

【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】	2020年9月23日提出
【計算期間】	第3期(自 2019年6月29日至 2020年6月29日)
【ファンド名】	マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	ＣＥＯ兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目２番１号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【連絡場所】	東京都江東区豊洲二丁目２番１号
【電話番号】	03-6387-5000
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

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

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

■信託金の限度額■

受益権の信託金限度額は、5,000億円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

<商品分類>

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

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

（マイターゲット2045（確定拠出年金向け））

《商品分類表》

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

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)			
	年2回	日本			日経225
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり ()	
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			T O P I X
	日々	オセアニア			
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファン ズ	なし	その他 (合成指数)
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券、 不動産投信) 資産配分 変更型))		アフリカ			
		中近東 (中東)			
		エマージング			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産による区分]

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

があるものをいう。

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

〔投資形態による属性区分〕

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

〔為替ヘッジによる属性区分〕

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

〔インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分〕

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

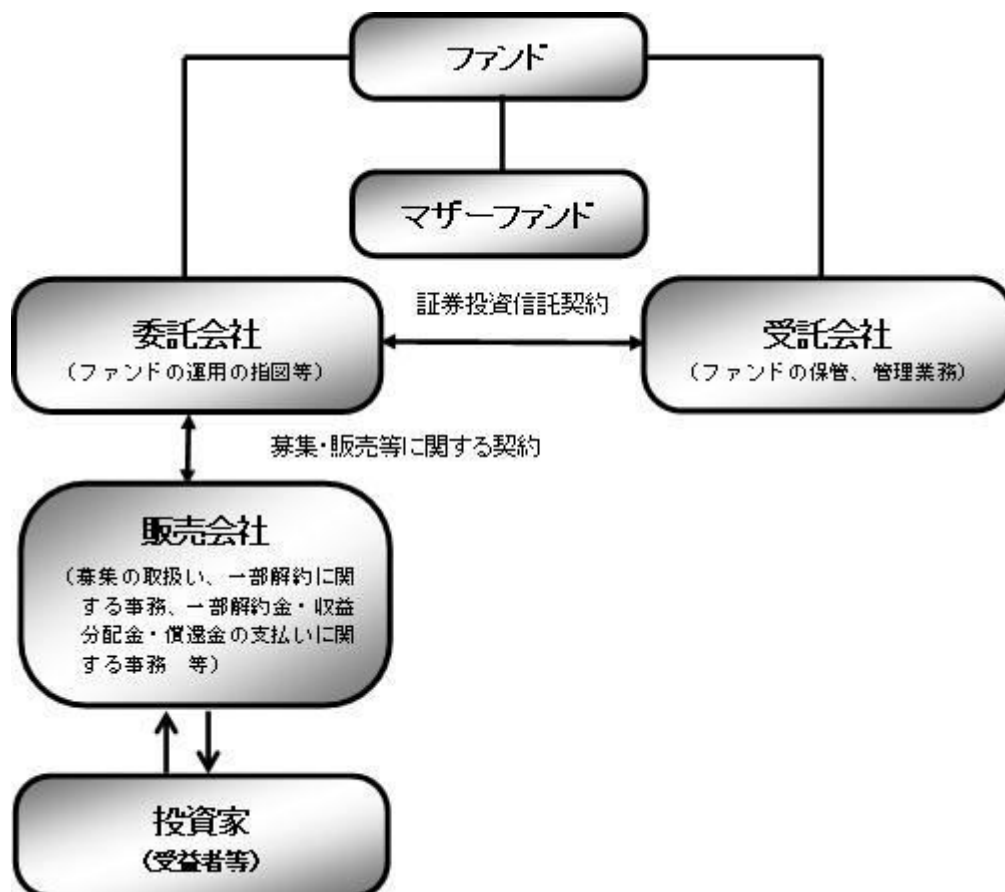
〔特殊型〕

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

(2) 【ファンドの沿革】

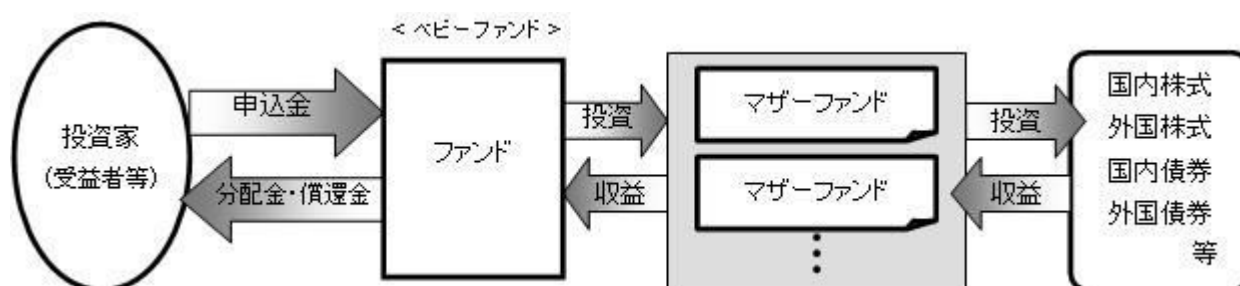
2018年3月9日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



《ファ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、投資家の皆様が投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。



ファンド	マイターゲット2045（確定拠出年金向け）
マザーファンド* (親投資信託)	国内株式マザーファンド
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド
	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド
	外国債券マザーファンド
委託会社(委託者)	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社(受託者)	野村信託銀行株式会社

上記のマザーファンドの他、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」に投資する場合があります。

*当初設定時に投資するマザーファンド

■委託会社の概況(2020年8月末現在)■

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日

野村證券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- 2045年をターゲットイヤーとし、定期的に各資産（国内株式、外国株式、国内債券、外国債券等）への基本投資割合を変更することで、ターゲットイヤーの5年前となる2040年7月に近づくにしたい、リスクの漸減を図ることを基本とします。

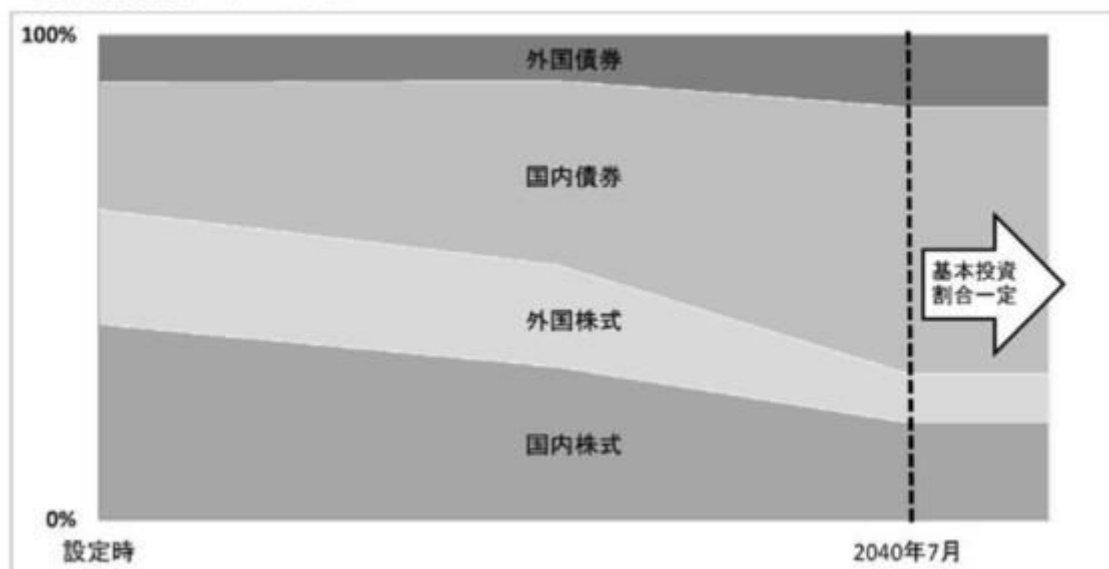
※定期的な基本投資割合の変更は、家計や市場の構造変化等を考慮し、当面、原則年1回行なうことを基本とします。

◆当初設定時および2040年7月以降の各資産への基本投資割合はそれぞれ以下を基本とします。

■基本投資割合■

	当初設定時	2040年7月以降	2020年9月現在
国内株式	40.3%	20%	38.3%
外国株式	23.6%	10%	23.0%
国内債券	26.3%	55%	29.0%
外国債券	9.8%	15%	9.7%

■基本投資割合のイメージ図■



●投資を行なうマザーファンドは、原則として、金融指標の動きに連動する投資成果を目指すものとし、別に定めるマザーファンドの中から、市場構造等を勘案し、各マザーファンドへの投資比率を決定します。

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

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

マザーファンド名	主要投資対象	対象指数
国内株式マザーファンド	わが国の株式	東証株価指数（TOPIX）
外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSAI 指数（円ベース・為替ヘッジなし）*
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	わが国の公社債	NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）
外国債券マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

※ファンドは上記のマザーファンドの他、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」に投資する場合があります。

*MSCI-KOKUSAI 指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

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

●2040年7月以降、マザーファンドを通じた各資産への基本投資割合を一定とします。また、各月末時点において、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、マザーファンドを通じて投

資する各資産への実質的なエクスポージャーを引き下げ[※]、短期有価証券等へ投資する安定運用を行ないます。

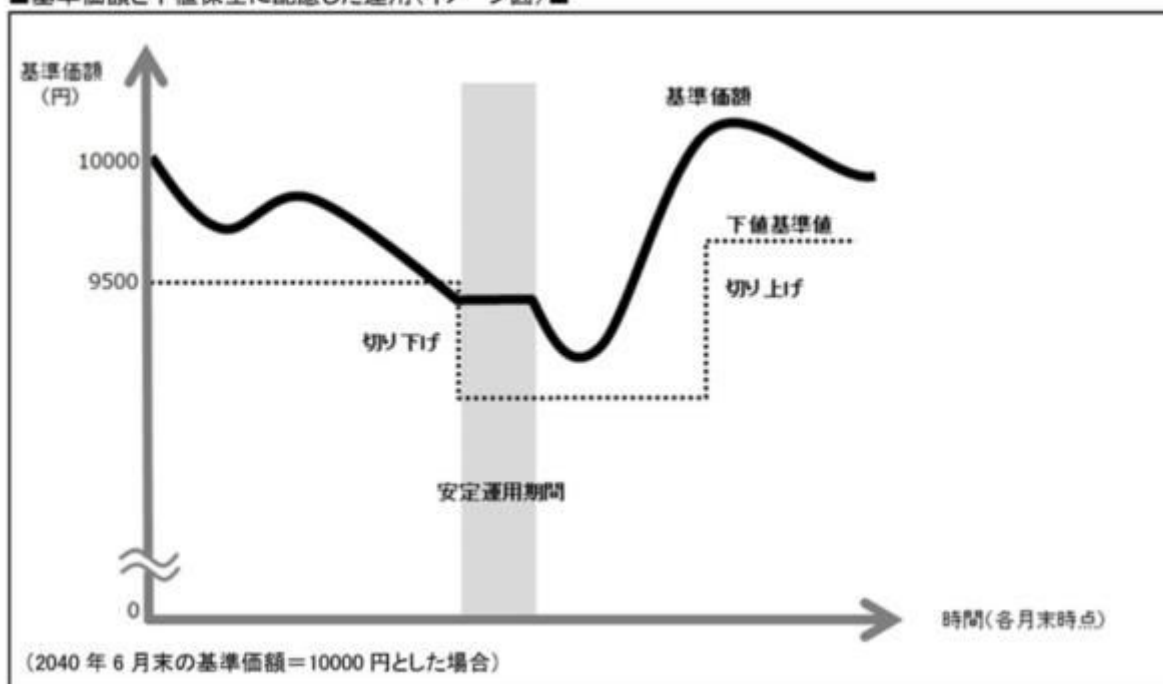
※各資産への実質的なエクスポージャーをゼロに近づけることを基本とします。

◆安定運用を行なうにあたっては、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等の売建てを行なう場合があります。

*当ファンドにおいては、上記のような運用を「下値保全に配慮した運用」という場合があります。

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

■基準価額と下値保全に配慮した運用(イメージ図)■



●実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。ただし、2040年7月以降、安定運用を行なう場合においては為替ヘッジを行なう場合があります。

■当初設定時に投資する各マザーファンドの投資方針等について■

[国内株式マザーファンド]

- ・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。

※「東証株価指数（TOPIX）」は、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした指数です。新規上場銘柄や有償増資などに対しては、修正を加えることで指数の連続性を維持していま

す。

■東証株価指数（TOPIX）の著作権等について■

- ①TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「**㈱東京証券取引所**」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は**㈱東京証券取引所**が有します。
- ②**㈱東京証券取引所**は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
- ③**㈱東京証券取引所**は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④**㈱東京証券取引所**は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また**㈱東京証券取引所**は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
- ⑤本ファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、本ファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。
- ⑥本ファンドは、**㈱東京証券取引所**により提供、保証又は販売されるものではありません。
- ⑦**㈱東京証券取引所**は、本ファンドの購入者又は公衆に対し、本ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
- ⑧**㈱東京証券取引所**は、野村アセットマネジメント株式会社又は本ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ⑨以上の項目に限らず、**㈱東京証券取引所**は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]

- ・主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

※「MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）」は、MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。MSCI-KOKUSAI指数は、MSCIが開発した、日本を除く先進国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

■MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の著作権等について■

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

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源から本件指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本件指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性及び／または完全性について保証するものではありません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、本件ファンドの発行会社、本件ファンドの所有者その他の個人・法人が、本契約にもとづき許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連して本件指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証をおこなうものではありません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本件指数及びそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。本件指数及びそれに含まれるデータに関し、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害（逸失利益を含む。）につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。本証券の購入者、販売者、または所有者あるいはいかなる個人・法人は、MSCIの許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCIに問い合わせることなく、本証券を保証、推奨、売買、又は宣伝するためにいかなるMSCIのトレードネーム、トレードマーク、又はサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCIの書面による許諾を得ることなくMSCIとの関係を一切主張することはできません。

[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]

- ・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。
- ※「NOMURA-BPI総合」は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。

■NOMURA-BPI総合の著作権等について■

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

[外国債券マザーファンド]

- ・主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

■FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の著作権等について■

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。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

別に定めるマザーファンドを主要投資対象とし、実質的に国内および外国の各株式、国内および外国の各

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

◆当初設定時に投資するマザーファンドと、主要投資対象は以下の通りです。

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MSCI-KOKUSAI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
外国債券マザーファンド	外国の公社債

※ファンドは上記のマザーファンドの他、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」に投資する場合があります。

①投資の対象とする資産の種類(信託約款)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、下記「（5）投資制限 ④および⑤」に定めるものに限ります。）に係る権利
 - ハ. 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ニ. 金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

②有価証券の指図範囲等(信託約款)

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

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。なお、社債券のうちで、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、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 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。）
8. 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。）

す。）

9. 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。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 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。）
14. 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。）
15. 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。）
16. 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。）
17. 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。）
18. 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。）
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 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17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
21. 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12号、第17号および第18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6号までの証券ならびに第12号、第17号および第18号の証券または証書のうち第2号から第6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13号および第14号の証券ならびに第17号の証券または証書のうち第13号および第14号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記②に掲げるものを除く。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

④その他の投資対象

1. 先物取引等
2. スワップ取引

(参考)当初設定時に投資する各マザーファンドの概要

「国内株式マザーファンド」

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① 主として東京証券取引所第一部上場株式に投資することにより、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指します。
- ② 非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。
- ③ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

- ① 株式への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資は行ないません。
- ③ 同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ④ 有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。
- ⑤ スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。
- ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。
- ⑦ 前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① 主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。
- ② 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。
- ③ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

- ① 株式への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ④ 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。
- ⑤ スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。
- ⑥ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑦ 同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ⑧ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑨ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑩ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。
- ⑪ 前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① 主としてわが国の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指します。
- ② 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

- ① 株式への投資は行ないません。
- ② 外貨建資産への投資は行ないません。
- ③ 有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。
- ④ スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。
- ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。
- ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

「外国債券マザーファンド」

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① 主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。
- ② 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。
- ③ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

