,217,126     |
| コール・ローン         | 278,760,598    |
| 国債証券            | 20,764,928,758 |
| 派生商品評価勘定        | 778,712        |
| 未収入金            | 194,159,666    |
| 未収利息            | 265,276,734    |
| 前払費用            | 10,135,758     |
| 流動資産合計          | 21,573,257,352 |
| <b>資産合計</b>     |                |
| 21,573,257,352  |                |
| <b>負債の部</b>     |                |
| 流動負債            |                |
| 派生商品評価勘定        | 534,778        |
| 未払金             | 206,416,827    |
| 未払解約金           | 278,562,167    |
| 未払利息            | 463            |
| その他未払費用         | 341,300        |
| 流動負債合計          | 485,855,535    |
| <b>負債合計</b>     |                |
| 485,855,535     |                |
| <b>純資産の部</b>    |                |
| 元本等             |                |
| 元本              | 11,044,561,327 |
| 剰余金             |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 10,042,840,490 |
| 元本等合計           | 21,087,401,817 |
| <b>純資産合計</b>    |                |
| 21,087,401,817  |                |
| <b>負債純資産合計</b>  |                |
| 21,573,257,352  |                |

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

## （貸借対照表に関する注記）

| 2019年 9月 6日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 1.9093円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (19,093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 2018年 9月 7日<br>至 2019年 9月 6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

| 2019年 9月 6日現在  |
|--|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>    国債証券</p> <p>    （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>    派生商品評価勘定</p> <p>    デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>    コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>    これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2019年 9月 6日現在   |                               |
|---|-------------------------------|
| 期首  | 2018年 9月 7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  | 9,102,613,330円                |
| 同期中における追加設定元本額  | 4,446,074,686円                |
| 同期中における一部解約元本額  | 2,504,126,689円                |
| 期末元本額   | 11,044,561,327円               |
| 期末元本額の内訳*   |                               |
| 野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型<br>ネクストコア   | 1,311,801,431円<br>93,948,214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   | 608,652,963円                  |
| インデックス・ブレンド(タイプ )   | 1,687,584円                    |
| インデックス・ブレンド(タイプ )   | 1,179,573円                    |
| インデックス・ブレンド(タイプ )   | 3,744,392円                    |
| インデックス・ブレンド(タイプ )   | 1,064,436円                    |
| インデックス・ブレンド(タイプ )   | 1,681,819円                    |
| 野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)  | 1,169,435,233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)  | 2,054,007,336円                |
| NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(為替ヘッジなし)連動型上場投信<br>ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券 | 110,424,591円<br>233,545,683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)  | 9,365,898円                    |
| ノムラ新興国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)   | 3,465,685円                    |
| 新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)  | 306,289,646円                  |
| 野村新興国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)   | 4,155,347,229円                |
| 野村DC運用戦略ファンド  | 928,887,377円                  |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド)  | 50,032,237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(2019年9月6日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2019年9月6日現在)

| 種類   | 通貨  | 銘柄            | 券面総額       | 評価額        | 備考 |
|------|-----|---------------|------------|------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | ARGENT-GLOBAL | 640,000.00 | 417,246.46 |    |

|                        |              |              |
|------------------------|--------------|--------------|
| ARGENT-GLOBAL          | 420,000.00   | 266,162.86   |
| ARGENT-GLOBAL          | 2,300,000.00 | 917,148.00   |
| BRAZIL GLOBAL          | 650,000.00   | 844,187.50   |
| BRAZIL GLOBAL          | 1,070,000.00 | 1,499,348.20 |
| BRAZIL GLOBAL          | 900,000.00   | 1,173,384.00 |
| COLOMBIA GLOBAL        | 250,000.00   | 314,065.00   |
| COLOMBIA GLOBAL        | 1,220,000.00 | 1,785,787.20 |
| CROATIA                | 500,000.00   | 529,250.00   |
| CROATIA                | 1,100,000.00 | 1,227,556.00 |
| CROATIA                | 1,000,000.00 | 1,160,980.00 |
| FED REPUBLIC OF BRAZIL | 830,000.00   | 861,747.50   |
| FED REPUBLIC OF BRAZIL | 1,300,000.00 | 1,306,500.00 |
| FED REPUBLIC OF BRAZIL | 2,300,000.00 | 2,450,719.00 |
| FED REPUBLIC OF BRAZIL | 900,000.00   | 1,053,882.00 |
| FED REPUBLIC OF BRAZIL | 1,900,000.00 | 2,050,594.00 |
| FED REPUBLIC OF BRAZIL | 1,800,000.00 | 2,067,768.00 |
| FED REPUBLIC OF BRAZIL | 1,600,000.00 | 1,713,016.00 |
| FED REPUBLIC OF BRAZIL | 1,900,000.00 | 2,193,331.50 |
| HUNGARY                | 1,100,000.00 | 1,216,088.50 |
| HUNGARY                | 1,350,000.00 | 1,541,338.20 |
| HUNGARY                | 1,400,000.00 | 1,593,769.80 |
| INDONESIA GLOBAL       | 1,400,000.00 | 1,592,065.72 |
| MEXICO GLOBAL          | 1,080,000.00 | 1,470,150.00 |
| PANAMA GLOBAL          | 300,000.00   | 384,003.00   |
| PANAMA GLOBAL          | 250,000.00   | 389,377.50   |
| PANAMA GLOBAL          | 1,150,000.00 | 1,696,261.50 |
| PERU GLOBAL            | 900,000.00   | 1,161,909.00 |
| PERU GLOBAL            | 670,000.00   | 1,017,569.20 |
| PHILIPPINES GLOBAL     | 2,100,000.00 | 2,253,923.91 |
| PHILIPPINES GLOBAL     | 750,000.00   | 1,251,565.87 |
| PHILIPPINES GLOBAL     | 800,000.00   | 1,223,318.80 |
| PHILIPPINES GLOBAL     | 500,000.00   | 708,657.35   |
| REPUBLIC OF ARGENTINA  | 900,000.00   | 379,359.00   |
| REPUBLIC OF ARGENTINA  | 2,400,000.00 | 1,143,000.00 |
| REPUBLIC OF ARGENTINA  | 2,650,000.00 | 1,166,000.00 |
|                        | 600,000.00   | 251,106.00   |

|                       |              |              |  |
|-----------------------|--------------|--------------|--|
| REPUBLIC OF ARGENTINA |              |              |  |
| REPUBLIC OF ARGENTINA | 4,100,000.00 | 1,768,166.00 |  |
| REPUBLIC OF ARGENTINA | 2,300,000.00 | 960,273.00   |  |
| REPUBLIC OF ARGENTINA | 2,300,000.00 | 939,573.00   |  |
| REPUBLIC OF ARGENTINA | 1,500,000.00 | 626,250.00   |  |
| REPUBLIC OF ARGENTINA | 2,100,000.00 | 871,521.00   |  |
| REPUBLIC OF ARGENTINA | 2,150,000.00 | 924,500.00   |  |
| REPUBLIC OF ARGENTINA | 1,300,000.00 | 539,513.00   |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA  | 1,100,000.00 | 1,142,636.00 |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA  | 600,000.00   | 607,506.00   |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA  | 1,900,000.00 | 2,027,775.00 |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA  | 1,000,000.00 | 1,109,375.00 |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA  | 1,300,000.00 | 1,409,200.00 |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA  | 1,200,000.00 | 1,365,000.00 |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA  | 1,320,000.00 | 1,768,813.20 |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA  | 1,300,000.00 | 1,678,638.00 |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA  | 2,500,000.00 | 3,018,150.00 |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA  | 800,000.00   | 998,808.00   |  |
| REPUBLIC OF HUNGARY   | 1,500,000.00 | 1,596,190.50 |  |
| REPUBLIC OF HUNGARY   | 600,000.00   | 1,016,913.00 |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 600,000.00   | 625,226.58   |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 1,300,000.00 | 1,345,304.61 |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 1,300,000.00 | 1,398,771.27 |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 1,500,000.00 | 1,683,854.55 |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 700,000.00   | 776,380.64   |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 400,000.00   | 431,798.60   |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 200,000.00   | 211,159.68   |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 900,000.00   | 993,462.21   |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 1,100,000.00 | 1,282,895.90 |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 1,000,000.00 | 1,546,720.00 |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 1,200,000.00 | 1,493,108.28 |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 800,000.00   | 924,410.56   |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 800,000.00   | 1,189,146.64 |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 800,000.00   | 988,986.72   |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 800,000.00   | 1,098,880.88 |  |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| REPUBLIC OF INDONESIA    | 1,400,000.00 | 1,786,376.48 |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA    | 1,100,000.00 | 1,260,122.49 |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA    | 600,000.00   | 790,032.42   |  |
| REPUBLIC OF PANAMA       | 1,700,000.00 | 1,829,642.00 |  |
| REPUBLIC OF PANAMA       | 1,500,000.00 | 1,675,327.50 |  |
| REPUBLIC OF PANAMA       | 500,000.00   | 621,880.00   |  |
| REPUBLIC OF PANAMA       | 800,000.00   | 996,008.00   |  |
| REPUBLIC OF PERU         | 900,000.00   | 1,031,859.00 |  |
| REPUBLIC OF PERU         | 1,400,000.00 | 2,138,514.00 |  |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES  | 1,000,000.00 | 1,091,585.90 |  |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES  | 800,000.00   | 966,384.88   |  |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES  | 1,000,000.00 | 1,142,471.50 |  |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES  | 800,000.00   | 1,180,156.88 |  |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES  | 800,000.00   | 1,069,535.52 |  |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES  | 1,700,000.00 | 2,054,685.79 |  |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES  | 1,700,000.00 | 2,015,251.06 |  |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 950,000.00   | 1,019,929.50 |  |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 700,000.00   | 743,652.00   |  |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 1,350,000.00 | 1,506,384.00 |  |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 800,000.00   | 844,384.00   |  |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 1,600,000.00 | 1,613,440.00 |  |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 400,000.00   | 445,654.40   |  |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 400,000.00   | 415,136.00   |  |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 500,000.00   | 501,291.00   |  |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 700,000.00   | 747,817.00   |  |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 500,000.00   | 575,375.00   |  |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 1,100,000.00 | 1,121,604.00 |  |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 600,000.00   | 600,882.00   |  |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 1,700,000.00 | 1,738,360.50 |  |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 700,000.00   | 647,185.00   |  |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 900,000.00   | 944,660.70   |  |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 400,000.00   | 358,177.60   |  |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 1,300,000.00 | 1,190,813.00 |  |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 2,100,000.00 | 2,040,192.00 |  |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 1,100,000.00 | 1,003,359.50 |  |