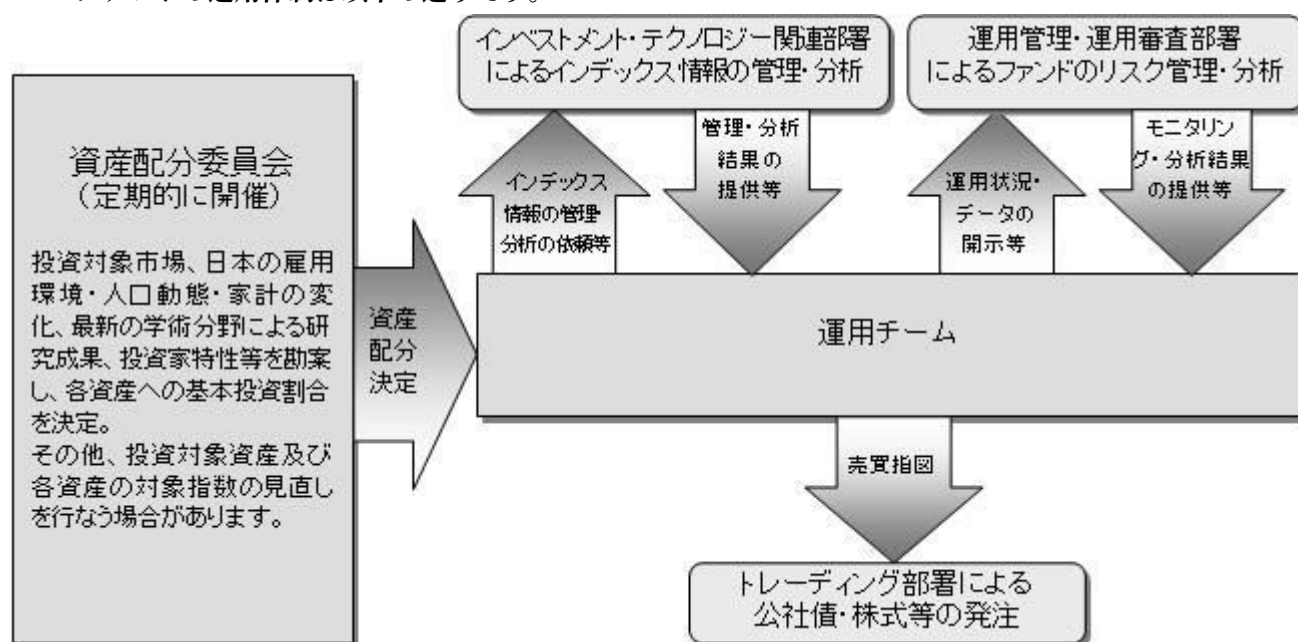
(3) 投資制限

- ① 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ② 有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。
- ③ スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

- ④ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。
- ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（３）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。

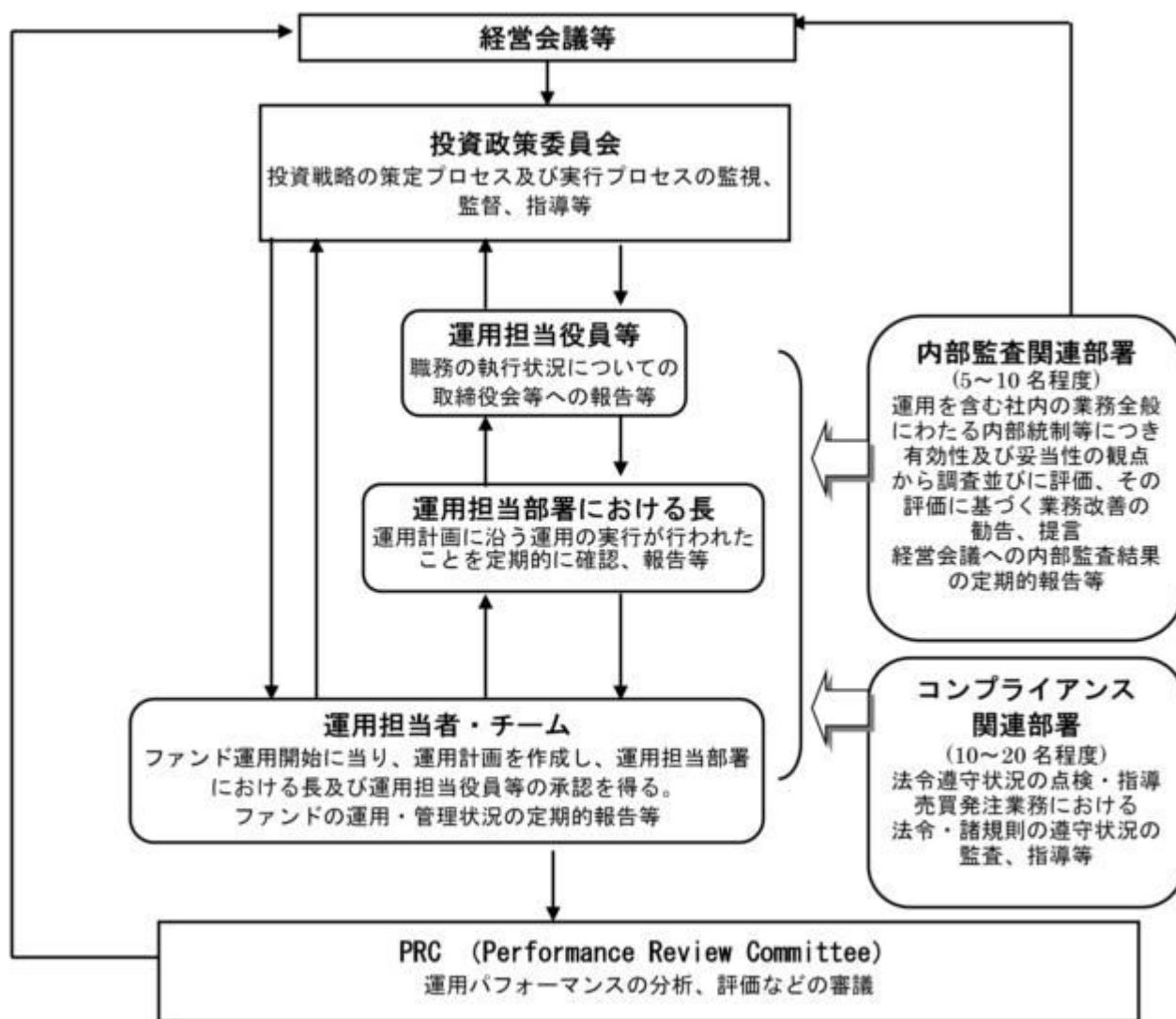


※運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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

す。



《委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等》

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

- ① 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ② 収益分配金額は、上記①の範囲内で、基準価額水準等を勘案し、委託者が決定します。

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

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

◆ファンドの決算日

原則として毎年6月28日（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

（５）【投資制限】

①運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限(信託約款)

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

②投資する株式等の範囲(信託約款)

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

③信用取引の指図範囲(信託約款)

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

4. 売り出しにより取得する株券

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

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

④先物取引等の運用指図(信託約款)

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

(ii) 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

(iii) 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

⑤スワップ取引の運用指図(信託約款)

(i) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

(ii) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(iii) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

(iv) 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑥有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

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

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

(ii) 上記(i)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(iii) 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

⑦公社債の借入れ(信託約款)

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

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

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

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

(iv) 上記(i)の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

⑧特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

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

⑨資金の借入れ(信託約款)

(i) 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

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

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

(iv) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑩同一の法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

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

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

(ii) 当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

3【投資リスク】

＜基準価額の変動要因＞

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

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。

[債券価格変動リスク]

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

[為替変動リスク]

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

※基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

《その他の留意点》

- ◆ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- ◆資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。
- ◆ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。
- ◆有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。
- ◆ファンドの基準価額とファンドのベンチマークである合成指数は、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。また、ファンドの投資成果が合成指数に連動または上回ることを保証するものではありません。なお、安定運用期間中は、ファンドの基準価額は合成指数には連動しません。
- ◆投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ◆2040年7月以降の運用においては、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、安定運用への切り替えを行なうことで、基準価額の大幅な下落を回避することを目指しますが、必ずしもある一定水準の基準価額が保全されることを示唆するものではありません。
- ◆ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

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

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

《委託会社におけるリスクマネジメント体制》

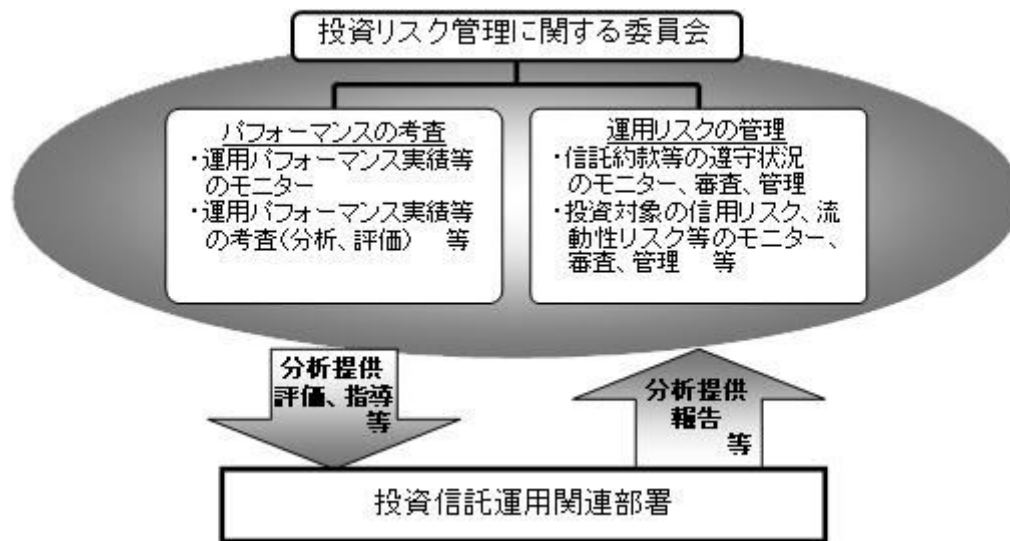
リスク管理関連の委員会

◆パフォーマンスの考査

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

◆運用リスクの管理

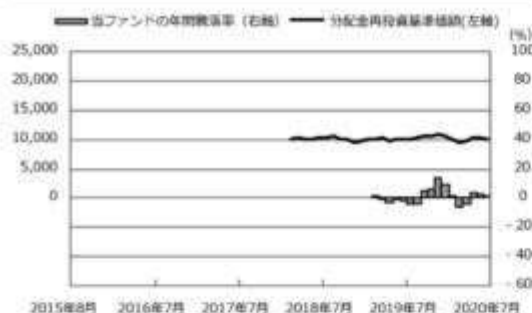
投資信託の信託財産の運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用部門その他関連部署への是正勧告を行なうことにより、適切な管理を行ないます。

リスク管理体制図

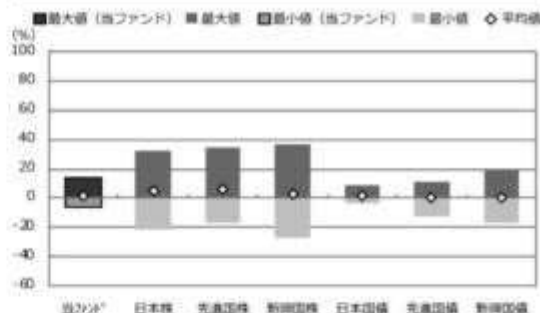
※投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

■ リスクの定量的比較（2015年8月末～2020年7月末：月次）

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	14.2	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 5.8	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	1.2	4.4	6.5	2.8	1.7	0.7	0.2

※ 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。設定日前日を 10,000 として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。

※ 年間騰落率は、2019 年 3 月から 2020 年 7 月の各月末における 1 年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

※ 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※ 2015 年 8 月から 2020 年 7 月の 5 年間（当ファンドは 2019 年 3 月から 2020 年 7 月）の各月末における 1 年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

※ 決算日に対応した数値とは異なります。

※ 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

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

<代表的な資産クラスの指数>

- 日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
- 先進国株：MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）
- 新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
- 日本国債：NOMURA-BPI 国債
- 先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）
- 新興国債：JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（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、指数額の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所に所有されています。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、知的財産権その他の一切の権利は 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も法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを予測するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持っており、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。

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

4 【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

申込手数料はありません。

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

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

信託報酬率の分配については次の通り(税抜)とします。

計算期間	1期～13期 (設定日～ 2030年決算日)	14期～23期 (2030年決算日翌日～ 2040年決算日)	24期以降 (2040年決算日 翌日以降)
信託報酬率	年0.396% (税抜年0.36%)	年0.374% (税抜年0.34%)	年0.352% (税抜年0.32%)
委託会社	年0.16%	年0.15%	年0.14%
販売会社	年0.16%	年0.15%	年0.14%
受託会社	年0.04%	年0.04%	年0.04%

《支払先の役務の内容》

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

（４）【その他の手数料等】

- ①ファンドにおいて一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行なった場合、当該借入金の利息はファンドから支払われます。
- ②ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、ファンドから支払われます。
- ③ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用はファンドから支払われます。また、ファンドが投資するマザーファンドに関する有価証券の貸付に係る事務の処理に要する費用が、ファンドから実質的に支払われます。
- ④監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支払いのときにファンドから支払われます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

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

なお、上記以外の受益者(法人)の場合の課税の取扱いは以下の通りです。

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

※源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

■個別元本について■

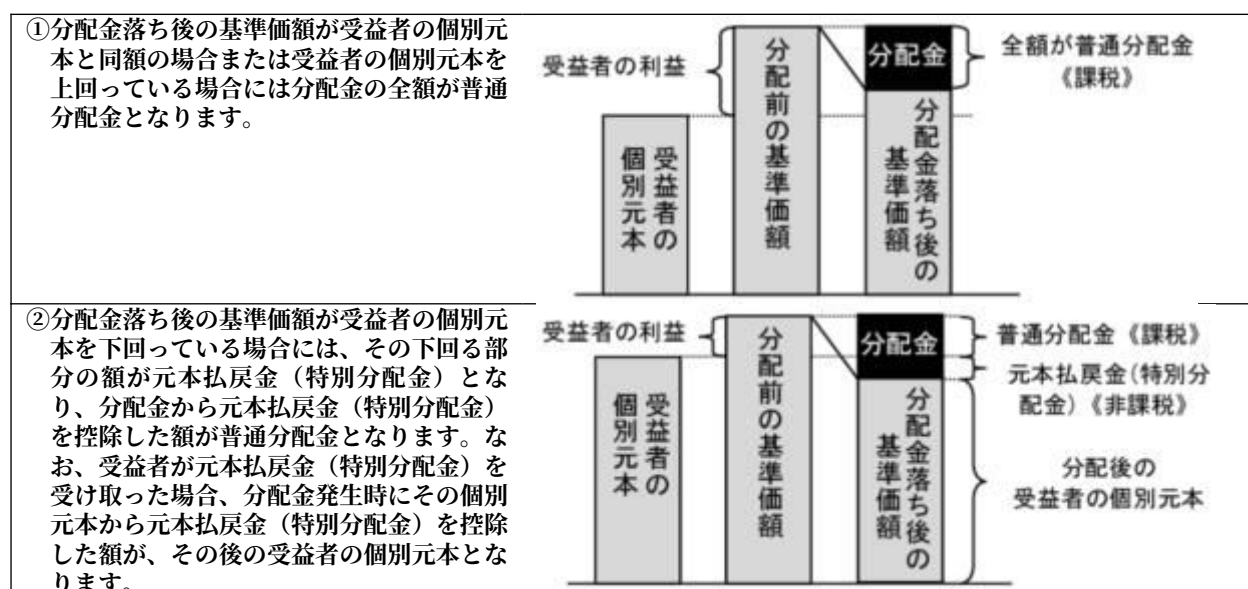
- ◆追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。
- ◆受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合や受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合などには、当該受益者の個別元本が変わりますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

■換金（解約）時および償還時の課税について■

- ◆換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。
- 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

■分配金の課税について■

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



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

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

※税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2020年7月末現在）が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は2020年7月31日現在の運用状況であります。

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

（1）【投資状況】

マイターゲット2045（確定拠出年金向け）

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	946,466,904	99.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	975,433	0.10
合計（純資産総額）		947,442,337	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	409,295,959,230	97.52
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	10,366,971,303	2.47
合計（純資産総額）		419,662,930,533	100.00

その他の資産の投資状況

※その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	10,355,780,000	2.46

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	462,298,612,228	68.42
	カナダ	22,888,906,174	3.38
	ドイツ	21,071,714,527	3.11
	イタリア	5,078,406,684	0.75
	フランス	23,914,577,714	3.53