|                         |              |              |  |
|-------------------------|--------------|--------------|--|
| REPUBLIC OF TURKEY      | 1,500,000.00 | 1,446,135.00 |  |
| REPUBLIC OF TURKEY      | 1,600,000.00 | 1,679,656.00 |  |
| REPUBLIC OF TURKEY      | 950,000.00   | 914,356.00   |  |
| REPUBLIC OF TURKEY      | 1,200,000.00 | 1,056,982.80 |  |
| REPUBLIC OF TURKEY      | 2,400,000.00 | 1,899,744.00 |  |
| REPUBLIC OF TURKEY      | 1,700,000.00 | 1,592,925.50 |  |
| REPUBLIC OF TURKEY      | 1,900,000.00 | 1,611,209.50 |  |
| ROMANIA                 | 1,200,000.00 | 1,326,024.00 |  |
| ROMANIA                 | 600,000.00   | 644,568.00   |  |
| ROMANIA                 | 800,000.00   | 883,256.00   |  |
| ROMANIA                 | 600,000.00   | 797,268.00   |  |
| ROMANIA                 | 600,000.00   | 711,828.00   |  |
| RUSSIA                  | 1,312,500.00 | 1,482,909.75 |  |
| RUSSIAN FEDERATION      | 1,200,000.00 | 1,274,263.20 |  |
| RUSSIAN FEDERATION      | 1,800,000.00 | 1,976,254.20 |  |
| RUSSIAN FEDERATION      | 1,800,000.00 | 1,983,499.20 |  |
| RUSSIAN FEDERATION      | 1,400,000.00 | 1,503,383.00 |  |
| RUSSIAN FEDERATION      | 1,200,000.00 | 1,304,462.40 |  |
| RUSSIAN FEDERATION      | 1,600,000.00 | 2,010,214.40 |  |
| RUSSIAN FEDERATION      | 800,000.00   | 1,039,048.00 |  |
| RUSSIAN FEDERATION      | 4,200,000.00 | 5,089,875.00 |  |
| TURKEY GLOBAL           | 1,500,000.00 | 1,485,945.00 |  |
| TURKEY GLOBAL           | 2,400,000.00 | 2,523,842.40 |  |
| TURKEY GLOBAL           | 650,000.00   | 886,112.50   |  |
| UKRAINE GOVERNMENT      | 600,000.00   | 651,477.00   |  |
| UKRAINE GOVERNMENT      | 1,200,000.00 | 1,448,254.80 |  |
| UKRAINE GOVERNMENT      | 1,600,000.00 | 1,694,755.20 |  |
| UKRAINE GOVERNMENT REGS | 609,000.00   | 639,659.49   |  |
| UKRAINE GOVERNMENT REGS | 709,000.00   | 756,999.30   |  |
| UKRAINE GOVERNMENT REGS | 700,000.00   | 755,499.50   |  |
| UKRAINE GOVERNMENT REGS | 1,200,000.00 | 1,306,650.00 |  |
| UKRAINE GOVERNMENT REGS | 1,200,000.00 | 1,298,160.00 |  |
| UNITED MEXICAN STATES   | 1,300,000.00 | 1,541,813.00 |  |
| UNITED MEXICAN STATES   | 400,000.00   | 408,128.00   |  |
| UNITED MEXICAN STATES   | 1,100,000.00 | 1,142,900.00 |  |

|    |                       |                |                  |  |
|----|-----------------------|----------------|------------------|--|
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,950,000.00   | 2,076,311.25     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,200,000.00   | 1,258,212.00     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,300,000.00   | 1,388,738.00     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 2,300,000.00   | 2,464,473.00     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,600,000.00   | 1,674,320.00     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 2,110,000.00   | 2,713,481.10     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,500,000.00   | 1,653,750.00     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,700,000.00   | 2,093,210.00     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,700,000.00   | 1,845,367.00     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,400,000.00   | 1,475,264.00     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 2,000,000.00   | 2,187,520.00     |  |
| 小計 | 銘柄数：152               | 186,940,500.00 | 193,937,879.50   |  |
|    |                       |                | (20,764,928,758) |  |
|    | 組入時価比率：98.5%          |                | 100.0%           |  |
| 合計 |                       |                | 20,764,928,758   |  |
|    |                       |                | (20,764,928,758) |  |

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

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類        | 2019年 9月 6日現在 |       |            |         |
|-----------|---------------|-------|------------|---------|
|           | 契約額等(円)       |       | 時価(円)      | 評価損益(円) |
|           |               | うち1年超 |            |         |
| 市場取引以外の取引 |               |       |            |         |
| 為替予約取引    |               |       |            |         |
| 買建        | 93,416,488    | -     | 94,195,200 | 778,712 |
| 米ドル       | 93,416,488    | -     | 94,195,200 | 778,712 |
| 売建        | 99,003,122    | -     | 99,537,900 | 534,778 |
| 米ドル       | 99,003,122    | -     | 99,537,900 | 534,778 |
| 合計        | -             | -     | -          | 243,934 |

(注)時価の算定方法

### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## J - R E I T インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

| （単位：円）          |                       |
|-----------------|-----------------------|
| (2019年 9月 6日現在) |                       |
| <b>資産の部</b>     |                       |
| 流動資産            |                       |
| コール・ローン         | 535,959,842           |
| 投資証券            | 43,597,540,850        |
| 派生商品評価勘定        | 104,029,884           |
| 未収入金            | 100,418,510           |
| 未収配当金           | 493,957,269           |
| 流動資産合計          | 44,831,906,355        |
| <b>資産合計</b>     | <b>44,831,906,355</b> |
| <b>負債の部</b>     |                       |
| 流動負債            |                       |
| 前受金             | 81,185,400            |
| 未払金             | 32,133,804            |
| 未払解約金           | 108,912,291           |
| 未払利息            | 891                   |
| 流動負債合計          | 222,232,386           |
| <b>負債合計</b>     | <b>222,232,386</b>    |
| <b>純資産の部</b>    |                       |
| 元本等             |                       |
| 元本              | 17,193,069,107        |
| 剰余金             |                       |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 27,416,604,862        |
| 元本等合計           | 44,609,673,969        |
| 純資産合計           | 44,609,673,969        |
| <b>負債純資産合計</b>  | <b>44,831,906,355</b> |

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                    |   |
|--------------------|---|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法 | 投資証券<br>原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。 |
|--------------------|---|

|                       |  |
|-----------------------|--|
| 2.費用・収益の計上基準          | <p>先物取引<br/>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>受取配当金<br/>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<br/>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<br/>約定日基準で計上しております。</p> |
| 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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> |

## (貸借対照表に関する注記)

| 2019年 9月 6日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 2.5946円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (25,946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 2018年 9月 7日<br>至 2019年 9月 6日  |
|---|
| <p>1.金融商品に対する取組方針<br/>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<br/>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、REITの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> |

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

| 2019年 9月 6日現在  |  |
|--|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額                                   |  |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ |  |
| ん。   |  |
| 2. 時価の算定方法   |  |
| 投資証券   |  |
| (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。                       |  |
| 派生商品評価勘定   |  |
| デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。                        |  |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務                                  |  |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており |  |
| ます。  |  |

### (その他の注記)

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2019年 9月 6日現在                    |                 |
|----------------------------------|-----------------|
| 期首                               | 2018年 9月 7日     |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 17,609,176,379円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 5,166,823,577円  |
| 同期中における一部解約元本額                   | 5,582,930,849円  |
| 期末元本額                            | 17,193,069,107円 |
| 期末元本額の内訳*                        |                 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース)               | 1,611,487,267円  |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース)               | 2,309,615,067円  |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース)               | 694,720,243円    |
| 野村資産設計ファンド2015                   | 16,338,373円     |
| 野村資産設計ファンド2020                   | 16,382,278円     |
| 野村資産設計ファンド2025                   | 17,860,517円     |
| 野村資産設計ファンド2030                   | 18,077,912円     |
| 野村資産設計ファンド2035                   | 16,921,663円     |
| 野村資産設計ファンド2040                   | 30,939,051円     |
| 野村資産設計ファンド2045                   | 2,889,872円      |
| 野村インデックスファンド・J-REIT              | 2,793,286,752円  |
| ネクストコア                           | 132,769,527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        | 673,147,874円   |
| 野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)           | 1,927,037,516円 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース)                 | 855,689,904円   |
| 野村資産設計ファンド2050                       | 4,375,464円     |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                    | 1,558,154円     |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                    | 864,822円       |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                    | 3,218,138円     |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                    | 1,001,867円     |
| インデックス・ブレンド(タイプ )                    | 4,517,741円     |
| 野村6資産均等バランス                          | 447,991,352円   |
| 野村世界REITインデックス Aコース(野村投資一任口座向け)      | 87,479,361円    |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT               | 95,688,163円    |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT(適格機関投資家専用) | 433,066,635円   |
| 野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)     | 1,879,822,457円 |
| J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)          | 1,719,611,354円 |
| 野村DC運用戦略ファンド                         | 1,312,067,023円 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド)                   | 76,731,254円    |
| 野村世界6資産分散投信(DC)安定コース                 | 2,479,528円     |
| 野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース               | 1,479,308円     |
| 野村世界6資産分散投信(DC)成長コース                 | 2,486,287円     |
| 野村資産設計ファンド(DC)2030                   | 638,624円       |
| 野村資産設計ファンド(DC)2040                   | 465,214円       |
| 野村資産設計ファンド(DC)2050                   | 362,545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(2019年9月6日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2019年9月6日現在)