	オランダ	9,849,730,969	1.45
	スペイン	5,332,175,304	0.78
	ベルギー	2,173,194,136	0.32
	オーストリア	376,244,981	0.05
	ルクセンブルグ	249,997,820	0.03
	フィンランド	2,250,200,835	0.33
	アイルランド	1,386,592,588	0.20
	ポルトガル	384,952,081	0.05
	イギリス	31,023,481,188	4.59
	スイス	23,451,587,025	3.47
	スウェーデン	7,340,294,962	1.08
	ノルウェー	1,210,958,312	0.17
	デンマーク	5,594,471,003	0.82
	オーストラリア	14,615,070,562	2.16
	ニュージーランド	755,185,800	0.11
	香港	6,484,037,246	0.95
	シンガポール	2,019,780,191	0.29
	イスラエル	684,076,227	0.10
	小計	650,434,248,557	96.26
新株予約権証券	アメリカ	12,996,550	0.00
投資証券	アメリカ	14,010,528,247	2.07
	カナダ	117,180,818	0.01
	フランス	372,900,050	0.05
	イギリス	377,695,771	0.05
	オーストラリア	986,444,067	0.14
	香港	318,635,100	0.04
	シンガポール	380,174,959	0.05
	小計	16,563,559,012	2.45
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	8,632,205,284	1.27
合計（純資産総額）		675,643,009,403	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	6,116,746,497	0.90
	買建	カナダ	288,456,614	0.04
	買建	ドイツ	923,199,491	0.13
	買建	イギリス	399,497,888	0.05
	買建	スイス	302,181,708	0.04
	買建	オーストラリア	192,641,948	0.02

（参考）国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	541,844,415,910	78.76
地方債証券	日本	47,929,725,131	6.96
特殊債券	日本	61,096,092,824	8.88
社債券	日本	30,297,723,900	4.40
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	6,754,000,817	0.98
合計（純資産総額）		687,921,958,582	100.00

（参考）外国債券マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	258,288,190,998	43.81
	カナダ	10,792,104,982	1.83
	メキシコ	4,378,996,147	0.74
	ドイツ	40,741,052,706	6.91
	イタリア	59,474,640,859	10.09
	フランス	59,254,485,045	10.05
	オランダ	10,085,137,807	1.71
	スペイン	38,985,245,621	6.61
	ベルギー	14,458,907,858	2.45
	オーストリア	8,105,454,952	1.37
	フィンランド	2,684,427,180	0.45
	アイルランド	6,501,827,277	1.10
	イギリス	38,710,351,917	6.56
	スウェーデン	1,763,187,008	0.29
	ノルウェー	1,265,980,688	0.21
	デンマーク	3,098,981,281	0.52
	ポーランド	3,691,681,117	0.62
	オーストラリア	13,026,749,856	2.21
	シンガポール	2,508,516,782	0.42
	マレーシア	2,957,414,997	0.50
	イスラエル	2,186,033,457	0.37
	小計	582,959,368,535	98.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	6,473,355,112	1.09
合計（純資産総額）		589,432,723,647	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）

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	228,284,431	1.5880	362,533,271	1.5330	349,960,032	36.93
2	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA－BPI 総合マザーファンド	207,914,275	1.3293	276,385,360	1.3322	276,983,397	29.23
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド	77,841,305	2.7765	216,132,427	2.9070	226,284,673	23.88
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	37,840,423	2.4288	91,909,833	2.4640	93,238,802	9.84

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.89
合 計	99.89

（参考）国内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	2,178,500	6,658.35	14,505,232,040	6,217.00	13,543,734,500	3.22
2	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,520,100	4,692.03	7,132,362,363	6,595.00	10,025,059,500	2.38
3	日本	株式	ソニー	電気機器	1,223,100	7,062.88	8,638,617,270	8,076.00	9,877,755,600	2.35
4	日本	株式	キーエンス	電気機器	176,900	40,017.44	7,079,086,568	44,220.00	7,822,518,000	1.86
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,561,000	2,420.02	6,197,687,056	2,443.50	6,257,803,500	1.49
6	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,624,500	3,764.65	6,115,682,755	3,756.00	6,101,622,000	1.45
7	日本	株式	任天堂	その他製品	119,700	43,656.09	5,225,634,748	46,440.00	5,558,868,000	1.32
8	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	13,172,900	423.78	5,582,518,499	393.20	5,179,584,280	1.23
9	日本	株式	第一三共	医薬品	558,700	7,644.01	4,270,712,364	9,258.00	5,172,444,600	1.23
10	日本	株式	ダイキン工業	機械	248,700	14,069.51	3,499,089,325	18,450.00	4,588,515,000	1.09
11	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,396,700	3,158.54	4,411,541,340	3,259.00	4,551,845,300	1.08
12	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,336,600	3,313.62	4,428,989,958	3,268.00	4,368,008,800	1.04
13	日本	株式	HOYA	精密機器	387,300	9,735.17	3,770,431,779	10,420.00	4,035,666,000	0.96
14	日本	株式	信越化学工業	化学	328,300	12,125.09	3,980,668,980	12,275.00	4,029,882,500	0.96
15	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,370,000	3,078.49	4,217,536,312	2,907.50	3,983,275,000	0.94
16	日本	株式	日本電産	電気機器	469,900	6,250.22	2,936,981,384	8,375.00	3,935,412,500	0.93
17	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,537,300	2,614.71	4,019,600,548	2,524.00	3,880,145,200	0.92

18	日本	株式	村田製作所	電気機器	573,500	6,053.64	3,471,765,165	6,609.00	3,790,261,500	0.90
19	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,331,800	2,817.16	3,751,903,046	2,800.00	3,729,040,000	0.88
20	日本	株式	花王	化学	467,500	8,450.25	3,950,494,639	7,636.00	3,569,830,000	0.85
21	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	123,900	22,742.37	2,817,780,000	28,800.00	3,568,320,000	0.85
22	日本	株式	SMC	機械	61,300	51,147.51	3,135,342,877	55,070.00	3,375,791,000	0.80
23	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	26,166,800	123.37	3,228,205,563	127.60	3,338,883,680	0.79
24	日本	株式	ファナック	電気機器	183,600	17,845.99	3,276,524,640	17,705.00	3,250,638,000	0.77
25	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,345,000	2,235.61	3,006,904,434	2,300.00	3,093,500,000	0.73
26	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	680,900	4,507.88	3,069,416,948	4,436.00	3,020,472,400	0.71
27	日本	株式	日立製作所	電気機器	938,100	3,268.49	3,066,173,772	3,128.00	2,934,376,800	0.69
28	日本	株式	中外製薬	医薬品	610,700	4,246.56	2,593,374,215	4,736.00	2,892,275,200	0.68
29	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,692,800	1,804.82	3,055,204,688	1,650.00	2,793,120,000	0.66
30	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,952,400	1,362.32	2,659,802,635	1,370.50	2,675,764,200	0.63

種類別及び業種別投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.16
		建設業	2.42
		食料品	3.78
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.21
		化学	7.06
		医薬品	6.67
		石油・石炭製品	0.40
		ゴム製品	0.53
		ガラス・土石製品	0.72
		鉄鋼	0.52
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.52
		機械	5.24
		電気機器	15.36
		輸送用機器	6.86
		精密機器	2.58
		その他製品	2.45
		電気・ガス業	1.42
		陸運業	3.45
		海運業	0.12
		空運業	0.30
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	10.55
		卸売業	4.39

	小売業	4.95
	銀行業	4.70
	証券、商品先物取引業	0.80
	保険業	1.81
	その他金融業	1.05
	不動産業	1.83
	サービス業	5.12
	合　　計	97.52

（参考）外国株式MSC I－KOKUSA Iマザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	689,980	26,679.27	18,408,166,854	40,245.89	27,768,863,322	4.10
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	1,139,400	16,769.47	19,107,136,397	21,327.94	24,301,054,836	3.59
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	66,720	206,036.89	13,746,781,702	319,226.64	21,298,801,955	3.15
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	379,200	17,380.33	6,590,623,411	24,528.70	9,301,283,040	1.37
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	48,360	120,058.83	5,806,045,212	160,189.66	7,746,772,441	1.14
6	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	47,260	120,107.99	5,676,303,890	160,913.50	7,604,772,104	1.12
7	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	415,200	13,932.72	5,784,865,344	15,359.46	6,377,249,453	0.94
8	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	468,800	11,493.42	5,388,119,000	12,655.08	5,932,706,005	0.87
9	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	268,800	17,319.66	4,655,526,759	20,298.67	5,456,284,109	0.80
10	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	389,000	12,032.13	4,680,501,682	13,746.53	5,347,400,948	0.79
11	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	484,300	9,774.87	4,733,969,541	10,148.29	4,914,817,816	0.72
12	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	171,800	20,511.01	3,523,792,205	27,856.02	4,785,665,267	0.70
13	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	149,400	26,322.59	3,932,594,946	31,927.05	4,769,902,465	0.70
14	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	140,900	26,492.04	3,732,728,718	32,321.40	4,554,085,260	0.67
15	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	218,300	19,176.31	4,186,190,219	20,323.78	4,436,681,174	0.65

16	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	96,360	28,298.48	2,726,841,918	44,408.97	4,279,248,927	0.63
17	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSSCHEINE)	医薬品	110,640	35,564.80	3,934,890,391	37,008.53	4,094,624,700	0.60
18	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	651,300	5,729.98	3,731,941,184	5,993.58	3,903,618,654	0.57
19	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	23,200	55,951.58	1,298,076,795	155,591.45	3,609,721,733	0.53
20	アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	情報技術サービス	176,200	10,158.75	1,789,972,102	20,136.54	3,548,059,405	0.52
21	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	875,200	3,419.37	2,992,636,125	4,052.20	3,546,488,941	0.52
22	アメリカ	株式	NETFLIX INC	娯楽	69,300	38,849.48	2,692,269,380	50,814.68	3,521,457,324	0.52
23	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	1,129,500	3,161.01	3,570,363,054	3,093.02	3,493,568,349	0.51
24	アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア	75,890	33,318.23	2,528,521,082	45,906.84	3,483,870,695	0.51
25	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	284,300	10,451.63	2,971,398,978	12,098.03	3,439,471,635	0.50
26	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	673,600	5,806.34	3,911,154,665	5,019.75	3,381,306,294	0.50
27	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	399,300	8,052.10	3,215,206,724	8,262.35	3,299,157,952	0.48
28	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	717,700	3,712.25	2,664,284,695	4,567.88	3,278,368,911	0.48
29	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	670,800	4,217.47	2,829,080,217	4,857.62	3,258,494,179	0.48
30	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,237,000	2,304.33	2,850,466,106	2,598.26	3,214,052,568	0.47

種類別及び業種別投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.95
		メディア	1.11
		娯楽	1.47
		不動産管理・開発	0.42
		エネルギー設備・サービス	0.13
		石油・ガス・消耗燃料	3.01
		化学	2.20
		建設資材	0.24
		容器・包装	0.26
		金属・鉱業	1.59
		紙製品・林産品	0.09
		航空宇宙・防衛	1.46
		建設関連製品	0.53
		建設・土木	0.26
		電気設備	0.75
		コングロマリット	1.10
		機械	1.61
		商社・流通業	0.29
		商業サービス・用品	0.45
		航空貨物・物流サービス	0.60

旅客航空輸送業	0.04
海運業	0.05
陸運・鉄道	1.03
運送インフラ	0.16
自動車部品	0.22
自動車	1.06
家庭用耐久財	0.35
レジャー用品	0.02
繊維・アパレル・贅沢品	1.32
ホテル・レストラン・レジャー	1.41
販売	0.05
インターネット販売・通信販売	3.85
複合小売り	0.48
専門小売り	1.75
食品・生活必需品小売り	1.52
飲料	1.82
食品	2.01
タバコ	0.75
家庭用品	1.49
パーソナル用品	0.73
ヘルスケア機器・用品	3.22
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.04
バイオテクノロジー	2.18
医薬品	5.49
銀行	5.21
各種金融サービス	0.89
保険	3.11
情報技術サービス	4.75
ソフトウェア	7.24
通信機器	0.75
コンピュータ・周辺機器	4.34
電子装置・機器・部品	0.52
半導体・半導体製造装置	3.82
各種電気通信サービス	1.78
無線通信サービス	0.29
電力	2.10
ガス	0.16
総合公益事業	1.02
水道	0.12
消費者金融	0.32
資本市場	2.98
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07

		ヘルスケア・テクノロジー	0.18
		ライフサイエンス・ツール/サービス	1.03
		専門サービス	0.76
新株予約権証券	—	—	0.00
投資証券	—	—	2.45
合 計			98.72

（参考）国内債券NOMURA－B P I 総合 マザーファンド

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年) 第13 0回	7,500,000,000	100.40	7,530,375,000	100.35	7,526,400,000	0.1	2021/12/20	1.09
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 34回	6,600,000,000	103.07	6,802,950,000	102.92	6,793,116,000	0.6	2024/6/20	0.98
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 52回	6,600,000,000	101.47	6,697,657,000	101.55	6,702,696,000	0.1	2028/9/20	0.97
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年) 第13 3回	6,200,000,000	100.62	6,238,440,000	100.54	6,233,790,000	0.1	2022/9/20	0.90
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 29回	6,000,000,000	102.98	6,179,135,000	102.76	6,165,720,000	0.8	2023/6/20	0.89
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 43回	5,900,000,000	101.40	5,983,005,000	101.36	5,980,358,000	0.1	2026/6/20	0.86
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 50回	5,850,000,000	101.64	5,946,349,500	101.61	5,944,477,500	0.1	2028/3/20	0.86
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 44回	5,800,000,000	101.50	5,887,058,000	101.42	5,882,418,000	0.1	2026/9/20	0.85
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 51回	5,600,000,000	101.57	5,688,088,000	101.58	5,688,928,000	0.1	2028/6/20	0.82
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年) 第12 9回	5,600,000,000	100.34	5,619,050,000	100.28	5,616,184,000	0.1	2021/9/20	0.81
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 32回	5,400,000,000	102.69	5,545,260,000	102.58	5,539,482,000	0.6	2023/12/20	0.80
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 47回	5,400,000,000	101.67	5,490,218,000	101.59	5,486,184,000	0.1	2027/6/20	0.79
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 41回	5,300,000,000	102.47	5,430,910,000	102.33	5,423,490,000	0.3	2025/12/20	0.78
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 28回	5,250,000,000	102.19	5,365,395,000	101.99	5,354,527,500	0.6	2023/3/20	0.77
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年) 第13 1回	5,300,000,000	100.47	5,325,014,000	100.41	5,322,048,000	0.1	2022/3/20	0.77
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 53回	5,100,000,000	101.40	5,171,502,000	101.47	5,175,225,000	0.1	2028/12/20	0.75
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 55回	5,100,000,000	101.15	5,158,905,000	101.29	5,165,892,000	0.1	2029/6/20	0.75

18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 39回	5,000,000,000	102.73	5,136,630,000	102.60	5,130,100,000	0.4	2025/6/20	0.74
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 38回	5,000,000,000	102.58	5,129,264,000	102.49	5,124,550,000	0.4	2025/3/20	0.74
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 45回	5,000,000,000	101.59	5,079,650,000	101.47	5,073,950,000	0.1	2026/12/20	0.73
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年) 第1 47回	4,200,000,000	118.53	4,978,554,000	118.78	4,989,012,000	1.6	2033/12/20	0.72
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 46回	4,900,000,000	101.68	4,982,712,000	101.53	4,975,313,000	0.1	2027/3/20	0.72
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年) 第13 8回	4,900,000,000	100.82	4,940,180,000	100.88	4,943,267,000	0.1	2023/12/20	0.71
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 56回	4,800,000,000	100.98	4,847,420,000	101.19	4,857,120,000	0.1	2029/9/20	0.70
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 35回	4,600,000,000	102.83	4,730,180,000	102.70	4,724,292,000	0.5	2024/9/20	0.68
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 48回	4,600,000,000	101.81	4,683,352,000	101.61	4,674,474,000	0.1	2027/9/20	0.67
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年) 第1 49回	3,850,000,000	117.73	4,532,961,000	117.79	4,535,069,000	1.5	2034/6/20	0.65
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 25回	4,400,000,000	102.34	4,503,092,000	102.03	4,489,364,000	0.8	2022/9/20	0.65
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年) 第13 9回	4,400,000,000	100.87	4,438,544,000	100.93	4,440,920,000	0.1	2024/3/20	0.64
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 54回	4,350,000,000	101.25	4,404,766,500	101.38	4,410,334,500	0.1	2029/3/20	0.64

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	78.76
地方債証券	6.96
特殊債券	8.88
社債券	4.40
合 計	99.01

(参考) 外国債券マザーファンド

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	72,200,000	13,802.29	9,965,257,966	13,752.44	9,929,267,583	6	2026/2/15	1.68
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	80,800,000	10,869.32	8,782,417,931	10,816.70	8,739,894,966	2.5	2022/1/15	1.48
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	49,300,000	14,507.52	7,152,212,007	14,556.56	7,176,384,413	5.25	2028/11/15	1.21

4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,500,000	12,991.23	6,690,487,243	13,534.25	6,970,143,308	2.5	2046/2/15	1.18
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	46,200,000	14,612.94	6,751,181,216	14,648.08	6,767,415,583	5.5	2028/8/15	1.14
6	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	31,800,000	19,362.93	6,157,414,529	20,193.46	6,421,522,951	5.75	2032/7/30	1.08
7	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	27,900,000	21,851.45	6,096,556,515	21,672.31	6,046,577,141	3.25	2044/1/22	1.02
8	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,550,000	20,034.58	5,719,873,161	21,087.82	6,020,574,052	3.25	2045/5/25	1.02
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	50,500,000	11,703.34	5,910,188,545	11,521.93	5,818,577,056	8	2021/11/15	0.98
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,300,000	11,510.08	5,789,573,095	11,547.67	5,808,480,916	2.25	2025/11/15	0.98
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,700,000	15,577.93	5,405,542,629	15,669.16	5,437,199,072	5.375	2031/2/15	0.92
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	14,024.57	5,175,066,829	14,585.97	5,382,226,408	3	2044/11/15	0.91
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,400,000	12,921.36	5,091,019,287	13,459.89	5,303,198,444	2.5	2045/2/15	0.89
14	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	15,272.33	5,207,866,082	15,330.05	5,227,548,755	3.5	2026/4/25	0.88
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,900,000	10,900.46	5,221,321,910	10,884.11	5,213,493,254	1.75	2023/1/31	0.88
16	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000	16,140.55	4,826,027,305	17,198.21	5,142,265,238	5.25	2029/11/1	0.87
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	11,380.96	5,132,817,257	11,380.96	5,132,817,257	2.375	2024/8/15	0.87
18	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	18,686.75	5,045,423,482	18,880.33	5,097,690,280	5.5	2029/4/25	0.86
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,376.88	4,846,552,521	11,353.18	4,836,457,098	2.75	2023/11/15	0.82
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,700,000	11,291.89	4,821,639,742	11,295.98	4,823,384,326	2.125	2024/9/30	0.81
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,000,000	11,217.53	4,823,538,772	11,206.90	4,818,970,806	2.25	2023/12/31	0.81
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,519.31	4,857,493,250	12,398.36	4,810,567,075	6.25	2023/8/15	0.81
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,100,000	11,307.42	4,647,350,925	11,278.00	4,635,259,819	2.75	2023/7/31	0.78
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,000,000	11,796.91	4,482,829,125	11,860.65	4,507,050,364	2.375	2027/5/15	0.76
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	12,435.70	4,290,319,934	12,981.02	4,478,452,996	2.25	2046/8/15	0.75
26	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	31,100,000	13,856.63	4,309,412,521	13,938.55	4,334,891,445	5.5	2022/11/1	0.73
27	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000	21,073.82	4,235,838,460	21,502.30	4,321,962,816	5.75	2032/10/25	0.73
28	イギリス	国債証券	UK TREASURY	18,440,000	22,977.32	4,237,018,511	22,759.02	4,196,763,786	3.5	2045/1/22	0.71
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	11,765.19	4,058,990,762	11,770.76	4,060,915,219	2.875	2025/4/30	0.68
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	27,500,000	14,615.39	4,019,234,499	14,665.24	4,032,942,747	5.25	2029/2/15	0.68

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------

国債証券	98.90
合 計	98.90

②【投資不動産物件】

マイターゲット2045（確定拠出年金向け）

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

マイターゲット2045（確定拠出年金向け）

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建／ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2020年09月限)	買建	692	日本円	10,868,065,747	10,355,780,000	2.46

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国／地 域	取引所	名称	買建／ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2020 年09月限)	買建	360	米ドル	55,888,250	5,845,910,948	58,477,500	6,116,746,497	0.90

カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2020年09月限)	買建	19	カナダドル	3,553,314	276,732,094	3,703,860	288,456,614	0.04
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	ユーロ50株価指数先物(2020年09月限)	買建	233	ユーロ	7,526,520	934,266,927	7,437,360	923,199,491	0.13
オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200株価指数先物(2020年09月限)	買建	17	豪ドル	2,498,000	188,274,260	2,555,950	192,641,948	0.02
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2020年09月限)	買建	49	英ポンド	3,004,365	412,228,921	2,911,580	399,497,888	0.05
スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SMI株価指数先物(2020年09月限)	買建	26	スイスフラン	2,629,170	302,696,345	2,624,700	302,181,708	0.04

（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）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）

2020年7月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2018年 6月28日)	28	28	1.0108	1.0113
第2計算期間	(2019年 6月28日)	396	396	1.0019	1.0019
第3計算期間	(2020年 6月29日)	875	876	1.0160	1.0165
	2019年 7月末日	428	—	1.0120	—
	8月末日	448	—	0.9913	—
	9月末日	496	—	1.0192	—
	10月末日	542	—	1.0479	—
	11月末日	636	—	1.0636	—
	12月末日	682	—	1.0763	—
	2020年 1月末日	721	—	1.0694	—
	2月末日	711	—	1.0105	—
	3月末日	715	—	0.9471	—

4月末日	781	—	0.9831	—
5月末日	839	—	1.0187	—
6月末日	906	—	1.0222	—
7月末日	947	—	1.0161	—

②【分配の推移】

マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2018年 3月 9日～2018年 6月28日	0.0005円
第2計算期間	2018年 6月29日～2019年 6月28日	0.0000円
第3計算期間	2019年 6月29日～2020年 6月29日	0.0005円

③【収益率の推移】

マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2018年 3月 9日～2018年 6月28日	1.1%
第2計算期間	2018年 6月29日～2019年 6月28日	△0.9%
第3計算期間	2019年 6月29日～2020年 6月29日	1.5%

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

（４）【設定及び解約の実績】

マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2018年 3月 9日～2018年 6月28日	31,418,176	3,096,657	28,321,519
第2計算期間	2018年 6月29日～2019年 6月28日	402,897,247	35,711,574	395,507,192
第3計算期間	2019年 6月29日～2020年 6月29日	567,501,124	101,108,098	861,900,218

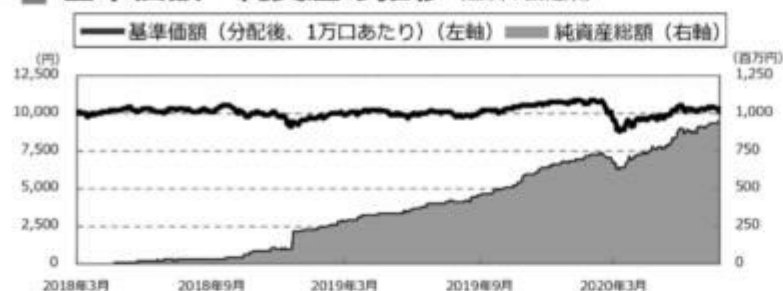
※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

《参考情報》



運用実績（2020年7月31日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次：設定来）



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2020年6月	5 円
2019年6月	0 円
2018年6月	5 円
--	--
--	--
設定来累計	10 円

■ 主要な資産の状況

銘柄別投資比率

順位	銘柄	投資比率(%)
1	国内株式マザーファンド	36.9
2	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	29.2
3	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	23.9
4	外国債券マザーファンド	9.8

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	1.2
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.9
3	ソニー	電気機器	0.9
4	キーエンス	電気機器	0.7
5	日本電信電話	情報・通信業	0.6

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	1.0
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.9
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.8
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.3
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.3

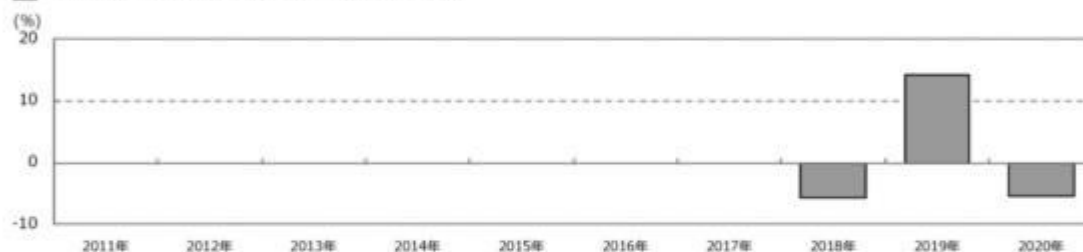
・「国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	国庫債券 利付（５年）第１３０回	国債証券	0.3
2	国庫債券 利付（１０年）第３３４回	国債証券	0.3
3	国庫債券 利付（１０年）第３５２回	国債証券	0.3
4	国庫債券 利付（５年）第１３３回	国債証券	0.3
5	国庫債券 利付（１０年）第３２９回	国債証券	0.3

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

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

■ 年間収益率の推移（暦年ベース）



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドは合成指数をベンチマークとしていますが、年１回基本投資割合を変更するため、暦年ベースで収益率を表示した場合、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマークは掲載しておりません。
- ・2018年は設定日（2018年3月9日）から年末までの収益率。
- ・2020年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・販売の単位は、1円以上1円単位(当初元本1口＝1円)とします。
- ・受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・取得申込日から起算して翌々営業日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。なお、販
売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。
- ・金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8
項第3号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」
という場合があります。取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項
第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）
等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受
益権の取得申込の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取り消す場合があります。

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

2【換金（解約）手続等】

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口換金には制限を設ける場合があります。

- ・解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。
- ・金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消す場合があります。

また、一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして信託約款の規定に準じて計算された価額とします。

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の計算方法＞

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 ^{※1} の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 ^{※1} における以下のいずれかの価額で評価します。 ^{※2} ①日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) ②金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く） ③価格情報会社の提供する価額
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行ないます。

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時

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

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

無期限とします(2018年3月9日設定)。

（４）【計算期間】

原則として、毎年6月29日から翌年6月28日までとします。

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

（５）【その他】

（a）ファンドの繰上償還条項

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

（b）信託期間の終了

（i）委託者は、上記「（a）ファンドの繰上償還条項」に従い信託期間を終了させるには、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

（iii）上記（i）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。

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

（v）委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託

契約を解約し信託を終了させます。

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

(c) 運用報告書

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

(d) 信託約款の変更等

- (i) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとしします。
- (ii) 委託者は、上記(i)の事項（上記(i)の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- (iii) 上記(ii)の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知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。
- (iv) 上記(ii)の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- (v) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- (vi) 上記(ii)から(v)までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (vii) 上記(i)から(vi)の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

- (i) 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、

裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、上記「(d)信託約款の変更等」にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行なう場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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

(g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

1.他の受益者の氏名または名称および住所

2.他の受益者が有する受益権の内容

(i) 関係法人との契約の更新に関する手続

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

① 収益分配金に対する請求権

■収益分配金の支払い開始日■

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

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

■収益分配金請求権の失効■

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

② 償還金に対する請求権

■償還金の支払い開始日■

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

■償還金請求権の失効■

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

③ 換金(解約)請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2019年6月29日から2020年6月29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】

【マイターゲット2045（確定拠出年金向け）】

（１）【貸借対照表】

(単位：円)		
	第2期 (2019年 6月28日現在)	第3期 (2020年 6月29日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,377,039	2,827,651
親投資信託受益証券	395,871,541	874,749,393
流動資産合計	397,248,580	877,577,044
資産合計	397,248,580	877,577,044
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	-	430,950
未払解約金	422,760	12,344
未払受託者報酬	64,463	163,041
未払委託者報酬	515,671	1,304,271
未払利息	2	3
その他未払費用	4,777	12,167
流動負債合計	1,007,673	1,922,776
負債合計	1,007,673	1,922,776
純資産の部		
元本等		
元本	395,507,192	861,900,218
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	733,715	13,754,050
（分配準備積立金）	7,233,095	15,205,594
元本等合計	396,240,907	875,654,268
純資産合計	396,240,907	875,654,268
負債純資産合計	397,248,580	877,577,044

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自 2018年 6月29日 至 2019年 6月28日	第3期 自 2019年 6月29日 至 2020年 6月29日
営業収益		
有価証券売買等損益	8,124,491	4,673,418
営業収益合計	8,124,491	4,673,418
営業費用		
支払利息	189	494
受託者報酬	76,192	274,396
委託者報酬	609,483	2,195,073
その他費用	5,592	20,449
営業費用合計	691,456	2,490,412
営業利益又は営業損失（△）	7,433,035	2,183,006
経常利益又は経常損失（△）	7,433,035	2,183,006
当期純利益又は当期純損失（△）	7,433,035	2,183,006
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（△）	67,220	△270,695
期首剰余金又は期首欠損金（△）	306,973	733,715
剰余金増加額又は欠損金減少額	300,452	12,312,140
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	300,452	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	12,312,140
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,239,525	1,314,556
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	1,314,556
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,239,525	-
分配金	-	430,950
期末剰余金又は期末欠損金（△）	733,715	13,754,050

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2019年 6月29日から2020年 6月29日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第2期 2019年 6月28日現在	第3期 2020年 6月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 395,507,192口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 861,900,218口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0019円 (10,000口当たり純資産額) (10,019円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0160円 (10,000口当たり純資産額) (10,160円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2018年 6月29日 至 2019年 6月28日			第3期 自 2019年 6月29日 至 2020年 6月29日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,391,740円	費用控除後の配当等収益額	A	9,434,792円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	3,836,734円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	931,038円	収益調整金額	C	12,528,007円
分配準備積立金額	D	4,621円	分配準備積立金額	D	6,201,752円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,164,133円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	28,164,551円
当ファンドの期末残存口数	F	395,507,192口	当ファンドの期末残存口数	F	861,900,218口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	206円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	326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	5円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	430,950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2期 自 2018年 6月29日 至 2019年 6月28日	第3期 自 2019年 6月29日 至 2020年 6月29日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	1.金融商品に対する取組方針 同左 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第2期 2019年 6月28日現在	第3期 2020年 6月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2. 時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2018年 6月29日 至 2019年 6月28日	第3期 自 2019年 6月29日 至 2020年 6月29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2期 自 2018年 6月29日 至 2019年 6月28日	第3期 自 2019年 6月29日 至 2020年 6月29日
期首元本額 28,321,519円	期首元本額 395,507,192円
期中追加設定元本額 402,897,247円	期中追加設定元本額 567,501,124円
期中一部解約元本額 35,711,574円	期中一部解約元本額 101,108,098円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2018年 6月29日 至 2019年 6月28日	第3期 自 2019年 6月29日 至 2020年 6月29日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	7,885,126	4,462,289
合計	7,885,126	4,462,289

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年6月29日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2020年6月29日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	213,094,502	338,266,212	
		外国債券マザーファンド	35,786,661	86,872,119	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	73,686,360	204,000,687	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	184,738,906	245,610,375	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.9%	507,306,429	874,749,393 100.0%	
合計				874,749,393	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」および「外国債券マザーファンド」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)

(2020年 6月29日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	23,052,039,785
株式	422,857,718,850
未収入金	407,493,700
未収配当金	1,054,883,897
未収利息	1,600,448
その他未収収益	11,289,481
差入委託証拠金	464,270,000
流動資産合計	447,849,296,161
資産合計	447,849,296,161
負債の部	
流動負債	

派生商品評価勘定	230,386,430
未払金	399,801,100
未払解約金	366,404,205
未払利息	24,523
有価証券貸借取引受入金	14,456,965,999
流動負債合計	15,453,582,257
負債合計	15,453,582,257
純資産の部	
元本等	
元本	272,388,089,682
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	160,007,624,222
元本等合計	432,395,713,904
純資産合計	432,395,713,904
負債純資産合計	447,849,296,161

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2020年 6月29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	1.5874円
(10,000口当たり純資産額)	(15,874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	