(単位:円)

| 種類   | 通貨  | 銘柄                          | 券面総額  | 評価額         | 備考 |
|------|-----|-----------------------------|-------|-------------|----|
| 投資証券 | 日本円 | エスコンジャパンリート投資法人<br>投資証券     | 417   | 48,038,400  |    |
|      |     | サンケイリアルエステート投資法<br>人 投資証券   | 589   | 71,151,200  |    |
|      |     | 日本アコモデーションファンド投資<br>法人 投資証券 | 1,351 | 918,680,000 |    |

|                              |        |               |  |
|------------------------------|--------|---------------|--|
| MCUBS MidCity 投資法人 投資証券      | 4,824  | 542,217,600   |  |
| 森ヒルズリート投資法人 投資証券             | 4,679  | 784,200,400   |  |
| 産業ファンド投資法人 投資証券              | 5,003  | 755,453,000   |  |
| アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券         | 3,765  | 1,321,515,000 |  |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券 | 2,531  | 518,855,000   |  |
| アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券       | 2,038  | 1,071,988,000 |  |
| GLP投資法人 投資証券                 | 10,128 | 1,371,331,200 |  |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券      | 1,693  | 590,857,000   |  |
| 日本プロロジスリート投資法人 投資証券          | 5,843  | 1,692,717,100 |  |
| 星野リゾート・リート投資法人 投資証券          | 619    | 346,021,000   |  |
| Oneリート投資法人 投資証券              | 634    | 193,370,000   |  |
| イオンリート投資法人 投資証券              | 4,389  | 609,632,100   |  |
| ヒューリックリート投資法人 投資証券           | 3,305  | 630,924,500   |  |
| 日本リート投資法人 投資証券               | 1,321  | 582,561,000   |  |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券   | 26,125 | 527,463,750   |  |
| 日本ヘルスケア投資法人 投資証券             | 197    | 36,248,000    |  |
| 積水ハウス・リート投資法人 投資証券           | 11,890 | 1,095,069,000 |  |
| トーセイ・リート投資法人 投資証券            | 748    | 96,566,800    |  |
| ケネディクス商業リート投資法人 投資証券         | 1,490  | 428,077,000   |  |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券         | 867    | 118,258,800   |  |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券        | 814    | 100,691,800   |  |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券       | 12,682 | 2,393,093,400 |  |
| いちごホテルリート投資法人 投資証券           | 674    | 85,732,800    |  |
| ラサールロジポート投資法人 投資証券           | 3,375  | 507,937,500   |  |
| スターアジア不動産投資法人 投資             | 1,350  | 152,550,000   |  |

| 証券                        |        |               |  |
|---------------------------|--------|---------------|--|
| マリモ地方創生リート投資法人 投資証券       | 350    | 42,000,000    |  |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券  | 1,001  | 431,931,500   |  |
| 大江戸温泉リート投資法人 投資証券         | 691    | 60,738,900    |  |
| さくら総合リート投資法人 投資証券         | 880    | 83,424,000    |  |
| 投資法人みらい 投資証券              | 4,411  | 257,602,400   |  |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券     | 954    | 132,510,600   |  |
| 三菱地所物流リート投資法人 投資証券        | 649    | 205,733,000   |  |
| CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券   | 571    | 72,916,700    |  |
| ザイマックス・リート投資法人 投資証券       | 590    | 78,234,000    |  |
| タカラレーベン不動産投資法人 投資証券       | 1,154  | 130,979,000   |  |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券 | 629    | 68,749,700    |  |
| 日本ビルファンド投資法人 投資証券         | 3,938  | 3,091,330,000 |  |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券     | 4,067  | 2,916,039,000 |  |
| 日本リテールファンド投資法人 投資証券       | 7,686  | 1,649,415,600 |  |
| オリックス不動産投資法人 投資証券         | 8,102  | 1,891,817,000 |  |
| 日本プライムリアルティ投資法人 投資証券      | 2,574  | 1,274,130,000 |  |
| プレミア投資法人 投資証券             | 3,673  | 565,642,000   |  |
| 東急リアル・エステート投資法人 投資証券      | 2,726  | 558,284,800   |  |
| グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券      | 2,824  | 431,507,200   |  |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券      | 9,131  | 1,853,593,000 |  |
| 森トラスト総合リート投資法人 投資証券       | 2,906  | 582,653,000   |  |
| インヴィンシブル投資法人 投資証券         | 17,838 | 1,184,443,200 |  |

|    |                        |         |                          |  |
|----|------------------------|---------|--------------------------|--|
|    | 券                      |         |                          |  |
|    | フロンティア不動産投資法人 投資証券     | 1,444   | 658,464,000              |  |
|    | 平和不動産リート投資法人 投資証券      | 2,532   | 342,832,800              |  |
|    | 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | 2,657   | 733,066,300              |  |
|    | 福岡リート投資法人 投資証券         | 2,103   | 376,437,000              |  |
|    | ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券   | 1,258   | 1,035,334,000            |  |
|    | いちごオフィスリート投資法人 投資証券    | 3,149   | 334,108,900              |  |
|    | 大和証券オフィス投資法人 投資証券      | 939     | 784,065,000              |  |
|    | 阪急阪神リート投資法人 投資証券       | 1,837   | 289,511,200              |  |
|    | スターツプロシード投資法人 投資証券     | 633     | 124,764,300              |  |
|    | 大和ハウスリート投資法人 投資証券      | 5,482   | 1,603,485,000            |  |
|    | ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券  | 13,100  | 1,074,200,000            |  |
|    | 日本賃貸住宅投資法人 投資証券        | 4,574   | 460,144,400              |  |
|    | ジャパンエクセレント投資法人 投資証券    | 3,641   | 626,252,000              |  |
| 小計 | 銘柄数：63<br>組入時価比率：97.7% | 234,035 | 43,597,540,850<br>100.0% |  |
| 合計 |                        |         | 43,597,540,850           |  |

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類         | 2019年 9月 6日現在 |       |               |             |
|------------|---------------|-------|---------------|-------------|
|            | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）     |
|            |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引       |               |       |               |             |
| REIT指数先物取引 |               |       |               |             |
| 買建         | 906,920,100   | -     | 1,011,001,500 | 104,029,884 |
| 合計         | 906,920,100   | -     | 1,011,001,500 | 104,029,884 |

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

## 国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(2019年 9月 6日現在)

|                 |               |
|-----------------|---------------|
| 資産の部            |               |
| 流動資産            |               |
| 預金              | 16,875,366    |
| コール・ローン         | 81,751,887    |
| 投資証券            | 6,557,926,110 |
| 派生商品評価勘定        | 3,694,238     |
| 未収入金            | 313,318       |
| 未収配当金           | 7,357,042     |
| 差入委託証拠金         | 47,128,482    |
| 流動資産合計          | 6,715,046,443 |
| 資産合計            | 6,715,046,443 |
| 負債の部            |               |
| 流動負債            |               |
| 派生商品評価勘定        | 68,118,858    |
| 未払金             | 5,351,750     |
| 未払解約金           | 1,953,476     |
| 未払利息            | 136           |
| その他未払費用         | 253,200       |
| 流動負債合計          | 75,677,420    |
| 負債合計            | 75,677,420    |
| 純資産の部           |               |
| 元本等             |               |
| 元本              | 4,217,895,918 |
| 剰余金             |               |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 2,421,473,105 |
| 元本等合計           | 6,639,369,023 |
| 純資産合計           | 6,639,369,023 |
| 負債純資産合計         | 6,715,046,443 |

## 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<br/>原則として時価で評価しております。<br/>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<br/>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>2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準</p> <p>3. 費用・収益の計上基準</p> | <p>為替予約取引<br/>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p> <p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>受取配当金<br/>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<br/>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<br/>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<br/>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益<br/>約定日基準で計上しております。</p> |
| <p>4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p>                      | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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>  |

（貸借対照表に関する注記）

| 2019年 9月 6日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 1.5741円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (15,741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 2018年 9月 7日<br>至 2019年 9月 6日  |
|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針   |
| 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク  |

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、REIT指数先物取引を行っております。

当該デリバティブ取引は、対象とするREIT指数等に係る価格変動リスクを有しております。

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

### 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 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

| 2019年 9月 6日現在  |  |
|--|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額                                   |  |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ |  |
| ん。   |  |
| 2. 時価の算定方法   |  |
| 投資証券   |  |
| (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。                       |  |
| 派生商品評価勘定   |  |
| デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。                        |  |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務                                  |  |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており |  |
| ます。  |  |

### (その他の注記)

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2019年 9月 6日現在                    |                |
|----------------------------------|----------------|
| 期首                               | 2018年 9月 7日    |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 4,586,999,313円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 1,959,920,221円 |
| 同期中における一部解約元本額                   | 2,329,023,616円 |
| 期末元本額                            | 4,217,895,918円 |
| 期末元本額の内訳*                        |                |
| 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型    | 1,101,816,585円 |
| 野村インデックスファンド・外国REIT・為替ヘッジ型       | 655,300,676円   |
| 野村世界REITインデックス Aコース(野村投資一任口座向け)  | 1,311,053,217円 |

|                                  |                |
|----------------------------------|----------------|
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT           | 26,370,957円    |
| 野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用) | 1,123,354,483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(2019年9月6日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2019年9月6日現在)

| 種類                    | 通貨    | 銘柄                                      | 券面総額   | 評価額          | 備考 |
|-----------------------|-------|---|--------|--------------|----|
| 投資証券                  | 米ドル   | ACADIA REALTY TRUST                     | 4,100  | 115,948.00   |    |
|                       |       | AGREE REALTY CORP                       | 2,070  | 153,676.80   |    |
|                       |       | ALEXANDERS INC                          | 195    | 74,958.00    |    |
|                       |       | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT            | 5,500  | 837,045.00   |    |
|                       |       | AMERICAN ASSETS TRUST INC               | 2,240  | 106,467.20   |    |
|                       |       | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES             | 6,680  | 315,162.40   |    |
|                       |       | AMERICAN FINANCE TRUST INC              | 2,700  | 32,238.00    |    |
|                       |       | AMERICAN HOMES 4 RENT-A                 | 12,900 | 327,144.00   |    |
|                       |       | AMERICOLD REALTY TRUST                  | 9,250  | 343,637.50   |    |
|                       |       | APARTMENT INVT&MGMT CO-A                | 7,210  | 368,214.70   |    |
|                       |       | APPLE HOSPITALITY REIT INC              | 10,300 | 166,139.00   |    |
|                       |       | ASHFORD HOSPITALITY TRUST               | 4,100  | 11,808.00    |    |
|                       |       | AVALONBAY COMMUNITIES INC               | 6,770  | 1,453,586.70 |    |
|                       |       | BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH             | 1,300  | 15,613.00    |    |
|                       |       | BOSTON PROPERTIES                       | 7,460  | 966,965.20   |    |
|                       |       | BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC            | 1,300  | 11,674.00    |    |
|                       |       | BRANDYWINE REALTY TRUST                 | 8,100  | 117,207.00   |    |
|                       |       | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC              | 14,500 | 275,935.00   |    |
|                       |       | BROOKFIELD PROPERTY REIT INC<br>CLASS A | 3,800  | 73,340.00    |    |
|                       |       | BRT APARTMENTS CORP                     | 500    | 7,125.00     |    |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 4,630 | 506,985.00                              |        |              |    |

|                                       |        |              |  |
|---------------------------------------|--------|--------------|--|
| CARETRUST REIT INC ACQUIRES           | 4,400  | 106,084.00   |  |
| CBL&ASSOCIATES PROPERTIES             | 7,700  | 6,980.05     |  |
| CEDAR REALTY TRUST INC                | 5,000  | 12,150.00    |  |
| CHATHAM LODGING TRUST                 | 2,000  | 34,280.00    |  |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST              | 2,700  | 70,983.00    |  |
| CITY OFFICE REIT INC                  | 1,900  | 25,650.00    |  |
| CLIPPER REALTY INC                    | 790    | 8,342.40     |  |
| COLONY CAPITAL INC                    | 24,900 | 125,247.00   |  |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC           | 5,700  | 122,721.00   |  |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I          | 920    | 39,247.20    |  |
| CORECIVIC INC                         | 5,700  | 99,123.00    |  |
| CORESITE REALTY CORP                  | 1,730  | 206,129.50   |  |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES           | 5,600  | 165,200.00   |  |
| COUSINS PROPERTIES INC                | 6,914  | 240,745.48   |  |
| CUBESMART                             | 9,100  | 326,781.00   |  |
| CYRUSONE INC                          | 5,460  | 402,347.40   |  |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO            | 9,400  | 92,496.00    |  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC              | 10,050 | 1,273,033.50 |  |
| DOUGLAS EMMETT INC                    | 7,860  | 329,805.60   |  |
| DUKE REALTY CORP                      | 17,240 | 575,816.00   |  |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES<br>INC | 3,800  | 79,800.00    |  |
| EASTGROUP PROPERTIES                  | 1,830  | 230,488.50   |  |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST IN          | 6,500  | 91,780.00    |  |
| EPR PROPERTIES                        | 3,570  | 281,101.80   |  |
| EQUITY COMMONWEALTH                   | 5,780  | 195,421.80   |  |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES           | 4,380  | 591,300.00   |  |
| EQUITY RESIDENTIAL                    | 17,850 | 1,534,921.50 |  |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY           | 3,500  | 79,485.00    |  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC              | 3,174  | 1,030,661.28 |  |
| EXTRA SPACE STORAGE INC               | 6,220  | 753,864.00   |  |
| FARMLAND PARTNERS INC                 | 1,500  | 9,795.00     |  |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST             | 3,610  | 481,610.10   |  |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR            | 6,300  | 246,897.00   |  |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST           | 3,160  | 90,976.40    |  |

|   |        |            |  |
|---|--------|------------|--|
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C                | 4,700  | 35,861.00  |  |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP                 | 2,600  | 28,002.00  |  |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE                | 9,780  | 378,486.00 |  |
| GEO GROUP INC/THE                           | 5,600  | 99,960.00  |  |
| GETTY REALTY CORP                           | 1,630  | 51,850.30  |  |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP                   | 1,600  | 36,304.00  |  |
| GLADSTONE LAND CORP                         | 700    | 8,141.00   |  |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC                     | 1,000  | 10,830.00  |  |
| GLOBAL NET LEASE INC                        | 4,100  | 79,622.00  |  |
| HCP INC                                     | 23,300 | 823,655.00 |  |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC                 | 6,370  | 211,802.50 |  |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA                 | 9,900  | 281,853.00 |  |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST                    | 1,700  | 24,055.00  |  |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC                    | 5,180  | 225,589.00 |  |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST                | 7,800  | 194,142.00 |  |
| HOST HOTELS & RESORTS INC                   | 36,200 | 605,264.00 |  |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN                | 7,550  | 257,908.00 |  |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN                | 3,900  | 53,898.00  |  |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES             | 2,900  | 62,901.00  |  |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES<br>INC     | 500    | 44,125.00  |  |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST                 | 600    | 42,846.00  |  |
| INVITATION HOMES INC                        | 20,500 | 586,505.00 |  |
| IRON MOUNTAIN INC                           | 13,760 | 455,318.40 |  |
| JBG SMITH PROPERTIES                        | 5,870  | 229,340.90 |  |
| KILROY REALTY CORP                          | 4,890  | 379,659.60 |  |
| KIMCO REALTY CORP                           | 20,600 | 389,546.00 |  |
| KITE REALTY GROUP TRUST                     | 4,400  | 65,252.00  |  |
| LEXINGTON REALTY TRUST                      | 10,000 | 98,000.00  |  |
| LIBERTY PROPERTY TRUST                      | 7,250  | 377,580.00 |  |
| LIFE STORAGE INC                            | 2,320  | 242,022.40 |  |
| LTC PROPERTIES INC                          | 1,870  | 92,845.50  |  |
| MACERICH CO /THE                            | 5,040  | 150,192.00 |  |
| MACK-CALI REALTY CORP                       | 4,100  | 85,936.00  |  |
| MANULIFE US REAL ESTATE<br>INVESTMENT TRUST | 59,222 | 54,188.13  |  |

|  |        |              |  |
|--|--------|--------------|--|
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC           | 20,900 | 396,891.00   |  |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM             | 5,560  | 713,626.00   |  |
| MONMOUTH REIT-CLASS A                  | 4,100  | 54,120.00    |  |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC         | 7,820  | 431,898.60   |  |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES            | 2,700  | 92,178.00    |  |
| NATL HEALTH INVESTORS INC              | 2,160  | 179,301.60   |  |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP            | 3,900  | 24,570.00    |  |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC         | 1,100  | 50,556.00    |  |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP           | 2,600  | 44,148.00    |  |
| OFFICE PROPERTIES INCOME               | 2,170  | 60,412.80    |  |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS             | 10,380 | 429,628.20   |  |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC             | 750    | 20,212.50    |  |
| PARAMOUNT GROUP INC                    | 10,300 | 135,754.00   |  |
| PARK HOTELS & RESORTS INC              | 9,900  | 240,570.00   |  |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST                | 6,600  | 182,490.00   |  |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST            | 3,200  | 16,320.00    |  |
| PHYSICIANS REALTY TRUST                | 9,100  | 156,975.00   |  |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A           | 6,100  | 121,390.00   |  |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES<br>INC | 1,800  | 24,948.00    |  |
| PROLOGIS INC                           | 30,560 | 2,585,070.40 |  |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA               | 1,000  | 180,590.00   |  |
| PUBLIC STORAGE                         | 7,280  | 1,880,132.80 |  |
| QTS REALTY TRUST INC CL A              | 2,570  | 127,137.90   |  |
| REALTY INCOME CORP                     | 15,200 | 1,140,000.00 |  |
| REGENCY CENTERS CORP                   | 7,990  | 531,974.20   |  |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN           | 5,300  | 95,347.00    |  |
| RETAIL PROPERTIES OF AME-A             | 9,900  | 114,345.00   |  |
| RETAIL VALUE INC                       | 821    | 30,927.07    |  |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC          | 5,230  | 231,793.60   |  |
| RLJ LODGING TRUST                      | 8,000  | 133,200.00   |  |
| RPT REALTY                             | 3,900  | 48,984.00    |  |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES           | 2,440  | 198,713.60   |  |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC             | 9,500  | 208,810.00   |  |
| SAFEHOLD INC                           | 400    | 11,484.00    |  |