（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 2019年 6月29日 至 2020年 6月29日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 6月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 6月29日現在	
期首	2019年 6月29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	258,180,778,909円
同期中における追加設定元本額	69,834,792,982円
同期中における一部解約元本額	55,627,482,209円
期末元本額	272,388,089,682円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	163,615,021円
バランスセレクト５０	370,477,246円
バランスセレクト７０	475,887,271円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	2,675,119,338円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	3,507,719,985円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	7,742,832,182円
野村資産設計ファンド２０１５	47,983,807円
野村資産設計ファンド２０２０	48,764,083円
野村資産設計ファンド２０２５	89,892,934円
野村資産設計ファンド２０３０	110,957,872円
野村資産設計ファンド２０３５	86,200,316円
野村資産設計ファンド２０４０	178,466,049円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	92,441,792,559円
のむラップ・ファンド（保守型）	2,825,501,687円
のむラップ・ファンド（普通型）	8,875,761,120円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,435,585,576円
野村資産設計ファンド２０４５	27,211,638円
野村インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ	1,873,927,803円
マイ・ロード	3,759,248,559円
ネクストコア	14,802,055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	1,463,637,694円
野村ＴＯＰＩＸインデックス（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	3,185,129,202円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	785,960,976円
野村資産設計ファンド２０５０	44,393,716円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	14,687,417円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	6,884,813円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	5,449,794円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	3,451,703円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	309,561,400円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	330,691,036円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	4,846,068円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	4,900,929円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	20,095,260円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	6,331,189円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	22,025,091円
野村６資産均等バランス	1,295,815,226円
世界６資産分散ファンド	114,106,502円
野村資産設計ファンド２０６０	16,488,627円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	495,620,340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）	420,560,172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）	296,828,702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）	650,398,829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）	745,517,430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）	4,098,177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）	9,397,259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）	1,389,813円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	2,831,532,686円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	11,511,927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）	108,104,054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）	92,173,162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）	32,668,755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）	103,916,500円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	262,016,367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）	4,516,732,990円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	77,186,924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）	181,651,529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）	3,251,585,225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）	235,292,365円
野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用）	665,501,209円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	299,898円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	7,366,863円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	29,864,830円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	36,673,259円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	128,327,475円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	10,057,012,695円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	25,560,752,670円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	27,437,306,590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）	31,980,476,084円
マイバランスDC30	3,330,078,843円
マイバランスDC50	5,191,337,144円
マイバランスDC70	4,898,984,649円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,064,677,537円
野村DC運用戦略ファンド	219,548,236円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	17,483,123円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	934,914,620円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	723,376,577円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	579,698,387円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	7,218,362円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	3,568,759円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	45,764,231円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	11,046,265円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	8,178,351円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	7,744,108円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	281,474,316円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	213,094,502円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	105,995,475円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	122,350,408円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	3,587,266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(2020年6月29日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	9,200	2,728.00	25,097,600	
		日本水産	264,300	456.00	120,520,800	貸付有価証券 1,300株
		マルハニチロ	38,200	2,161.00	82,550,200	
		カネコ種苗	8,000	1,428.00	11,424,000	
		サカタのタネ	31,500	3,435.00	108,202,500	貸付有価証券 100株
		ホクト	20,200	2,039.00	41,187,800	貸付有価証券 700株
		ホクリヨウ	4,100	643.00	2,636,300	
		住石ホールディングス	53,400	124.00	6,621,600	
		日鉄鉱業	6,100	4,590.00	27,999,000	
		三井松島ホールディングス	10,300	843.00	8,682,900	
		国際石油開発帝石	1,060,300	659.60	699,373,880	
		石油資源開発	34,500	1,788.00	61,686,000	
		K&Oエナジーグループ	12,800	1,537.00	19,673,600	貸付有価証券 100株
		ヒノキヤグループ	6,600	1,653.00	10,909,800	
		ショーボンドホールディングス	41,100	4,830.00	198,513,000	貸付有価証券 700株
		ミライト・ホールディングス	78,500	1,595.00	125,207,500	
		タマホーム	14,200	1,234.00	17,522,800	貸付有価証券 4,700株（500株）
		サンヨーホームズ	2,300	662.00	1,522,600	
		日本アクア	10,500	591.00	6,205,500	貸付有価証券 2,200株
		ファーストコーポレーション	8,100	544.00	4,406,400	

ベステラ	4,500	991.00	4,459,500	貸付有価証券 2,100株（1,200株）
T A T E R U	54,500	184.00	10,028,000	貸付有価証券 900株
キャンディル	4,400	577.00	2,538,800	貸付有価証券 900株（900株）
スペースバリューホール ディングス	32,200	349.00	11,237,800	
ダイセキ環境ソリュー ション	5,100	989.00	5,043,900	
第一カッター興業	3,300	2,363.00	7,797,900	
明豊ファシリティワーク ス	8,500	586.00	4,981,000	
安藤・間	157,400	604.00	95,069,600	
東急建設	77,400	556.00	43,034,400	貸付有価証券 100株
コムシスホールディング ス	93,700	3,155.00	295,623,500	貸付有価証券 2,500株
ビーアールホールディン グス	28,800	580.00	16,704,000	貸付有価証券 300株
高松コンストラクション グループ	16,400	2,367.00	38,818,800	
東建コーポレーション	8,100	7,020.00	56,862,000	
ソネック	2,700	821.00	2,216,700	
ヤマウラ	11,500	841.00	9,671,500	
大成建設	203,500	3,905.00	794,667,500	貸付有価証券 800株
大林組	610,300	983.00	599,924,900	貸付有価証券 800株
清水建設	619,400	871.00	539,497,400	貸付有価証券 4,800株
飛島建設	17,500	1,029.00	18,007,500	
長谷工コーポレーション	236,300	1,347.00	318,296,100	貸付有価証券 3,200株
松井建設	24,000	667.00	16,008,000	
銭高組	2,700	4,160.00	11,232,000	
鹿島建設	479,200	1,252.00	599,958,400	貸付有価証券 800株
不動テトラ	15,900	1,406.00	22,355,400	
大末建設	7,100	822.00	5,836,200	
鉄建建設	13,300	2,062.00	27,424,600	

西松建設	47,000	2,105.00	98,935,000	貸付有価証券 1,300株
三井住友建設	147,400	466.00	68,688,400	貸付有価証券 1,800株
大豊建設	13,700	2,395.00	32,811,500	
前田建設工業	152,900	799.00	122,167,100	貸付有価証券 100株
佐田建設	13,100	424.00	5,554,400	
ナカノフドー建設	16,700	380.00	6,346,000	
奥村組	33,100	2,481.00	82,121,100	
東鉄工業	26,200	2,692.00	70,530,400	
イチケン	4,400	1,520.00	6,688,000	
富士ピー・エス	9,000	573.00	5,157,000	
浅沼組	6,800	4,120.00	28,016,000	
戸田建設	253,500	683.00	173,140,500	貸付有価証券 8,400株
熊谷組	28,300	2,521.00	71,344,300	
北野建設	3,700	2,678.00	9,908,600	
植木組	2,700	2,540.00	6,858,000	
矢作建設工業	27,000	799.00	21,573,000	
ピーエス三菱	20,100	521.00	10,472,100	貸付有価証券 200株
日本ハウスホールディングス	41,700	272.00	11,342,400	
大東建託	66,600	9,898.00	659,206,800	
新日本建設	26,000	833.00	21,658,000	貸付有価証券 100株
N I P P O	50,500	2,678.00	135,239,000	
東亜道路工業	3,800	3,295.00	12,521,000	
前田道路	53,900	2,055.00	110,764,500	
日本道路	5,900	7,370.00	43,483,000	
東亜建設工業	19,000	1,520.00	28,880,000	貸付有価証券 7,600株（2,700株）
日本国土開発	59,400	595.00	35,343,000	
若築建設	11,000	1,154.00	12,694,000	
東洋建設	68,400	400.00	27,360,000	貸付有価証券 500株
五洋建設	241,900	564.00	136,431,600	貸付有価証券 9,800株

世紀東急工業	29,300	752.00	22,033,600	
福田組	7,100	5,050.00	35,855,000	
住友林業	154,600	1,322.00	204,381,200	貸付有価証券 4,500株
日本基礎技術	20,500	411.00	8,425,500	
巴コーポレーション	27,100	341.00	9,241,100	貸付有価証券 1,200株
大和ハウス工業	603,800	2,510.50	1,515,839,900	
ライト工業	34,900	1,403.00	48,964,700	貸付有価証券 100株
積水ハウス	661,900	2,015.00	1,333,728,500	貸付有価証券 48,900株
日特建設	15,900	758.00	12,052,200	
北陸電気工事	10,600	949.00	10,059,400	
ユアテック	34,900	655.00	22,859,500	貸付有価証券 500株
日本リーテック	12,800	2,467.00	31,577,600	貸付有価証券 3,900株（200株）
四電工	3,300	2,694.00	8,890,200	
中電工	24,600	2,285.00	56,211,000	貸付有価証券 100株
関電工	86,800	903.00	78,380,400	貸付有価証券 200株
きんでん	145,000	1,755.00	254,475,000	貸付有価証券 300株
東京エネシス	20,300	796.00	16,158,800	
トーエネック	6,100	3,805.00	23,210,500	
住友電設	17,200	2,360.00	40,592,000	
日本電設工業	33,500	2,360.00	79,060,000	貸付有価証券 200株
協和エクシオ	92,500	2,581.00	238,742,500	貸付有価証券 1,000株
新日本空調	16,100	2,380.00	38,318,000	貸付有価証券 900株
九電工	42,800	3,115.00	133,322,000	
三機工業	44,000	1,250.00	55,000,000	貸付有価証券 100株
日揮ホールディングス	187,900	1,093.00	205,374,700	貸付有価証券 2,100株
中外炉工業	6,600	1,562.00	10,309,200	

ヤマト	19,500	677.00	13,201,500	
太平電業	14,700	2,325.00	34,177,500	貸付有価証券 100株
高砂熱学工業	53,000	1,559.00	82,627,000	
三晃金属工業	2,600	2,114.00	5,496,400	
朝日工業社	4,100	3,240.00	13,284,000	
明星工業	39,500	800.00	31,600,000	
大気社	29,700	2,924.00	86,842,800	
ダイダン	14,600	2,852.00	41,639,200	
日比谷総合設備	19,600	1,887.00	36,985,200	
フィル・カンパニー	3,500	2,531.00	8,858,500	貸付有価証券 1,600株（800株）
OSJBホールディングス	96,200	230.00	22,126,000	貸付有価証券 2,800株
レイズネクスト	32,700	1,238.00	40,482,600	貸付有価証券 700株
日本製粉	57,200	1,609.00	92,034,800	
日清製粉グループ本社	220,700	1,571.00	346,719,700	貸付有価証券 400株
日東富士製粉	1,400	6,630.00	9,282,000	
昭和産業	17,900	3,290.00	58,891,000	貸付有価証券 8,500株（5,300株）
鳥越製粉	17,300	886.00	15,327,800	
中部飼料	23,900	1,635.00	39,076,500	
フィード・ワン	131,200	202.00	26,502,400	貸付有価証券 100株
東洋精糖	3,300	1,250.00	4,125,000	
日本甜菜製糖	10,200	1,822.00	18,584,400	
三井製糖	17,100	1,982.00	33,892,200	
塩水港精糖	21,100	205.00	4,325,500	貸付有価証券 9,500株
日新製糖	9,200	1,877.00	17,268,400	
森永製菓	45,800	4,265.00	195,337,000	
中村屋	5,100	4,080.00	20,808,000	
江崎グリコ	57,900	5,110.00	295,869,000	貸付有価証券 27,000株
名糖産業	9,400	1,323.00	12,436,200	
井村屋グループ	11,100	2,310.00	25,641,000	
不二家	10,900	2,201.00	23,990,900	

山崎製パン	146,400	1,851.00	270,986,400	貸付有価証券 12,600株
第一屋製パン	3,300	969.00	3,197,700	
モロゾフ	3,300	5,740.00	18,942,000	貸付有価証券 1,500株
亀田製菓	11,100	5,180.00	57,498,000	
寿スピリッツ	18,800	4,385.00	82,438,000	貸付有価証券 200株
カルビー	89,000	2,981.00	265,309,000	貸付有価証券 100株
森永乳業	36,100	4,770.00	172,197,000	
六甲バター	13,000	1,540.00	20,020,000	
ヤクルト本社	134,400	6,240.00	838,656,000	
明治ホールディングス	129,200	8,530.00	1,102,076,000	貸付有価証券 200株
雪印メグミルク	47,000	2,497.00	117,359,000	
プリマハム	30,500	2,732.00	83,326,000	
日本ハム	74,700	4,200.00	313,740,000	貸付有価証券 6,400株
林兼産業	6,500	581.00	3,776,500	
丸大食品	20,800	1,913.00	39,790,400	
S Foods	15,600	2,670.00	41,652,000	
柿安本店	6,800	2,643.00	17,972,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	125,800	643.00	80,889,400	貸付有価証券 20,400株
サッポロホールディングス	66,700	2,003.00	133,600,100	貸付有価証券 1,200株
アサヒグループホールディングス	409,100	3,701.00	1,514,079,100	
キリンホールディングス	828,400	2,232.00	1,848,988,800	貸付有価証券 300株
宝ホールディングス	144,800	951.00	137,704,800	貸付有価証券 2,000株
オエノンホールディングス	51,500	437.00	22,505,500	
養命酒製造	6,000	1,872.00	11,232,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	137,100	1,937.00	265,562,700	貸付有価証券 100株
サントリー食品インターナショナル	130,700	4,180.00	546,326,000	

ダイドーグループホールディングス	10,000	4,900.00	49,000,000	貸付有価証券 4,600株（3,800株）
伊藤園	59,300	6,230.00	369,439,000	貸付有価証券 24,800株（13,600株）
キーコーヒー	19,200	2,316.00	44,467,200	
ユニカフェ	5,000	981.00	4,905,000	
ジャパンフーズ	2,800	1,202.00	3,365,600	
日清オイリオグループ	25,100	3,375.00	84,712,500	
不二製油グループ本社	47,600	2,778.00	132,232,800	貸付有価証券 2,400株
かどや製油	2,100	3,750.00	7,875,000	
J-オイルミルズ	10,100	3,995.00	40,349,500	
キッコーマン	140,600	5,080.00	714,248,000	貸付有価証券 15,400株
味の素	431,400	1,808.00	779,971,200	貸付有価証券 200株
キューピー	108,800	2,031.00	220,972,800	貸付有価証券 3,500株
ハウス食品グループ本社	73,100	3,455.00	252,560,500	
カゴメ	74,100	3,190.00	236,379,000	貸付有価証券 34,600株
焼津水産化学工業	9,500	929.00	8,825,500	
アリアケジャパン	17,800	6,680.00	118,904,000	貸付有価証券 400株
ピエトロ	2,600	1,634.00	4,248,400	
エバラ食品工業	4,700	2,187.00	10,278,900	
やまみ	1,700	2,260.00	3,842,000	
ニチレイ	93,000	3,105.00	288,765,000	貸付有価証券 500株
東洋水産	100,500	6,110.00	614,055,000	貸付有価証券 100株
イトアアンド	6,800	1,786.00	12,144,800	
大冷	2,500	2,030.00	5,075,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,800	1,061.00	11,458,800	貸付有価証券 400株
日清食品ホールディングス	83,000	9,500.00	788,500,000	貸付有価証券 300株
永谷園ホールディングス	9,500	2,203.00	20,928,500	
一正蒲鉾	7,600	1,003.00	7,622,800	貸付有価証券 3,600株

フジッコ	21,100	2,008.00	42,368,800	
ロック・フィールド	21,000	1,297.00	27,237,000	貸付有価証券 1,000株
日本たばこ産業	1,127,900	1,997.00	2,252,416,300	貸付有価証券 170,900株
ケンコーマヨネーズ	11,000	1,973.00	21,703,000	
わらべや日洋ホールディングス	12,800	1,677.00	21,465,600	
なとり	10,900	1,787.00	19,478,300	貸付有価証券 4,200株
イフジ産業	3,400	823.00	2,798,200	
ピクルスコーポレーション	4,300	2,458.00	10,569,400	
北の達人コーポレーション	68,200	521.00	35,532,200	貸付有価証券 25,400株（8,800株）
ユウグレナ	84,200	775.00	65,255,000	貸付有価証券 6,000株（600株）
ミヨシ油脂	7,500	1,138.00	8,535,000	
理研ビタミン	18,400	2,325.00	42,780,000	
片倉工業	27,700	1,161.00	32,159,700	貸付有価証券 100株
グンゼ	14,000	3,990.00	55,860,000	
東洋紡	75,300	1,480.00	111,444,000	
ユニチカ	55,800	340.00	18,972,000	貸付有価証券 26,000株（8,600株）
富士紡ホールディングス	9,200	3,230.00	29,716,000	
倉敷紡績	18,900	2,247.00	42,468,300	貸付有価証券 1,600株
シキボウ	10,000	988.00	9,880,000	
日本毛織	62,700	1,054.00	66,085,800	
ダイトウボウ	30,800	113.00	3,480,400	貸付有価証券 14,400株
トーア紡コーポレーション	7,600	503.00	3,822,800	
ダイドーリミテッド	25,100	218.00	5,471,800	貸付有価証券 100株
帝国繊維	21,500	2,283.00	49,084,500	
帝人	155,500	1,685.00	262,017,500	貸付有価証券 600株
東レ	1,380,100	494.90	683,011,490	貸付有価証券

				18,200株
サカイオーベックス	5,100	2,233.00	11,388,300	
住江織物	4,200	2,000.00	8,400,000	
日本フェルト	10,800	475.00	5,130,000	貸付有価証券 4,800株
イチカワ	2,700	1,300.00	3,510,000	
日東製網	2,200	1,398.00	3,075,600	
アツギ	15,700	610.00	9,577,000	
ダイニック	7,200	752.00	5,414,400	
セーレン	46,900	1,389.00	65,144,100	
ソトー	7,600	955.00	7,258,000	
東海染工	2,600	1,132.00	2,943,200	
小松マテーレ	31,300	757.00	23,694,100	
ワコールホールディングス	47,600	1,986.00	94,533,600	
ホギメディカル	21,700	3,320.00	72,044,000	
クラウドシアホールディングス	4,700	455.00	2,138,500	貸付有価証券 2,200株
T S I ホールディングス	63,900	456.00	29,138,400	貸付有価証券 100株
マツオカコーポレーション	5,500	1,943.00	10,686,500	
ワールド	27,000	1,645.00	44,415,000	貸付有価証券 1,000株
三陽商会	9,900	721.00	7,137,900	貸付有価証券 1,900株
ナイガイ	7,000	360.00	2,520,000	
オンワードホールディングス	114,500	320.00	36,640,000	
ルックホールディングス	6,500	779.00	5,063,500	
ゴールドウイン	34,500	7,170.00	247,365,000	
デサント	37,200	1,464.00	54,460,800	貸付有価証券 600株
キング	9,000	525.00	4,725,000	
ヤマトインターナショナル	16,700	408.00	6,813,600	
特種東海製紙	12,100	4,665.00	56,446,500	
王子ホールディングス	796,800	498.00	396,806,400	貸付有価証券 1,100株
日本製紙	84,300	1,503.00	126,702,900	

三菱製紙	21,600	351.00	7,581,600	
北越コーポレーション	113,600	381.00	43,281,600	貸付有価証券 700株
中越パルプ工業	8,100	1,573.00	12,741,300	
巴川製紙所	5,600	944.00	5,286,400	
大王製紙	84,000	1,447.00	121,548,000	貸付有価証券 40,100株（27,800株）
阿波製紙	4,900	493.00	2,415,700	
レンゴー	180,200	872.00	157,134,400	貸付有価証券 9,200株
トーモク	11,700	1,762.00	20,615,400	
ザ・パック	14,400	3,050.00	43,920,000	貸付有価証券 6,800株
クラレ	300,200	1,104.00	331,420,800	貸付有価証券 3,500株
旭化成	1,263,400	855.50	1,080,838,700	貸付有価証券 400株
共和レザー	10,400	680.00	7,072,000	
昭和電工	135,700	2,398.00	325,408,600	貸付有価証券 17,200株
住友化学	1,400,400	312.00	436,924,800	貸付有価証券 82,100株
住友精化	8,400	3,540.00	29,736,000	
日産化学	105,900	5,400.00	571,860,000	貸付有価証券 600株
ラサ工業	6,700	1,525.00	10,217,500	
クレハ	16,300	4,715.00	76,854,500	
多木化学	7,400	7,780.00	57,572,000	貸付有価証券 2,700株
テイカ	14,000	1,380.00	19,320,000	
石原産業	34,200	697.00	23,837,400	
片倉コープアグリ	4,900	1,233.00	6,041,700	
日本曹達	28,200	2,792.00	78,734,400	貸付有価証券 200株
東ソー	294,600	1,431.00	421,572,600	貸付有価証券 200株
トクヤマ	54,900	2,466.00	135,383,400	貸付有価証券 300株
セントラル硝子	39,000	1,809.00	70,551,000	
東亜合成	119,600	1,022.00	122,231,200	

大阪ソーダ	19,400	2,409.00	46,734,600	
関東電化工業	45,200	827.00	37,380,400	
デンカ	69,600	2,591.00	180,333,600	
信越化学工業	327,300	12,280.00	4,019,244,000	貸付有価証券 800株
日本カーバイド工業	6,500	1,218.00	7,917,000	
堺化学工業	12,300	2,004.00	24,649,200	
第一稀元素化学工業	20,600	784.00	16,150,400	
エア・ウォーター	177,300	1,516.00	268,786,800	貸付有価証券 1,200株
大陽日酸	183,200	1,751.00	320,783,200	
日本化学工業	5,900	2,307.00	13,611,300	貸付有価証券 200株
東邦アセチレン	2,900	1,250.00	3,625,000	
日本パーカライジング	96,100	1,088.00	104,556,800	
高压ガス工業	30,200	758.00	22,891,600	
チタン工業	2,400	1,752.00	4,204,800	貸付有価証券 700株
四国化成工業	29,400	1,098.00	32,281,200	貸付有価証券 100株
戸田工業	4,400	1,925.00	8,470,000	
ステラ ケミファ	10,400	2,386.00	24,814,400	
保土谷化学工業	7,100	4,265.00	30,281,500	
日本触媒	29,600	5,590.00	165,464,000	貸付有価証券 7,200株（1,600株）
大日精化工業	16,900	2,348.00	39,681,200	
カネカ	49,300	2,716.00	133,898,800	貸付有価証券 200株
三菱瓦斯化学	177,300	1,589.00	281,729,700	
三井化学	173,100	2,197.00	380,300,700	貸付有価証券 100株
J S R	177,600	2,032.00	360,883,200	貸付有価証券 100株
東京応化工業	32,700	5,360.00	175,272,000	貸付有価証券 100株
大阪有機化学工業	17,600	2,572.00	45,267,200	
三菱ケミカルホールディングス	1,274,200	611.60	779,300,720	貸付有価証券 121,900株
KHネオケム	33,600	1,970.00	66,192,000	

ダイセル	248,200	816.00	202,531,200	貸付有価証券 100株
住友ベークライト	30,000	2,890.00	86,700,000	
積水化学工業	403,100	1,494.00	602,231,400	貸付有価証券 2,600株
日本ゼオン	171,900	968.00	166,399,200	貸付有価証券 200株
アイカ工業	57,200	3,510.00	200,772,000	貸付有価証券 100株
宇部興産	96,300	1,797.00	173,051,100	
積水樹脂	34,300	2,189.00	75,082,700	
タキロンシーアイ	41,200	682.00	28,098,400	
旭有機材	10,800	1,440.00	15,552,000	
ニチバン	10,000	1,483.00	14,830,000	貸付有価証券 100株
リケンテクノス	47,900	424.00	20,309,600	
大倉工業	9,000	1,622.00	14,598,000	貸付有価証券 4,300株
積水化成品工業	25,600	576.00	14,745,600	
群栄化学工業	4,300	2,606.00	11,205,800	
タイガースポリマー	10,000	493.00	4,930,000	
ミライアル	6,700	1,013.00	6,787,100	
ダイキアクシス	6,700	821.00	5,500,700	
ダイキョーニシカワ	40,200	474.00	19,054,800	
竹本容器	6,800	710.00	4,828,000	貸付有価証券 500株
森六ホールディングス	10,200	1,649.00	16,819,800	
日本化薬	118,000	1,078.00	127,204,000	貸付有価証券 1,500株
カーリットホールディングス	20,300	503.00	10,210,900	貸付有価証券 9,200株
日本精化	15,300	1,448.00	22,154,400	
扶桑化学工業	19,300	3,870.00	74,691,000	貸付有価証券 3,800株
トリケミカル研究所	4,200	11,200.00	47,040,000	貸付有価証券 100株
ADEKA	87,700	1,403.00	123,043,100	貸付有価証券 100株
日油	71,800	3,730.00	267,814,000	
新日本理化	31,500	167.00	5,260,500	

ハリマ化成グループ	15,800	1,011.00	15,973,800	
花王	466,000	8,491.00	3,956,806,000	
第一工業製薬	7,100	5,260.00	37,346,000	
石原ケミカル	5,200	1,978.00	10,285,600	
日華化学	6,400	970.00	6,208,000	
ニイタカ	4,000	5,980.00	23,920,000	貸付有価証券 1,000株
三洋化成工業	11,400	4,665.00	53,181,000	
有機合成薬品工業	14,600	365.00	5,329,000	貸付有価証券 6,000株（1,500株）
大日本塗料	21,500	907.00	19,500,500	貸付有価証券 200株
日本ペイントホールディングス	157,300	7,960.00	1,252,108,000	貸付有価証券 400株
関西ペイント	214,100	2,244.00	480,440,400	
神東塗料	15,000	174.00	2,610,000	貸付有価証券 500株
中国塗料	54,300	790.00	42,897,000	
日本特殊塗料	14,300	985.00	14,085,500	
藤倉化成	25,700	537.00	13,800,900	
太陽ホールディングス	14,000	4,940.00	69,160,000	
D I C	80,500	2,636.00	212,198,000	貸付有価証券 1,000株
サカタインクス	41,600	1,011.00	42,057,600	
東洋インキ S C ホールディングス	40,300	2,000.00	80,600,000	貸付有価証券 18,400株
T & K T O K A	14,800	817.00	12,091,600	
富士フイルムホールディングス	373,100	4,626.00	1,725,960,600	
資生堂	386,700	6,808.00	2,632,653,600	貸付有価証券 3,800株
ライオン	253,000	2,558.00	647,174,000	
高砂香料工業	12,200	2,158.00	26,327,600	
マンダム	43,700	1,989.00	86,919,300	
ミルボン	26,000	5,090.00	132,340,000	貸付有価証券 100株
ファンケル	78,800	3,140.00	247,432,000	貸付有価証券 34,200株
コーセー	36,600	12,800.00	468,480,000	貸付有価証券

				3,600株
コタ	11,200	1,198.00	13,417,600	
シーボン	2,500	2,029.00	5,072,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	83,100	1,827.00	151,823,700	
ノエビアホールディングス	16,500	4,555.00	75,157,500	
アジュバンコスメジャパン	4,300	954.00	4,102,200	貸付有価証券 100株（100株）
エステー	12,500	1,696.00	21,200,000	
アグロ カネショウ	8,100	1,399.00	11,331,900	貸付有価証券 100株
コニシ	32,000	1,514.00	48,448,000	
長谷川香料	33,500	2,482.00	83,147,000	
星光PMC	11,100	701.00	7,781,100	
小林製薬	54,500	9,510.00	518,295,000	貸付有価証券 2,400株
荒川化学工業	17,500	1,237.00	21,647,500	
メック	13,300	2,106.00	28,009,800	
日本高純度化学	5,300	2,668.00	14,140,400	
タカラバイオ	50,900	3,090.00	157,281,000	貸付有価証券 5,800株（1,000株）
J C U	23,600	3,255.00	76,818,000	
新田ゼラチン	12,200	663.00	8,088,600	
O A Tアグリオ	3,300	1,051.00	3,468,300	
デクセリアルズ	50,300	830.00	41,749,000	
アース製薬	14,700	7,730.00	113,631,000	貸付有価証券 7,000株
北興化学工業	19,900	635.00	12,636,500	
大成ラミック	6,400	2,840.00	18,176,000	
クミアイ化学工業	80,500	989.00	79,614,500	貸付有価証券 100株
日本農薬	34,700	451.00	15,649,700	
アキレス	13,400	2,001.00	26,813,400	貸付有価証券 200株
有沢製作所	30,800	792.00	24,393,600	貸付有価証券 800株
日東電工	134,300	5,940.00	797,742,000	
レック	20,800	1,628.00	33,862,400	貸付有価証券

				300株
三光合成	22,300	286.00	6,377,800	
きもと	33,100	152.00	5,031,200	
藤森工業	17,500	3,720.00	65,100,000	
前澤化成工業	12,400	1,000.00	12,400,000	
未来工業	10,400	1,975.00	20,540,000	
ウェーブロックホールディングス	6,700	888.00	5,949,600	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
J S P	11,400	1,461.00	16,655,400	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	21,400	8,700.00	186,180,000	
天馬	13,000	1,687.00	21,931,000	
信越ポリマー	34,900	884.00	30,851,600	
東リ	48,500	277.00	13,434,500	
ニフコ	71,500	2,243.00	160,374,500	貸付有価証券 1,200株
バルカー	15,800	1,851.00	29,245,800	
ユニ・チャーム	375,100	4,416.00	1,656,441,600	
ショーエイコーポレーション	2,900	929.00	2,694,100	
協和キリン	195,800	2,809.00	550,002,200	貸付有価証券 1,400株
武田薬品工業	1,619,300	3,882.00	6,286,122,600	貸付有価証券 1,500株
アステラス製薬	1,687,400	1,813.50	3,060,099,900	貸付有価証券 4,600株
大日本住友製薬	144,300	1,453.00	209,667,900	貸付有価証券 1,200株
塩野義製薬	244,800	6,658.00	1,629,878,400	貸付有価証券 500株
わかもと製薬	23,200	271.00	6,287,200	
あすか製薬	22,200	1,232.00	27,350,400	
日本新薬	50,900	8,820.00	448,938,000	
バイオフェルミン製薬	3,300	2,400.00	7,920,000	
中外製薬	608,700	5,821.00	3,543,242,700	
科研製薬	33,300	5,530.00	184,149,000	貸付有価証券 100株
エーザイ	233,000	8,535.00	1,988,655,000	貸付有価証券 1,000株
ロート製薬	99,900	3,480.00	347,652,000	貸付有価証券

				300株
小野薬品工業	446,900	3,139.00	1,402,819,100	貸付有価証券 600株
久光製薬	51,500	5,810.00	299,215,000	
持田製薬	27,000	4,060.00	109,620,000	
参天製薬	362,700	2,037.00	738,819,900	貸付有価証券 1,200株
扶桑薬品工業	6,900	2,560.00	17,664,000	
日本ケミファ	2,600	2,680.00	6,968,000	
ツムラ	60,300	2,843.00	171,432,900	
日医工	55,100	1,311.00	72,236,100	貸付有価証券 100株
キッセイ薬品工業	34,400	2,670.00	91,848,000	
生化学工業	37,800	1,154.00	43,621,200	
栄研化学	34,200	1,716.00	58,687,200	貸付有価証券 1,600株
日水製薬	8,200	1,166.00	9,561,200	
鳥居薬品	12,200	3,030.00	36,966,000	貸付有価証券 100株
J C Rファーマ	13,700	11,770.00	161,249,000	
東和薬品	24,900	2,002.00	49,849,800	
富士製薬工業	13,200	1,208.00	15,945,600	
沢井製薬	40,000	5,640.00	225,600,000	
ゼリア新薬工業	35,300	2,010.00	70,953,000	貸付有価証券 100株
第一三共	556,900	8,826.00	4,915,199,400	貸付有価証券 1,900株
キョーリン製薬ホールディングス	42,900	2,218.00	95,152,200	貸付有価証券 600株
大幸薬品	23,800	2,626.00	62,498,800	貸付有価証券 4,500株（4,500株）
ダイト	11,900	3,990.00	47,481,000	
大塚ホールディングス	370,800	4,675.00	1,733,490,000	貸付有価証券 700株
大正製薬ホールディングス	41,200	6,640.00	273,568,000	
ペプチドリーム	98,900	4,880.00	482,632,000	貸付有価証券 27,000株
日本コークス工業	164,400	65.00	10,686,000	貸付有価証券 400株