|    |                              |           |                 |  |
|----|------------------------------|-----------|-----------------|--|
|    | SAUL CENTERS INC             | 470       | 24,115.70       |  |
|    | SENIOR HOUSING PROP TRUST    | 11,100    | 97,125.00       |  |
|    | SERITAGE GROWTH PROP-A REIT  | 1,240     | 50,034.00       |  |
|    | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 14,980    | 2,247,898.80    |  |
|    | SITE CENTERS CORP            | 6,700     | 95,408.00       |  |
|    | SL GREEN REALTY CORP         | 4,130     | 332,423.70      |  |
|    | SPIRIT MTA REIT              | 2,200     | 18,128.00       |  |
|    | SPIRIT REALTY CAPITAL INC    | 4,370     | 208,143.10      |  |
|    | STAG INDUSTRIAL INC          | 6,200     | 180,234.00      |  |
|    | STORE CAPITAL CORP           | 9,740     | 366,905.80      |  |
|    | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC  | 5,100     | 57,630.00       |  |
|    | SUN COMMUNITIES INC          | 4,320     | 640,612.80      |  |
|    | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 11,300    | 152,211.00      |  |
|    | TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 4,400     | 65,736.00       |  |
|    | TAUBMAN CENTERS INC          | 2,840     | 113,600.00      |  |
|    | TERRENO REALTY CORP          | 3,170     | 161,701.70      |  |
|    | UDR INC                      | 13,490    | 652,241.50      |  |
|    | UMH PROPERTIES INC           | 1,700     | 22,355.00       |  |
|    | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 560       | 53,838.40       |  |
|    | URBAN EDGE PROPERTIES        | 5,900     | 109,150.00      |  |
|    | URSTADT BIDDLE-CL A          | 1,300     | 28,262.00       |  |
|    | VENTAS INC                   | 17,810    | 1,328,982.20    |  |
|    | VEREIT INC                   | 46,700    | 451,122.00      |  |
|    | VICI PROPERTIES INC          | 20,200    | 448,238.00      |  |
|    | VORNADO REALTY TRUST         | 8,300     | 513,936.00      |  |
|    | WASHINGTON PRIME GROUP INC   | 7,700     | 26,026.00       |  |
|    | WASHINGTON REAL ESTATE INV   | 3,900     | 105,027.00      |  |
|    | WEINGARTEN REALTY INVESTORS  | 5,700     | 153,900.00      |  |
|    | WELLTOWER INC                | 19,650    | 1,789,918.50    |  |
|    | WHITESTONE REIT              | 1,600     | 20,016.00       |  |
|    | WP CAREY INC                 | 8,310     | 749,146.50      |  |
|    | XENIA HOTELS & RESORTS INC   | 5,200     | 107,016.00      |  |
| 小計 | 銘柄数：155                      | 1,100,786 | 45,271,196.71   |  |
|    |                              |           | (4,847,187,031) |  |
|    | 組入時価比率：73.0%                 |           | 73.8%           |  |

|                              |   |          |               |  |
|------------------------------|---|----------|---------------|--|
| カナダドル                        | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT                | 2,660    | 140,208.60    |  |
|                              | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT                | 3,700    | 46,620.00     |  |
|                              | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST                | 1,120    | 49,347.20     |  |
|                              | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA                | 3,650    | 196,114.50    |  |
|                              | CHOICE PROPERTIES REIT                      | 7,800    | 110,214.00    |  |
|                              | COMINAR REAL ESTATE INV-TR U                | 3,900    | 48,633.00     |  |
|                              | CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT              | 2,000    | 31,740.00     |  |
|                              | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR                | 2,000    | 29,440.00     |  |
|                              | DREAM GLOBAL REAL ESTATE<br>INVESTMENT TRUS | 4,600    | 67,160.00     |  |
|                              | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE<br>INVESTMENT  | 2,900    | 36,830.00     |  |
|                              | DREAM OFFICE REAL ESTATE<br>INVESTMENT TRUS | 1,400    | 38,640.00     |  |
|                              | GRANITE REAL ESTATE INVESTME                | 1,160    | 74,854.80     |  |
|                              | H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS                | 6,800    | 153,544.00    |  |
|                              | INTERRENT REAL ESTATE INVEST                | 3,000    | 47,940.00     |  |
|                              | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE                | 2,300    | 46,943.00     |  |
|                              | MINTO APARTMENT REAL ESTATE                 | 400      | 9,312.00      |  |
|                              | MORGUARD NORTH AMERICAN RESI                | 800      | 15,616.00     |  |
|                              | NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE<br>INVEST   | 1,500    | 44,535.00     |  |
|                              | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT                | 3,000    | 35,040.00     |  |
|                              | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR                 | 7,100    | 185,381.00    |  |
|                              | SLATE OFFICE REIT                           | 2,000    | 11,600.00     |  |
|                              | SLATE RETAIL REIT                           | 906      | 11,587.74     |  |
|                              | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV                | 3,400    | 108,562.00    |  |
|                              | SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT               | 2,700    | 35,424.00     |  |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 1,400                                       | 9,240.00 |               |  |
| 小計                           | 銘柄数：25                                      | 72,196   | 1,584,526.84  |  |
|                              |   |          | (128,219,911) |  |
|                              | 組入時価比率：1.9%                                 |          | 2.0%          |  |
| ユーロ                          | AEDIFICA                                    | 1,160    | 124,120.00    |  |
|                              | ALSTRIA OFFICE REIT-AG                      | 7,700    | 116,963.00    |  |
|                              | ALTAREA                                     | 180      | 33,624.00     |  |
|                              | BEFIMMO S.C.A.                              | 1,100    | 59,400.00     |  |
|                              | COFINIMMO                                   | 1,160    | 147,784.00    |  |

|      |                                 |         |               |  |
|------|---------------------------------|---------|---------------|--|
|      | COVIVIO                         | 3,190   | 306,559.00    |  |
|      | EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA     | 2,000   | 46,640.00     |  |
|      | GECINA SA                       | 2,630   | 371,093.00    |  |
|      | GREEN REIT PLC                  | 33,000  | 62,766.00     |  |
|      | HAMBORNER REIT AG               | 4,000   | 37,468.00     |  |
|      | HIBERNIA REIT PLC               | 33,000  | 49,500.00     |  |
|      | ICADE                           | 2,130   | 172,849.50    |  |
|      | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ    | 2,200   | 12,034.00     |  |
|      | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 13,100  | 138,991.00    |  |
|      | INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES  | 1,000   | 26,300.00     |  |
|      | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES    | 19,000  | 32,680.00     |  |
|      | KLEPIERRE                       | 9,640   | 268,763.20    |  |
|      | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM    | 3,600   | 24,264.00     |  |
|      | MERCIALYS                       | 2,700   | 29,970.00     |  |
|      | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA     | 17,900  | 216,411.00    |  |
|      | MONTEA                          | 460     | 34,730.00     |  |
|      | NSI NV                          | 1,000   | 39,500.00     |  |
|      | RETAIL ESTATES                  | 400     | 33,360.00     |  |
|      | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD       | 6,700   | 804,000.00    |  |
|      | VASTNED RETAIL NV               | 700     | 19,250.00     |  |
|      | WAREHOUSES DE PAUW SCA          | 870     | 148,422.00    |  |
|      | WERELDHAVE NV                   | 2,000   | 36,940.00     |  |
| 小計   | 銘柄数 : 27                        | 172,520 | 3,394,381.70  |  |
|      |                                 |         | (400,740,703) |  |
|      | 組入時価比率 : 6.0%                   |         | 6.1%          |  |
| 英ポンド | ASSURA PLC                      | 115,000 | 81,305.00     |  |
|      | BIG YELLOW GROUP PLC            | 8,000   | 85,120.00     |  |
|      | BRITISH LAND                    | 47,200  | 246,289.60    |  |
|      | CAPITAL & REGIONAL PLC          | 31,000  | 4,557.00      |  |
|      | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC      | 28,000  | 23,156.00     |  |
|      | DERWENT LONDON PLC              | 5,400   | 169,020.00    |  |
|      | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC    | 24,000  | 22,296.00     |  |
|      | GREAT PORTLAND ESTATES PLC      | 12,600  | 88,678.80     |  |
|      | HAMMERSON PLC                   | 37,300  | 90,191.40     |  |
|      | HANSTEEN HOLDINGS PLC           | 20,000  | 19,240.00     |  |
|      | INTU PROPERTIES PLC             | 39,000  | 13,919.10     |  |

|     |                                       |         |               |  |
|-----|---------------------------------------|---------|---------------|--|
|     | LAND SECURITIES GROUP PLC             | 36,100  | 275,948.40    |  |
|     | LONDONMETRIC PROPERTY PLC             | 39,000  | 81,198.00     |  |
|     | LXI REIT PLC                          | 27,000  | 35,316.00     |  |
|     | NEWRIVER REIT PLC                     | 16,000  | 27,264.00     |  |
|     | PICTON PROPERTY INCOME LTD            | 24,000  | 20,784.00     |  |
|     | PRIMARY HEALTH PROPERTIES             | 53,000  | 72,610.00     |  |
|     | RDI REIT PLC                          | 10,000  | 10,400.00     |  |
|     | REGIONAL REIT LTD                     | 19,000  | 19,722.00     |  |
|     | SAFESTORE HOLDINGS PLC                | 10,200  | 67,983.00     |  |
|     | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM<br>TRUST | 21,000  | 11,760.00     |  |
|     | SEGRO PLC                             | 53,100  | 417,578.40    |  |
|     | SHAFTESBURY PLC                       | 10,900  | 92,650.00     |  |
|     | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING           | 17,000  | 14,518.00     |  |
|     | TRITAX BIG BOX REIT PLC               | 85,000  | 120,445.00    |  |
|     | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT           | 35,000  | 28,175.00     |  |
|     | UNITE GROUP PLC                       | 14,000  | 145,600.00    |  |
|     | WORKSPACE GROUP PLC                   | 6,500   | 56,647.50     |  |
| 小計  | 銘柄数：28                                | 844,300 | 2,342,372.20  |  |
|     |                                       |         | (309,029,164) |  |
|     | 組入時価比率：4.7%                           |         | 4.7%          |  |
| 豪ドル | ABACUS PROPERTY GROUP                 | 16,000  | 63,520.00     |  |
|     | APN INDUSTRIA REIT                    | 4,300   | 12,513.00     |  |
|     | ARENA REIT                            | 14,000  | 39,480.00     |  |
|     | BWP TRUST                             | 23,300  | 91,336.00     |  |
|     | CHARTER HALL EDUCATION TRUST          | 11,000  | 42,020.00     |  |
|     | CHARTER HALL GROUP                    | 22,600  | 289,506.00    |  |
|     | CHARTER HALL LONG WALE REIT           | 14,000  | 82,600.00     |  |
|     | CHARTER HALL RETAIL REIT              | 16,200  | 68,688.00     |  |
|     | CROMWELL PROPERTY GROUP               | 90,000  | 113,400.00    |  |
|     | DEXUS                                 | 53,200  | 687,876.00    |  |
|     | GDI PROPERTY GROUP                    | 26,000  | 40,820.00     |  |
|     | GOODMAN GROUP                         | 77,600  | 1,086,400.00  |  |
|     | GPT GROUP                             | 94,100  | 593,771.00    |  |
|     | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR          | 13,600  | 59,976.00     |  |
|     | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L          | 7,000   | 24,570.00     |  |