ニチレキ	23,000	1,595.00	36,685,000	
ユシロ化学工業	10,900	1,374.00	14,976,600	
ビーピー・カストロール	6,900	1,180.00	8,142,000	
富士石油	52,000	170.00	8,840,000	
MORESCO	7,000	1,015.00	7,105,000	
出光興産	216,000	2,258.00	487,728,000	貸付有価証券 7,700株
ENEOSホールディングス	2,927,800	378.30	1,107,586,740	貸付有価証券 333,200株
コスモエネルギーホールディングス	56,300	1,538.00	86,589,400	
横浜ゴム	112,700	1,495.00	168,486,500	
TOYO TIRE	111,700	1,407.00	157,161,900	貸付有価証券 7,500株
ブリヂストン	560,600	3,455.00	1,936,873,000	
住友ゴム工業	174,800	1,049.00	183,365,200	
藤倉コンポジット	17,000	368.00	6,256,000	
オカモト	11,800	3,920.00	46,256,000	
フコク	8,500	690.00	5,865,000	貸付有価証券 1,300株
ニッタ	22,000	2,329.00	51,238,000	貸付有価証券 300株
住友理工	37,700	608.00	22,921,600	
三ツ星ベルト	25,600	1,728.00	44,236,800	
バンドー化学	34,200	658.00	22,503,600	
日東紡績	29,000	5,280.00	153,120,000	貸付有価証券 12,400株
AGC	192,400	3,020.00	581,048,000	
日本板硝子	93,100	360.00	33,516,000	貸付有価証券 41,200株
石塚硝子	3,600	1,951.00	7,023,600	
日本山村硝子	8,100	848.00	6,868,800	
日本電気硝子	78,200	1,665.00	130,203,000	
オハラ	7,700	1,071.00	8,246,700	貸付有価証券 3,100株（300株）
住友大阪セメント	36,800	3,805.00	140,024,000	
太平洋セメント	122,900	2,448.00	300,859,200	
日本ヒューム	19,500	771.00	15,034,500	
日本コンクリート工業	41,900	272.00	11,396,800	

三谷セキサン	9,100	5,560.00	50,596,000	
アジアパイルホールディングス	27,600	475.00	13,110,000	
東海カーボン	203,900	1,001.00	204,103,900	貸付有価証券 79,800株（21,300株）
日本カーボン	10,000	3,415.00	34,150,000	貸付有価証券 100株
東洋炭素	11,400	1,671.00	19,049,400	貸付有価証券 400株
ノリタケカンパニーリミテド	10,800	3,540.00	38,232,000	
TOTO	139,000	4,095.00	569,205,000	貸付有価証券 4,700株
日本碍子	233,600	1,459.00	340,822,400	
日本特殊陶業	148,000	1,527.00	225,996,000	
ダントーホールディングス	14,500	89.00	1,290,500	貸付有価証券 500株（300株）
MARUWA	7,500	8,150.00	61,125,000	
品川リフラクトリーズ	5,100	2,205.00	11,245,500	
黒崎播磨	3,900	3,670.00	14,313,000	
ヨータイ	15,500	716.00	11,098,000	
イソライト工業	10,000	447.00	4,470,000	
東京窯業	24,700	301.00	7,434,700	
ニッカトー	8,800	724.00	6,371,200	貸付有価証券 2,100株
フジミインコーポレーテッド	17,300	3,215.00	55,619,500	貸付有価証券 2,500株
クニミネ工業	7,900	964.00	7,615,600	
エーアンドエーマテリアル	3,300	1,078.00	3,557,400	
ニチアス	53,300	2,192.00	116,833,600	
ニチハ	27,100	2,347.00	63,603,700	貸付有価証券 200株
日本製鉄	861,300	975.80	840,456,540	貸付有価証券 9,700株
神戸製鋼所	352,300	363.00	127,884,900	貸付有価証券 62,200株
中山製鋼所	26,700	364.00	9,718,800	
合同製鐵	10,400	1,816.00	18,886,400	
ジェイ エフ イー	519,800	748.00	388,810,400	貸付有価証券

ホールディングス				1,400株
東京製鐵	93,700	622.00	58,281,400	貸付有価証券 100株
共英製鋼	21,700	1,298.00	28,166,600	貸付有価証券 9,800株
大和工業	40,900	2,156.00	88,180,400	貸付有価証券 1,900株
東京鐵鋼	7,900	1,520.00	12,008,000	貸付有価証券 1,400株
大阪製鐵	10,200	1,257.00	12,821,400	
淀川製鋼所	26,000	1,846.00	47,996,000	
丸一鋼管	62,500	2,662.00	166,375,000	
モリ工業	5,800	2,439.00	14,146,200	
大同特殊鋼	31,500	3,280.00	103,320,000	貸付有価証券 100株
日本高周波鋼業	7,100	376.00	2,669,600	貸付有価証券 100株
日本冶金工業	15,900	1,580.00	25,122,000	貸付有価証券 1,100株
山陽特殊製鋼	13,200	888.00	11,721,600	貸付有価証券 100株
愛知製鋼	10,800	3,105.00	33,534,000	
日立金属	207,300	1,265.00	262,234,500	貸付有価証券 2,400株
日本金属	4,500	607.00	2,731,500	
大太平洋金属	13,000	1,525.00	19,825,000	貸付有価証券 300株
新日本電工	124,000	166.00	20,584,000	貸付有価証券 1,200株
栗本鐵工所	9,500	1,781.00	16,919,500	貸付有価証券 100株
虹技	2,800	1,272.00	3,561,600	
日本鑄鉄管	2,000	1,311.00	2,622,000	
三菱製鋼	14,200	672.00	9,542,400	
日亜鋼業	28,100	273.00	7,671,300	
日本精線	3,100	3,360.00	10,416,000	
エンビプロ・ホールディングス	8,200	593.00	4,862,600	貸付有価証券 700株（100株）
シンニッタン	29,900	235.00	7,026,500	
新家工業	4,400	1,165.00	5,126,000	

大紀アルミニウム工業所	31,600	559.00	17,664,400	
日本軽金属ホールディングス	487,000	182.00	88,634,000	貸付有価証券 14,600株
三井金属鉱業	51,900	2,175.00	112,882,500	
東邦亜鉛	9,900	1,489.00	14,741,100	
三菱マテリアル	127,100	2,250.00	285,975,000	
住友金属鉱山	246,000	2,957.50	727,545,000	貸付有価証券 1,400株
DOWAホールディングス	48,700	3,235.00	157,544,500	
古河機械金属	34,200	1,083.00	37,038,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,000	902.00	18,040,000	貸付有価証券 3,800株（300株）
東邦チタニウム	34,500	630.00	21,735,000	貸付有価証券 7,000株（3,100株）
UACJ	29,200	1,923.00	56,151,600	
CKサンエツ	4,000	3,350.00	13,400,000	
古河電気工業	59,800	2,592.00	155,001,600	貸付有価証券 600株
住友電気工業	719,600	1,214.50	873,954,200	貸付有価証券 20,300株
フジクラ	232,400	308.00	71,579,200	貸付有価証券 6,000株（3,300株）
昭和電線ホールディングス	22,400	1,144.00	25,625,600	
東京特殊電線	2,900	2,180.00	6,322,000	
タツタ電線	38,200	580.00	22,156,000	貸付有価証券 200株
カナレ電気	3,200	1,765.00	5,648,000	貸付有価証券 1,500株
平河ヒューテック	9,600	1,070.00	10,272,000	貸付有価証券 400株
リョービ	23,700	1,195.00	28,321,500	
アールスティ	25,200	358.00	9,021,600	
アサヒホールディングス	33,700	2,852.00	96,112,400	
稲葉製作所	10,800	1,412.00	15,249,600	貸付有価証券 5,100株
宮地エンジニアリンググループ	5,900	1,695.00	10,000,500	貸付有価証券 400株
トーカロ	53,500	1,145.00	61,257,500	

アルファC o	6,800	956.00	6,500,800	
SUMCO	228,700	1,588.00	363,175,600	
川田テクノロジーズ	3,900	4,820.00	18,798,000	
RS Technologies	5,500	3,380.00	18,590,000	
信和	11,100	738.00	8,191,800	
東洋製罐グループホールディングス	122,600	1,179.00	144,545,400	貸付有価証券 2,300株
ホッカホールディングス	10,600	1,851.00	19,620,600	
コロナ	10,600	1,070.00	11,342,000	
横河ブリッジホールディングス	35,800	2,192.00	78,473,600	
駒井ハルテック	3,600	1,508.00	5,428,800	
高田機工	1,800	2,376.00	4,276,800	
三和ホールディングス	181,500	939.00	170,428,500	貸付有価証券 300株
文化シャッター	56,700	745.00	42,241,500	
三協立山	24,800	954.00	23,659,200	
アルインコ	14,000	948.00	13,272,000	
東洋シャッター	4,600	718.00	3,302,800	
LIXILグループ	284,000	1,480.00	420,320,000	貸付有価証券 24,800株（1,400株）
日本ファイルコン	14,700	515.00	7,570,500	
ノーリツ	39,900	1,321.00	52,707,900	
長府製作所	19,600	2,294.00	44,962,400	
リンナイ	37,400	9,150.00	342,210,000	
ダイニチ工業	10,400	727.00	7,560,800	
日東精工	26,600	462.00	12,289,200	
三洋工業	2,600	1,922.00	4,997,200	
岡部	39,000	809.00	31,551,000	貸付有価証券 18,500株
ジーテクト	23,900	998.00	23,852,200	
東プレ	35,900	1,194.00	42,864,600	
高周波熱錬	37,000	565.00	20,905,000	貸付有価証券 16,700株
東京製綱	13,800	570.00	7,866,000	
サンコール	14,400	459.00	6,609,600	
モリテック スチール	15,000	316.00	4,740,000	

パイオラックス	28,500	1,624.00	46,284,000	貸付有価証券 100株
エイチワン	18,900	547.00	10,338,300	
日本発條	206,500	693.00	143,104,500	貸付有価証券 700株
中央発條	2,300	2,867.00	6,594,100	
アドバネクス	2,800	1,362.00	3,813,600	
立川ブラインド工業	8,500	1,315.00	11,177,500	貸付有価証券 3,900株
三益半導体工業	15,000	2,323.00	34,845,000	
日本ドライケミカル	4,800	1,744.00	8,371,200	貸付有価証券 100株
日本製鋼所	58,400	1,508.00	88,067,200	
三浦工業	83,300	4,430.00	369,019,000	貸付有価証券 1,300株
タクマ	65,200	1,486.00	96,887,200	貸付有価証券 100株
ツガミ	39,900	869.00	34,673,100	
オークマ	22,400	4,435.00	99,344,000	
芝浦機械	21,700	2,143.00	46,503,100	
アマダ	238,700	859.00	205,043,300	
アイダエンジニアリング	50,400	716.00	36,086,400	
滝澤鉄工所	6,000	1,038.00	6,228,000	
F U J I	82,800	1,869.00	154,753,200	貸付有価証券 15,100株（15,100株）
牧野フライス製作所	22,600	3,240.00	73,224,000	
オーエスジー	89,000	1,664.00	148,096,000	貸付有価証券 200株
ダイジェット工業	2,200	1,282.00	2,820,400	
旭ダイヤモンド工業	50,500	497.00	25,098,500	
DMG森精機	121,800	1,256.00	152,980,800	貸付有価証券 1,100株
ソディック	45,200	786.00	35,527,200	貸付有価証券 1,400株
ディスコ	26,100	25,920.00	676,512,000	
日東工器	10,500	1,812.00	19,026,000	
日進工具	7,600	2,775.00	21,090,000	
パンチ工業	17,400	430.00	7,482,000	
富士ダイス	8,500	667.00	5,669,500	

豊和工業	10,600	783.00	8,299,800	貸付有価証券 3,500株（700株）
OKK	7,900	421.00	3,325,900	
東洋機械金属	13,800	416.00	5,740,800	
津田駒工業	3,700	867.00	3,207,900	貸付有価証券 1,700株
エンシュウ	4,600	919.00	4,227,400	
島精機製作所	30,300	1,497.00	45,359,100	貸付有価証券 200株
オプトラン	21,400	2,579.00	55,190,600	
NCホールディングス	5,800	550.00	3,190,000	
イワキポンプ	12,200	1,050.00	12,810,000	
フリーー	18,800	1,009.00	18,969,200	
ヤマシンフィルタ	41,800	1,088.00	45,478,400	貸付有価証券 800株
日阪製作所	23,700	744.00	17,632,800	
やまびこ	37,300	909.00	33,905,700	
平田機工	9,100	5,550.00	50,505,000	貸付有価証券 300株
ペガサスミシン製造	19,500	321.00	6,259,500	貸付有価証券 200株
マルマエ	7,100	998.00	7,085,800	貸付有価証券 1,900株
タツモ	9,000	1,818.00	16,362,000	
ナブテスコ	113,400	3,220.00	365,148,000	
三井海洋開発	20,500	1,434.00	29,397,000	貸付有価証券 100株
レオン自動機	18,900	1,246.00	23,549,400	
SMC	61,100	55,730.00	3,405,103,000	貸付有価証券 100株
ホソカワミクロン	6,800	5,760.00	39,168,000	
ユニオンツール	7,200	2,621.00	18,871,200	貸付有価証券 900株
オイレス工業	24,900	1,408.00	35,059,200	
日精エー・エス・ビー機 械	5,600	3,175.00	17,780,000	
サトーホールディングス	27,400	2,245.00	61,513,000	
技研製作所	16,900	4,975.00	84,077,500	
日本エアーテック	6,900	1,185.00	8,176,500	貸付有価証券

				3,100株（2,100株）
カワタ	5,700	723.00	4,121,100	
日精樹脂工業	16,100	808.00	13,008,800	
オカダアイヨン	6,100	950.00	5,795,000	貸付有価証券 200株
ワイエイシイホールディングス	8,300	588.00	4,880,400	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
小松製作所	881,500	2,153.00	1,897,869,500	貸付有価証券 31,100株
住友重機械工業	111,400	2,311.00	257,445,400	
日立建機	78,000	2,939.00	229,242,000	貸付有価証券 500株
日工	26,600	646.00	17,183,600	
巴工業	8,300	1,900.00	15,770,000	
井関農機	19,400	1,121.00	21,747,400	
TOWA	19,700	1,162.00	22,891,400	
丸山製作所	4,000	1,136.00	4,544,000	
北川鉄工所	8,700	1,607.00	13,980,900	
ローツェ	8,500	5,430.00	46,155,000	
タカキタ	6,800	608.00	4,134,400	
クボタ	1,032,500	1,599.00	1,650,967,500	貸付有価証券 314,700株
荏原実業	4,900	2,884.00	14,131,600	
三菱化工機	6,700	1,782.00	11,939,400	貸付有価証券 100株
月島機械	35,800	1,170.00	41,886,000	
帝国電機製作所	16,000	1,256.00	20,096,000	
東京機械製作所	7,900	295.00	2,330,500	
新東工業	46,200	788.00	36,405,600	
澁谷工業	17,000	2,861.00	48,637,000	
アイチ コーポレーション	33,600	740.00	24,864,000	
小森コーポレーション	49,300	710.00	35,003,000	
鶴見製作所	15,000	1,839.00	27,585,000	
住友精密工業	2,900	2,242.00	6,501,800	
日本ギア工業	7,800	293.00	2,285,400	
酒井重工業	3,600	2,125.00	7,650,000	
荏原製作所	80,600	2,484.00	200,210,400	貸付有価証券

				100株
石井鐵工所	2,500	2,518.00	6,295,000	
西島製作所	19,600	807.00	15,817,200	
北越工業	20,000	1,053.00	21,060,000	
ダイキン工業	248,000	16,925.00	4,197,400,000	貸付有価証券 5,100株
オルガノ	7,000	5,730.00	40,110,000	
トーヨーカネツ	8,500	2,057.00	17,484,500	
栗田工業	105,300	2,985.00	314,320,500	貸付有価証券 500株
椿本チエイン	27,800	2,563.00	71,251,400	貸付有価証券 300株
大同工業	9,200	674.00	6,200,800	
木村化工機	16,200	426.00	6,901,200	貸付有価証券 500株
アネスト岩田	30,300	837.00	25,361,100	
ダイフク	99,500	9,360.00	931,320,000	貸付有価証券 300株
サムコ	4,900	2,071.00	10,147,900	貸付有価証券 800株（800株）
加藤製作所	10,600	1,232.00	13,059,200	
油研工業	3,300	1,481.00	4,887,300	
タダノ	93,900	892.00	83,758,800	貸付有価証券 4,000株
フジテック	70,700	1,973.00	139,491,100	貸付有価証券 11,500株（11,500株）
CKD	53,300	1,852.00	98,711,600	
キトー	14,700	1,322.00	19,433,400	
平和	54,300	1,803.00	97,902,900	
理想科学工業	17,200	1,417.00	24,372,400	
SANKYO	43,300	2,663.00	115,307,900	貸付有価証券 300株
日本金銭機械	21,500	594.00	12,771,000	
マースグループホールディングス	12,400	1,650.00	20,460,000	
フクシマガリレイ	12,000	3,515.00	42,180,000	
オーイズミ	8,200	390.00	3,198,000	
ダイコク電機	8,900	1,301.00	11,578,900	
竹内製作所	32,600	1,773.00	57,799,800	