|             |                                     |           |               |               |
|-------------|-------------------------------------|-----------|---------------|---------------|
| 小計          | INGENIA COMMUNITIES GROUP           | 9,000     | 36,270.00     |               |
|             | MIRVAC GROUP                        | 190,000   | 596,600.00    |               |
|             | NATIONAL STORAGE REIT               | 33,000    | 59,895.00     |               |
|             | RURAL FUNDS GROUP                   | 14,000    | 28,840.00     |               |
|             | SCENTRE GROUP                       | 260,000   | 1,034,800.00  |               |
|             | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA        | 47,000    | 120,320.00    |               |
|             | STOCKLAND TRUST GROUP               | 117,400   | 522,430.00    |               |
|             | VICINITY CENTRES                    | 155,000   | 399,900.00    |               |
|             | VIVA ENERGY REIT                    | 23,000    | 66,930.00     |               |
|             | 銘柄数：24                              | 1,331,300 | 6,162,461.00  | (449,305,031) |
| 組入時価比率：6.8% |                                     |           | 6.9%          |               |
| ニュージーランドドル  | ARGOSY PROPERTY LTD                 | 42,000    | 63,210.00     |               |
|             | GOODMAN PROPERTY TRUST              | 46,000    | 101,890.00    |               |
|             | KIWI PROPERTY GROUP LTD             | 72,000    | 120,600.00    |               |
|             | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND     | 51,000    | 95,115.00     |               |
|             | STRIDE STAPLED GROUP                | 16,000    | 37,440.00     |               |
|             | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST     | 17,000    | 46,750.00     |               |
|             | 銘柄数：6                               | 244,000   | 465,005.00    | (31,727,291)  |
| 組入時価比率：0.5% |                                     |           | 0.5%          |               |
| 香港ドル        | CHAMPION REIT                       | 96,000    | 498,240.00    |               |
|             | FORTUNE REIT                        | 65,000    | 595,400.00    |               |
|             | LINK REIT                           | 102,500   | 9,163,500.00  |               |
|             | PROSPERITY REIT                     | 53,000    | 155,290.00    |               |
|             | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT     | 52,000    | 270,920.00    |               |
|             | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 62,000    | 324,260.00    |               |
|             | 銘柄数：6                               | 430,500   | 11,007,610.00 | (150,363,952) |
| 組入時価比率：2.3% |                                     |           | 2.3%          |               |
| シンガポールドル    | AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD       | 29,025    | 42,086.25     |               |
|             | ASCENDAS HOSPITALITY TRUST          | 33,000    | 35,310.00     |               |
|             | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT        | 125,000   | 401,250.00    |               |
|             | ASCOTT RESIDENCE TRUST              | 58,000    | 75,400.00     |               |
|             | CACHE LOGISTICS TRUST               | 51,000    | 37,485.00     |               |

|      |                                    |           |                 |  |
|------|------------------------------------|-----------|-----------------|--|
|      | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST        | 138,069   | 302,371.11      |  |
|      | CAPITALAND MALL TRUST              | 135,000   | 364,500.00      |  |
|      | CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST      | 32,696    | 51,332.72       |  |
|      | CDL HOSPITALITY TRUSTS             | 40,000    | 64,800.00       |  |
|      | ESR REIT                           | 95,065    | 49,433.80       |  |
|      | FAR EAST HOSPITALITY TRUST         | 50,000    | 34,000.00       |  |
|      | FIRST REAL ESTATE INVT TRUST       | 27,000    | 28,350.00       |  |
|      | FRASERS CENTREPOINT TRUST          | 30,775    | 87,708.75       |  |
|      | FRASERS COMMERCIAL TRUST           | 34,000    | 57,800.00       |  |
|      | FRASERS HOSPITALITY TRUST          | 39,000    | 27,690.00       |  |
|      | FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI       | 80,000    | 100,000.00      |  |
|      | KEPPEL DC REIT                     | 49,077    | 89,320.14       |  |
|      | KEPPEL REIT                        | 86,000    | 107,500.00      |  |
|      | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 90,000    | 20,700.00       |  |
|      | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST         | 93,000    | 212,040.00      |  |
|      | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST         | 62,000    | 147,560.00      |  |
|      | MAPLETREE LOGISTICS TRUST          | 110,000   | 174,900.00      |  |
|      | MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL    | 104,000   | 138,320.00      |  |
|      | QUE HOSPITALITY TRUST              | 59,088    | 43,134.24       |  |
|      | PARKWAY LIFE REAL ESTATE           | 17,000    | 52,700.00       |  |
|      | SABANA SHARIAH COMP IND REIT       | 37,360    | 17,185.60       |  |
|      | SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT      | 28,000    | 15,120.00       |  |
|      | SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT-RTS  | 5,040     | 50.40           |  |
|      | SPH REIT                           | 30,000    | 32,700.00       |  |
|      | STARHILL GLOBAL REIT               | 63,000    | 47,250.00       |  |
|      | SUNTEC REIT                        | 105,000   | 203,700.00      |  |
| 小計   | 銘柄数：31                             | 1,936,195 | 3,061,698.01    |  |
|      |                                    |           | (236,761,107)   |  |
|      | 組入時価比率：3.6%                        |           | 3.6%            |  |
| 新シケル | REIT 1 LTD                         | 7,500     | 151,050.00      |  |
| 小計   | 銘柄数：1                              | 7,500     | 151,050.00      |  |
|      |                                    |           | (4,591,920)     |  |
|      | 組入時価比率：0.1%                        |           | 0.1%            |  |
| 合計   |                                    |           | 6,557,926,110   |  |
|      |                                    |           | (6,557,926,110) |  |

(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         | 2019年 9月 6日現在 |       |               |            |
|------------|---------------|-------|---------------|------------|
|            | 契約額等(円)       |       | 時価(円)         | 評価損益(円)    |
|            |               | うち1年超 |               |            |
| 市場取引       |               |       |               |            |
| REIT指数先物取引 |               |       |               |            |
| 買建         | 145,545,605   | -     | 149,238,448   | 3,692,843  |
| 市場取引以外の取引  |               |       |               |            |
| 為替予約取引     |               |       |               |            |
| 買建         | 9,436,098     | -     | 9,437,430     | 1,332      |
| 米ドル        | 7,812,525     | -     | 7,813,920     | 1,395      |
| シンガポールドル   | 1,623,573     | -     | 1,623,510     | 63         |
| 売建         | 6,465,259,375 | -     | 6,533,378,170 | 68,118,795 |
| 米ドル        | 4,783,476,408 | -     | 4,824,704,900 | 41,228,492 |
| カナダドル      | 125,303,794   | -     | 127,163,460   | 1,859,666  |
| ユーロ        | 393,932,316   | -     | 398,520,000   | 4,587,684  |
| 英ポンド       | 301,417,120   | -     | 308,063,340   | 6,646,220  |
| 豪ドル        | 444,826,647   | -     | 453,730,900   | 8,904,253  |
| ニュージーランドドル | 30,738,414    | -     | 31,344,400    | 605,986    |
| 香港ドル       | 149,400,967   | -     | 150,817,480   | 1,416,513  |
| シンガポールドル   | 231,055,719   | -     | 233,869,090   | 2,813,371  |
| 新シェケル      | 5,107,990     | -     | 5,164,600     | 56,610     |
| 合計         | -             | -     | -             | 64,424,620 |

(注) 時価の算定方法

### 1 先物取引

外国先物取引について

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

### 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 野村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

2019年9月30日現在

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 12,009,076,148円 |
| 負債総額           | 1,183,300,382円  |
| 純資産総額（ - ）     | 10,825,775,766円 |
| 発行済口数          | 7,274,631,728口  |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.4882円         |

## （参考）国内株式マザーファンド

2019年9月30日現在

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 578,602,890,270円 |
| 負債総額           | 136,319,271,162円 |
| 純資産総額（ - ）     | 442,283,619,108円 |
| 発行済口数          | 276,178,960,587口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.6014円          |

## （参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

2019年9月30日現在

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 96,659,660,085円 |
| 負債総額           | 47,434,295,471円 |
| 純資産総額（ - ）     | 49,225,364,614円 |
| 発行済口数          | 25,053,858,544口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.9648円         |

## （参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

2019年9月30日現在

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 759,083,673,337円 |
| 負債総額           | 52,600,995,042円  |
| 純資産総額（ - ）     | 706,482,678,295円 |
| 発行済口数          | 521,906,822,220口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.3537円          |

## （参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

2019年9月30日現在

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 120,044,250,843円 |
| 負債総額           | 60,724,015,468円  |
| 純資産総額（ - ）     | 59,320,235,375円  |
| 発行済口数          | 48,961,849,201口  |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.2116円          |

## （参考）新興国債券マザーファンド

2019年9月30日現在

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 21,284,090,236円 |
| 負債総額           | 196,390,057円    |
| 純資産総額（ - ）     | 21,087,700,179円 |
| 発行済口数          | 11,051,246,465口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.9082円         |

## （参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2019年9月30日現在

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 48,431,863,137円 |
| 負債総額           | 1,360,493,458円  |
| 純資産総額（ - ）     | 47,071,369,679円 |
| 発行済口数          | 17,631,429,936口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.6697円         |

## （参考）海外R E I Tインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

2019年9月30日現在

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 13,381,726,167円 |
| 負債総額           | 6,559,099,844円  |
| 純資産総額（ - ）     | 6,822,626,323円  |
| 発行済口数          | 4,270,926,811口  |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.5975円         |

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (3) 受益権の譲渡

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

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

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

### (4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (5) 受益権の再分割

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

### (6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱い

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、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

2019年10月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間に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。

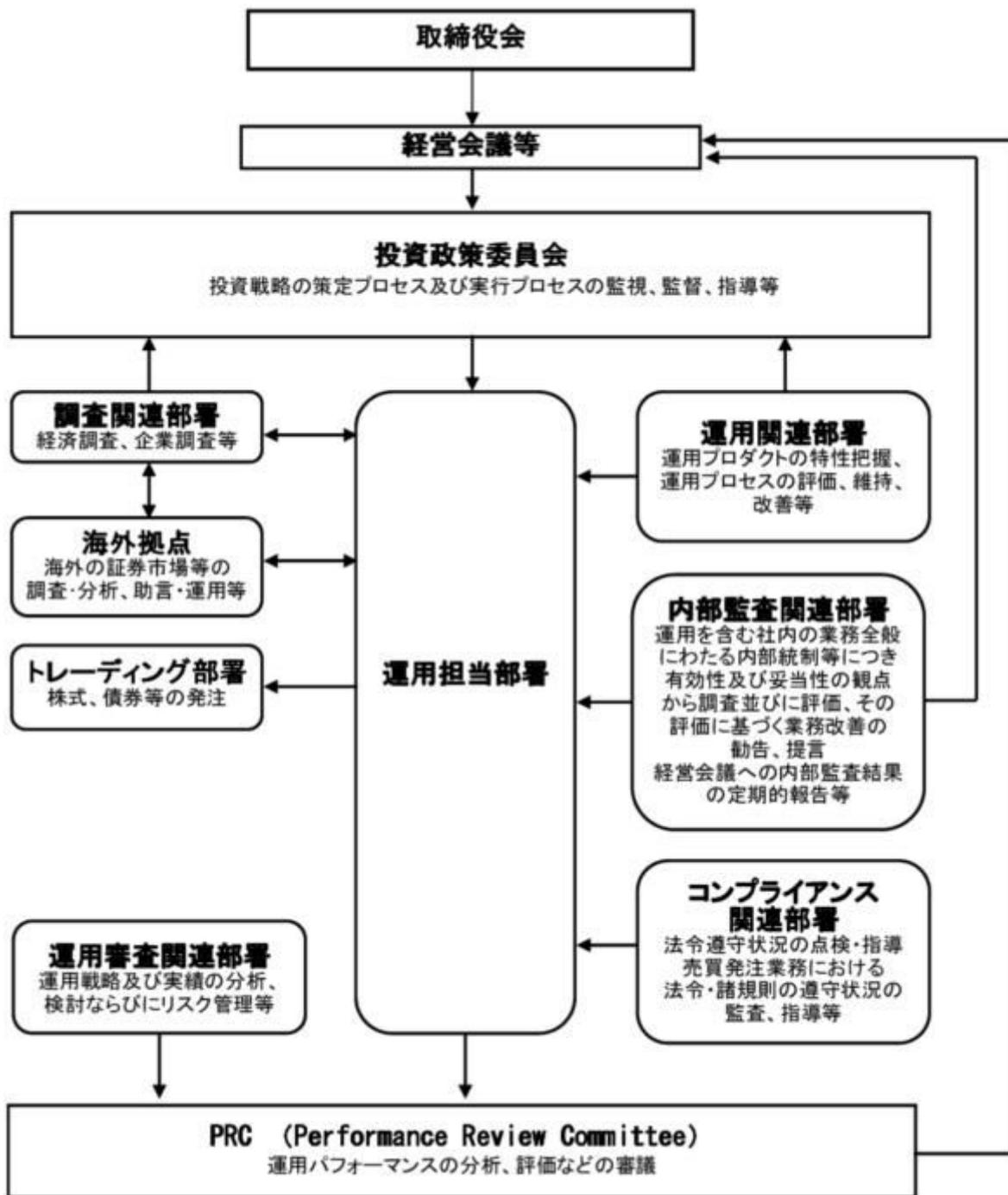
###### 代表取締役・業務執行取締役

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2019年9月30日現在次の通りです（ただし、親投資信託を除きます。）。

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

|            |       |            |
|------------|-------|------------|
| 追加型株式投資信託  | 1,013 | 28,593,648 |
| 単位型株式投資信託  | 176   | 930,781    |
| 追加型公社債投資信託 | 14    | 5,282,296  |
| 単位型公社債投資信託 | 432   | 1,708,940  |
| 合計         | 1,635 | 36,515,664 |

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2018年4月1日から2019年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。  
なお、従来、当社が監査証明を受けている新日本有限責任監査法人は、2018年7月1日に名称を変更し、EY新日本有限責任監査法人となりました。

#### (1)【貸借対照表】

| 区分            | 注記<br>番号 | 前事業年度        | 当事業年度        |
|---------------|----------|--------------|--------------|
|               |          | (2018年3月31日) | (2019年3月31日) |
|               |          | 金額(百万円)      | 金額(百万円)      |
| <b>(資産の部)</b> |          |              |              |
| <b>流動資産</b>   |          |              |              |
| 現金・預金         |          | 919          | 1,562        |
| 金銭の信託         |          | 47,936       | 45,493       |
| 有価証券          |          | 22,600       | 19,900       |
| 前払金           |          | 0            | -            |
| 前払費用          |          | 26           | 27           |
| 未収入金          |          | 464          | 500          |
| 未収委託者報酬       |          | 24,059       | 25,246       |
| 未収運用受託報酬      |          | 6,764        | 5,933        |
| その他           |          | 181          | 269          |
| 貸倒引当金         |          | 15           | 15           |
| 流動資産計         |          | 102,937      | 98,917       |
| <b>固定資産</b>   |          |              |              |
| <b>有形固定資産</b> |          |              |              |
| 建物            | 2        | 348          | 320          |
| 器具備品          | 2        | 525          | 393          |
| 無形固定資産        |          | 7,157        | 6,438        |

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

| 区分             | 注記<br>番号 | 前事業年度<br>(2018年3月31日) |        | 当事業年度<br>(2019年3月31日) |        |
|----------------|----------|-----------------------|--------|-----------------------|--------|
|                |          | 金額(百万円)               |        | 金額(百万円)               |        |
| <b>(負債の部)</b>  |          |                       |        |                       |        |
| <b>流動負債</b>    |          |                       |        |                       |        |
| 預り金            |          |                       | 133    |                       | 145    |
| 未払金            | 1        |                       | 17,853 |                       | 16,709 |
| 未払収益分配金        |          | 1                     |        | 0                     |        |
| 未払償還金          |          | 31                    |        | 25                    |        |
| 未払手数料          |          | 7,884                 |        | 7,724                 |        |
| 関係会社未払金        |          | 7,930                 |        | 7,422                 |        |
| その他未払金         |          | 2,005                 |        | 1,535                 |        |
| 未払費用           | 1        |                       | 12,441 |                       | 11,704 |
| 未払法人税等         |          |                       | 2,241  |                       | 1,560  |
| 前受収益           |          |                       | 33     |                       | 29     |
| 賞与引当金          |          |                       | 4,626  |                       | 3,792  |
| 流動負債計          |          |                       | 37,329 |                       | 33,942 |
| <b>固定負債</b>    |          |                       |        |                       |        |
| 退職給付引当金        |          |                       | 2,938  |                       | 3,219  |
| 時効後支払損引当金      |          |                       | 548    |                       | 558    |
| 固定負債計          |          |                       | 3,486  |                       | 3,777  |
| 負債合計           |          |                       | 40,816 |                       | 37,720 |
| <b>(純資産の部)</b> |          |                       |        |                       |        |
| <b>株主資本</b>    |          |                       |        |                       |        |
| 資本金            |          |                       | 86,078 |                       | 86,924 |
| 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          |          |                       | 55,168 |                       | 56,014 |
| 利益準備金          |          | 685                   |        | 685                   |        |
| その他利益剰余金       |          | 54,483                |        | 55,329                |        |
| 別途積立金          |          | 24,606                |        | 24,606                |        |
| 繰越利益剰余金        |          | 29,876                |        | 30,723                |        |
| 評価・換算差額等       |          |                       | 11     |                       | 33     |

|              |  |         |         |
|--------------|--|---------|---------|
| その他有価証券評価差額金 |  | 11      | 33      |
| 純資産合計        |  | 86,090  | 86,958  |
| 負債・純資産合計     |  | 126,906 | 124,679 |

## (2) 【損益計算書】

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

|  | 前事業年度                         | 当事業年度                         |
|--|-------------------------------|-------------------------------|
|  | (自 2017年4月1日<br>至 2018年3月31日) | (自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日) |

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：百万円)

|        | 株主資本   |           |                  |                 |           |               |                     |                 | 株主<br>資本<br>合計 |
|--------|--------|-----------|------------------|-----------------|-----------|---------------|---------------------|-----------------|----------------|
|        | 資本金    | 資本剰余金     |                  |                 | 利益<br>準備金 | 利益剰余金         |                     |                 |                |
|        |        | 資本<br>準備金 | その他<br>資本<br>剰余金 | 資本<br>剰余金<br>合計 |           | その他利益剰余金      |                     | 利益<br>剰余金<br>合計 |                |
|        |        |           |                  |                 |           | 別<br>途<br>積立金 | 繰<br>越<br>利益<br>剰余金 |                 |                |
| 当期首残高  | 17,180 | 11,729    | 2,000            | 13,729          | 685       | 24,606        | 30,635              | 55,927          | 86,837         |
| 当期変動額  |        |           |                  |                 |           |               |                     |                 |                |
| 剰余金の配当 |        |           |                  |                 |           |               | 25,598              | 25,598          | 25,598         |
| 当期純利益  |        |           |                  |                 |           |               | 24,840              | 24,840          | 24,840         |

|                             |        |        |       |        |     |        |        |        |        |
|-----------------------------|--------|--------|-------|--------|-----|--------|--------|--------|--------|
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動<br>額(純額) |        |        |       |        |     |        |        |        |        |
| 当期変動額合計                     | -      | -      | -     | -      | -   | -      | 758    | 758    | 758    |
| 当期末残高                       | 17,180 | 11,729 | 2,000 | 13,729 | 685 | 24,606 | 29,876 | 55,168 | 86,078 |

(単位:百万円)

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

|                             | 株主資本   |           |                  |                 |           |           |                     |                 | 株主<br>資本<br>合計 |
|-----------------------------|--------|-----------|------------------|-----------------|-----------|-----------|---------------------|-----------------|----------------|
|                             | 資本金    | 資本剰余金     |                  |                 | 利益<br>準備金 | 利益剰余金     |                     |                 |                |
|                             |        | 資本<br>準備金 | その他<br>資本<br>剰余金 | 資本<br>剰余金<br>合計 |           | その他利益剰余金  |                     | 利益<br>剰余金<br>合計 |                |
|                             |        |           |                  |                 |           | 別途<br>積立金 | 繰<br>越<br>利益<br>剰余金 |                 |                |
| 当期首残高                       | 17,180 | 11,729    | 2,000            | 13,729          | 685       | 24,606    | 29,876              | 55,168          | 86,078         |
| 当期変動額                       |        |           |                  |                 |           |           |                     |                 |                |
| 剰余金の配当                      |        |           |                  |                 |           |           | 24,826              | 24,826          | 24,826         |
| 当期純利益                       |        |           |                  |                 |           |           | 25,672              | 25,672          | 25,672         |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動<br>額(純額) |        |           |                  |                 |           |           |                     |                 |                |
| 当期変動額合計                     | -      | -         | -                | -               | -         | -         | 846                 | 846             | 846            |
| 当期末残高                       | 17,180 | 11,729    | 2,000            | 13,729          | 685       | 24,606    | 30,723              | 56,014          | 86,924         |

(単位:百万円)

|  |          |
|--|----------|
|  | 評価・換算差額等 |
|--|----------|

|                             | その他有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 | 純資産合計  |
|-----------------------------|------------------|----------------|--------|
| 当期首残高                       | 11               | 11             | 86,090 |
| 当期変動額                       |                  |                |        |
| 剰余金の配当                      |                  |                | 24,826 |
| 当期純利益                       |                  |                | 25,672 |
| 株主資本以外の項目<br>の当期変動額（純<br>額） | 21               | 21             | 21     |
| 当期変動額合計                     | 21               | 21             | 868    |
| 当期末残高                       | 33               | 33             | 86,958 |

## [重要な会計方針]

|                     |  |    |        |      |       |     |     |      |       |
|---------------------|--|----|--------|------|-------|-----|-----|------|-------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法  | <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<br/>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<br/>(評価差額は全部純資産直入法により処理し、<br/>売却原価は移動平均法により算定しております。)<br/>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<br/>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。<br/>主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20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<br/>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 | 38～50年 | 附属設備 | 8～15年 | 構築物 | 20年 | 器具備品 | 4～15年 |
| 建物                  | 38～50年   |    |        |      |       |     |     |      |       |
| 附属設備                | 8～15年  |    |        |      |       |     |     |      |       |
| 構築物                 | 20年  |    |        |      |       |     |     |      |       |
| 器具備品                | 4～15年  |    |        |      |       |     |     |      |       |
| 4. 引当金の計上基準         | <p>(1) 貸倒引当金<br/>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<br/>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<br/>従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。<br/>退職給付見込額の期間帰属方法<br/>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。<br/>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法<br/>確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。<br/>退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金<br/>時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 投資損失引当金<br/>子会社等に対する投資に係る損失に備えるため、当該会社の財政状態等を勘案して必要額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理していません。</p> <p>連結納税制度を適用しております。</p> |
|---|--|

## 【未適用の会計基準等】

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

### (1) 概要

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

ステップ1: 顧客との契約を識別する。

ステップ2: 契約における履行義務を識別する。

ステップ3: 取引価格を算定する。

ステップ4: 契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5: 履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

### (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 【表示方法の変更に関する注記】

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

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

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

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

#### [注記事項]

##### 貸借対照表関係

| 前事業年度末<br>(2018年3月31日)  | 当事業年度末<br>(2019年3月31日)  |
|---|---|
| 1. 関係会社に対する資産及び負債<br>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。<br>未払費用 1,781百万円 | 1. 関係会社に対する資産及び負債<br>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。<br>未払費用 1,434百万円 |
| 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額<br>建物 708百万円<br>器具備品 3,491<br>合計 4,200               | 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額<br>建物 736百万円<br>器具備品 3,106<br>合計 3,842               |

##### 損益計算書関係

| 前事業年度<br>(自 2017年4月1日<br>至 2018年3月31日)  | 当事業年度<br>(自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日)  |
|---|---|
| 1. 関係会社に係る注記<br>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。<br>受取配当金 4,026百万円<br>支払利息 2 | 1. 関係会社に係る注記<br>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。<br>受取配当金 6,531百万円<br>支払利息 1 |
| 2. 固定資産除却損<br>建物 4百万円<br>器具備品 0<br>ソ フ ト ウ エ 53<br>ア<br>合計 58                   | 2. 固定資産除却損<br>建物 -百万円<br>器具備品 3<br>ソ フ ト ウ エ 307<br>ア<br>合計 310                 |
|   | 3. 関係会社清算益<br>関係会社清算益は、関係会社の清算にともなう清算配当です。                                      |

##### 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

##### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

##### 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2017年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

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

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

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

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

## 金融商品関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### (1) 現金・預金

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

### (2) 金銭の信託

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

### (3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

ます。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度（自 2017年4月 1 日 至 2018年3月31日）

1．売買目的有価証券(2018年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2018年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(2018年3月31日)

該当事項はありません。

## 4．その他有価証券(2018年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

## 当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 4．その他有価証券(2019年3月31日)

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

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

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

該当事項はありません。

### 退職給付関係

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

## 当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

## 及び前払年金費用の調整表

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

## 税効果会計関係

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

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

## セグメント情報等

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 関連当事者情報

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

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

(イ) 子会社等  
該当はありません。

## (ウ) 兄弟会社等

| 種類      | 会社等の名称   | 所在地    | 資本金             | 事業の内容 | 議決権等の所有<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係                                       | 取引の内容                 | 取引金額<br>(百万円) | 科目    | 期末残高<br>(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<br>(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<br>役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2) | 37,482        | 未払手数料 | 6,691         |

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

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

## (イ) 子会社等

該当はありません。

## (ウ) 兄弟会社等

| 種類      | 会社等の名称   | 所在地    | 資本金             | 事業の内容 | 議決権等の所有<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係                                       | 取引の内容                 | 取引金額<br>(百万円) | 科目    | 期末残高<br>(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<br>(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<br>役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2) | 34,646        | 未払手数料 | 6,410         |

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

## 1株当たり情報

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

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

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

###### (1) 受託者

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

\* 2019年9月末現在

###### (2)販売会社

| (a)名称 | (b)資本金の額 <sup>*</sup> | (c)事業の内容 |
|-------|-----------------------|----------|
|       |                       |          |

|                   |            |                                 |
|-------------------|------------|---------------------------------|
| 野村証券株式会社          | 10,000百万円  | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 今村証券株式会社          | 857百万円     |                                 |
| 四国アライアンス証券株式会社    | 3,000百万円   |                                 |
| S M B C日興証券株式会社   | 10,000百万円  |                                 |
| 株式会社S B I証券       | 48,323百万円  |                                 |
| 岡三オンライン証券株式会社     | 2,500百万円   |                                 |
| 香川証券株式会社          | 555百万円     |                                 |
| カブドットコム証券株式会社     | 7,196百万円   |                                 |
| 株式会社証券ジャパン        | 3,000百万円   |                                 |
| 東海東京証券株式会社        | 6,000百万円   |                                 |
| 西日本シティ T T 証券株式会社 | 3,000百万円   |                                 |
| 北洋証券株式会社          | 500百万円     |                                 |
| 松井証券株式会社          | 11,945百万円  |                                 |
| マネックス証券株式会社       | 12,200百万円  |                                 |
| 丸近証券株式会社          | 200百万円     |                                 |
| 楽天証券株式会社          | 7,495百万円   |                                 |
| 八十二証券株式会社         | 3,000百万円   |                                 |
| 山和証券株式会社          | 585百万円     |                                 |
| ワイエム証券株式会社        | 1,270百万円   |                                 |
| 株式会社イオン銀行         | 51,250百万円  | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。              |
| 株式会社池田泉州銀行        | 61,385百万円  |                                 |
| 株式会社伊予銀行          | 20,948百万円  |                                 |
| 株式会社岩手銀行          | 12,089百万円  |                                 |
| 株式会社七十七銀行         | 24,658百万円  |                                 |
| 株式会社新生銀行          | 512,204百万円 |                                 |
| スルガ銀行株式会社         | 30,043百万円  |                                 |
| 株式会社但馬銀行          | 5,481百万円   |                                 |
| 株式会社筑波銀行          | 48,868百万円  |                                 |
| 株式会社東京スター銀行       | 26,000百万円  |                                 |
| 株式会社東邦銀行          | 23,519百万円  |                                 |
| 株式会社八十二銀行         | 52,243百万円  |                                 |
| 株式会社百五銀行          | 20,000百万円  |                                 |
| 株式会社北洋銀行          | 121,101百万円 |                                 |
| 株式会社北陸銀行          | 140,409百万円 |                                 |
| 岡崎信用金庫            | 3,203百万円   | 信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。        |

\* 2019年9月末現在

岡崎信用金庫の資本金の額の箇所には、出資の総額を記載しております。

## 2 【関係業務の概要】

## (1)受託者

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

## (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

## (1)受託者

該当事項はありません。

## (2)販売会社

委託会社は、丸近証券株式会社の株式の10.9%を保有しています。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

| 提出年月日       | 提出書類          |
|-------------|---------------|
| 2018年11月29日 | 有価証券届出書       |
| 2018年11月29日 | 有価証券報告書       |
| 2019年 5月30日 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 2019年 5月30日 | 半期報告書         |

## 独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

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

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

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2019年10月18日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 亀井純子指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 伊藤志保

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型の2018年9月7日から2019年9月6日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型の2019年9月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。