アマノ	51,000	2,253.00	114,903,000	貸付有価証券 400株
J U K I	27,100	543.00	14,715,300	
サンデンホールディング ス	25,400	341.00	8,661,400	貸付有価証券 10,000株（4,000株）
蛇の目ミシン工業	17,700	450.00	7,965,000	
マックス	29,700	1,512.00	44,906,400	
グローリー	50,000	2,390.00	119,500,000	
新晃工業	18,100	1,436.00	25,991,600	
大和冷機工業	28,100	890.00	25,009,000	
セガサミーホールディン グス	193,000	1,287.00	248,391,000	貸付有価証券 1,900株
日本ピストンリング	7,100	1,256.00	8,917,600	
リケン	9,000	2,929.00	26,361,000	
T P R	26,200	1,295.00	33,929,000	
ツバキ・ナカシマ	39,700	838.00	33,268,600	
ホシザキ	56,900	9,100.00	517,790,000	貸付有価証券 10,900株
大豊工業	15,900	530.00	8,427,000	
日本精工	366,400	777.00	284,692,800	貸付有価証券 2,700株
NTN	450,400	211.00	95,034,400	貸付有価証券 38,400株（2,700株）
ジェイテクト	186,700	805.00	150,293,500	貸付有価証券 1,100株
不二越	18,100	3,370.00	60,997,000	
日本トムソン	57,700	334.00	19,271,800	
THK	113,200	2,607.00	295,112,400	
ユーシン精機	15,100	709.00	10,705,900	
前澤給装工業	7,100	2,038.00	14,469,800	
イーグル工業	24,100	705.00	16,990,500	
前澤工業	12,900	368.00	4,747,200	
日本ピラー工業	19,700	1,400.00	27,580,000	貸付有価証券 500株
キッツ	78,900	690.00	54,441,000	貸付有価証券 100株
マキタ	253,800	3,905.00	991,089,000	貸付有価証券 2,200株
日立造船	154,300	387.00	59,714,100	貸付有価証券

				100株
三菱重工業	326,200	2,470.00	805,714,000	貸付有価証券 26,700株
I H I	140,200	1,480.00	207,496,000	
スター精密	30,000	1,199.00	35,970,000	
日清紡ホールディングス	129,700	776.00	100,647,200	貸付有価証券 100株
イビデン	119,200	3,100.00	369,520,000	貸付有価証券 3,100株
コニカミノルタ	425,200	363.00	154,347,600	貸付有価証券 10,600株
ブラザー工業	237,700	1,894.00	450,203,800	貸付有価証券 1,400株
ミネベアミツミ	361,300	1,922.00	694,418,600	
日立製作所	935,100	3,395.00	3,174,664,500	貸付有価証券 3,500株
三菱電機	1,946,100	1,368.00	2,662,264,800	貸付有価証券 1,100株
富士電機	117,300	2,906.00	340,873,800	貸付有価証券 200株
東洋電機製造	7,100	1,197.00	8,498,700	
安川電機	209,500	3,675.00	769,912,500	貸付有価証券 8,500株
シンフォニアテクノロジー	25,200	1,053.00	26,535,600	
明電舎	35,800	1,723.00	61,683,400	
オリジン	5,300	1,496.00	7,928,800	
山洋電気	9,400	4,820.00	45,308,000	
デンヨー	16,600	1,913.00	31,755,800	
東芝テック	24,400	4,100.00	100,040,000	貸付有価証券 4,400株
芝浦メカトロニクス	3,500	2,847.00	9,964,500	
マブチモーター	53,900	3,380.00	182,182,000	
日本電産	468,400	7,125.00	3,337,350,000	貸付有価証券 8,500株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,700	443.00	5,183,100	貸付有価証券 1,400株（500株）
トレックス・セミコンダクター	11,200	1,343.00	15,041,600	
東光高岳	10,800	1,031.00	11,134,800	

ダブル・スコープ	30,800	771.00	23,746,800	貸付有価証券 14,500株（8,800株）
ダイヘン	21,300	3,775.00	80,407,500	
ヤーマン	31,700	1,060.00	33,602,000	貸付有価証券 14,600株（400株）
JVCケンウッド	158,600	160.00	25,376,000	
ミマキエンジニアリング	17,400	379.00	6,594,600	
第一精工	7,900	2,153.00	17,008,700	貸付有価証券 3,200株
日新電機	45,600	1,025.00	46,740,000	
大崎電気工業	38,700	509.00	19,698,300	
オムロン	174,500	7,090.00	1,237,205,000	貸付有価証券 1,100株
日東工業	28,600	1,905.00	54,483,000	
I D E C	28,100	1,709.00	48,022,900	
正興電機製作所	4,600	1,065.00	4,899,000	
不二電機工業	3,200	1,347.00	4,310,400	貸付有価証券 1,500株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	65,000	1,836.00	119,340,000	貸付有価証券 1,500株
サクサホールディングス	4,500	1,720.00	7,740,000	
メルコホールディングス	6,700	3,100.00	20,770,000	
テクノメディカ	4,400	1,790.00	7,876,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	4,200	599.00	2,515,800	
日本電気	236,100	5,240.00	1,237,164,000	貸付有価証券 100株
富士通	187,600	12,770.00	2,395,652,000	貸付有価証券 100株
沖電気工業	79,100	1,023.00	80,919,300	貸付有価証券 14,100株
岩崎通信機	8,500	852.00	7,242,000	
電気興業	9,400	2,563.00	24,092,200	
サンケン電気	21,200	2,149.00	45,558,800	貸付有価証券 100株
ナカヨ	3,800	1,510.00	5,738,000	
アイホン	11,000	1,602.00	17,622,000	
ルネサスエレクトロニクス	932,500	548.00	511,010,000	貸付有価証券 2,000株
セイコーエプソン	241,500	1,164.00	281,106,000	貸付有価証券

				4,800株
ワコム	130,800	552.00	72,201,600	貸付有価証券 100株
アルバック	35,800	3,085.00	110,443,000	貸付有価証券 100株
アクセル	8,100	737.00	5,969,700	
E I Z O	15,100	3,960.00	59,796,000	
日本信号	49,600	1,108.00	54,956,800	
京三製作所	45,600	538.00	24,532,800	貸付有価証券 20,700株
能美防災	25,700	2,055.00	52,813,500	
ホーチキ	14,100	1,274.00	17,963,400	
星和電機	9,600	621.00	5,961,600	
エレコム	21,700	5,270.00	114,359,000	
パナソニック	2,223,600	909.90	2,023,253,640	
シャープ	225,200	1,114.00	250,872,800	貸付有価証券 97,700株
アンリツ	125,300	2,597.00	325,404,100	貸付有価証券 58,500株
富士通ゼネラル	52,800	2,144.00	113,203,200	貸付有価証券 1,300株
ソニー	1,219,200	7,313.00	8,916,009,600	貸付有価証券 3,700株
T D K	94,000	10,500.00	987,000,000	貸付有価証券 100株
帝国通信工業	8,600	1,198.00	10,302,800	
タムラ製作所	65,000	444.00	28,860,000	
アルプスアルパイン	172,200	1,344.00	231,436,800	貸付有価証券 1,000株
池上通信機	6,200	896.00	5,555,200	
日本電波工業	17,600	342.00	6,019,200	貸付有価証券 5,800株（1,200株）
鈴木	9,600	734.00	7,046,400	
日本トリム	2,600	3,050.00	7,930,000	
ローランド ディー・ ジー・	10,700	1,225.00	13,107,500	
フォスター電機	20,400	1,070.00	21,828,000	貸付有価証券 100株
SMK	5,000	2,620.00	13,100,000	
ヨコオ	12,600	2,496.00	31,449,600	

ティアック	14,000	137.00	1,918,000	貸付有価証券 6,600株
ホシデン	53,200	931.00	49,529,200	貸付有価証券 400株
ヒロセ電機	30,100	11,720.00	352,772,000	
日本航空電子工業	44,600	1,398.00	62,350,800	
TOA	20,900	733.00	15,319,700	
マクセルホールディングス	41,900	976.00	40,894,400	貸付有価証券 700株
古野電気	25,100	946.00	23,744,600	
ユニデンホールディングス	5,300	1,834.00	9,720,200	貸付有価証券 400株
スミダコーポレーション	14,900	768.00	11,443,200	
アイコム	10,800	3,050.00	32,940,000	
リオン	8,200	2,183.00	17,900,600	
本多通信工業	16,600	442.00	7,337,200	
船井電機	19,600	507.00	9,937,200	貸付有価証券 5,100株
横河電機	178,500	1,601.00	285,778,500	貸付有価証券 1,300株
新電元工業	6,900	2,124.00	14,655,600	
アズビル	122,800	3,345.00	410,766,000	貸付有価証券 1,000株
東亜ディーケーケー	9,600	852.00	8,179,200	
日本光電工業	80,400	3,675.00	295,470,000	貸付有価証券 100株
チノー	6,700	1,390.00	9,313,000	貸付有価証券 2,100株
共和電業	20,300	426.00	8,647,800	
日本電子材料	7,700	1,036.00	7,977,200	
堀場製作所	38,500	5,590.00	215,215,000	
アドバンテスト	144,700	6,060.00	876,882,000	貸付有価証券 1,300株
小野測器	8,100	525.00	4,252,500	
エスベック	17,200	1,749.00	30,082,800	
キーエンス	176,300	44,710.00	7,882,373,000	貸付有価証券 200株
日置電機	10,200	3,030.00	30,906,000	
シスメックス	139,100	8,166.00	1,135,890,600	貸付有価証券

				100株
日本マイクロニクス	33,900	1,176.00	39,866,400	貸付有価証券 1,900株
メガチップス	18,100	2,106.00	38,118,600	貸付有価証券 300株
OBARA GROUP	11,300	3,300.00	37,290,000	貸付有価証券 4,500株（3,800株）
澤藤電機	2,400	1,617.00	3,880,800	
原田工業	9,200	853.00	7,847,600	
コーセル	25,900	965.00	24,993,500	
イリソ電子工業	16,300	3,525.00	57,457,500	
オブテックスグループ	31,900	1,225.00	39,077,500	
千代田インテグレ	9,000	1,705.00	15,345,000	
アイ・オー・データ機器	6,300	1,056.00	6,652,800	
レーザーテック	85,500	10,740.00	918,270,000	
スタンレー電気	136,400	2,534.00	345,637,600	貸付有価証券 200株
岩崎電気	7,600	1,911.00	14,523,600	
ウシオ電機	107,400	1,427.00	153,259,800	貸付有価証券 300株
岡谷電機産業	15,200	327.00	4,970,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	17,900	334.00	5,978,600	貸付有価証券 200株
エノモト	5,800	1,037.00	6,014,600	
日本セラミック	19,700	2,261.00	44,541,700	
遠藤照明	9,800	624.00	6,115,200	
古河電池	13,900	1,269.00	17,639,100	貸付有価証券 4,300株（1,400株）
双信電機	9,400	415.00	3,901,000	
山一電機	14,100	1,389.00	19,584,900	
図研	12,700	2,892.00	36,728,400	
日本電子	38,400	2,985.00	114,624,000	貸付有価証券 2,900株
カシオ計算機	172,200	1,783.00	307,032,600	貸付有価証券 1,800株
ファナック	183,000	18,965.00	3,470,595,000	貸付有価証券 200株
日本シイエムケイ	45,700	408.00	18,645,600	貸付有価証券 100株
エンプラス	9,900	2,360.00	23,364,000	

大真空	7,100	1,990.00	14,129,000	貸付有価証券 900株
ローム	86,400	7,010.00	605,664,000	
浜松ホトニクス	139,600	4,715.00	658,214,000	貸付有価証券 1,800株
三井ハイテック	21,500	1,590.00	34,185,000	貸付有価証券 3,300株
新光電気工業	65,300	1,446.00	94,423,800	貸付有価証券 500株
京セラ	273,800	5,809.00	1,590,504,200	貸付有価証券 1,900株
太陽誘電	86,600	3,355.00	290,543,000	貸付有価証券 14,000株
村田製作所	571,700	6,316.00	3,610,857,200	貸付有価証券 700株
双葉電子工業	30,800	990.00	30,492,000	
北陸電気工業	7,800	877.00	6,840,600	
ニチコン	66,000	732.00	48,312,000	貸付有価証券 2,400株
日本ケミコン	14,800	1,768.00	26,166,400	
KOA	29,400	994.00	29,223,600	
市光工業	29,100	470.00	13,677,000	
小糸製作所	116,600	4,255.00	496,133,000	貸付有価証券 1,500株
ミツバ	35,800	448.00	16,038,400	
SCREENホールディングス	33,800	4,830.00	163,254,000	貸付有価証券 2,800株
キャノン電子	20,400	1,610.00	32,844,000	
キャノン	1,047,700	2,119.50	2,220,600,150	貸付有価証券 91,100株
リコー	495,100	749.00	370,829,900	貸付有価証券 2,900株
象印マホービン	57,000	1,411.00	80,427,000	貸付有価証券 8,600株
MUTOHホールディングス	2,400	1,553.00	3,727,200	
東京エレクトロン	123,500	26,075.00	3,220,262,500	貸付有価証券 500株
トヨタ紡織	56,700	1,455.00	82,498,500	
芦森工業	4,000	1,015.00	4,060,000	

ユニプレス	37,700	940.00	35,438,000	
豊田自動織機	157,500	5,650.00	889,875,000	貸付有価証券 600株
モリタホールディングス	34,000	1,853.00	63,002,000	
三櫻工業	24,700	680.00	16,796,000	貸付有価証券 2,800株
デンソー	428,500	4,151.00	1,778,703,500	貸付有価証券 2,300株
東海理化電機製作所	51,200	1,535.00	78,592,000	貸付有価証券 2,000株
三井E&Sホールディングス	70,300	400.00	28,120,000	貸付有価証券 2,900株
川崎重工業	151,400	1,487.00	225,131,800	貸付有価証券 12,400株
名村造船所	62,600	155.00	9,703,000	貸付有価証券 6,100株
サノヤスホールディングス	23,700	165.00	3,910,500	貸付有価証券 1,000株
日本車輛製造	7,100	2,557.00	18,154,700	貸付有価証券 400株
三菱ロジスネクスト	25,800	930.00	23,994,000	
近畿車輛	2,900	1,224.00	3,549,600	
日産自動車	2,295,300	394.70	905,954,910	貸付有価証券 267,500株
いすゞ自動車	563,900	944.80	532,772,720	貸付有価証券 10,400株
トヨタ自動車	2,171,600	6,759.00	14,677,844,400	貸付有価証券 29,000株
日野自動車	243,000	693.00	168,399,000	貸付有価証券 200株
三菱自動車工業	720,400	263.00	189,465,200	貸付有価証券 33,400株
エフテック	13,600	498.00	6,772,800	貸付有価証券 2,600株
レシップホールディングス	7,600	555.00	4,218,000	
GMB	3,500	681.00	2,383,500	
ファルテック	3,400	692.00	2,352,800	
武蔵精密工業	43,300	950.00	41,135,000	
日産車体	38,000	933.00	35,454,000	貸付有価証券 100株

新明和工業	52,400	1,013.00	53,081,200	貸付有価証券 600株
極東開発工業	36,200	1,343.00	48,616,600	
日信工業	39,500	2,192.00	86,584,000	
トピー工業	16,000	1,211.00	19,376,000	
ティラド	7,100	1,327.00	9,421,700	
タチエス	31,900	863.00	27,529,700	貸付有価証券 14,300株
NOK	104,600	1,294.00	135,352,400	貸付有価証券 400株
フタバ産業	54,100	438.00	23,695,800	
KYB	21,800	1,985.00	43,273,000	
大同メタル工業	37,300	551.00	20,552,300	
プレス工業	96,400	286.00	27,570,400	貸付有価証券 800株
ミクニ	24,700	274.00	6,767,800	
太平洋工業	40,800	945.00	38,556,000	
ケーヒン	44,700	2,528.00	113,001,600	
河西工業	26,300	452.00	11,887,600	貸付有価証券 200株
アイシン精機	160,200	3,070.00	491,814,000	貸付有価証券 100株
マツダ	572,600	623.00	356,729,800	貸付有価証券 6,800株
今仙電機製作所	18,100	730.00	13,213,000	貸付有価証券 100株
本田技研工業	1,532,300	2,708.50	4,150,234,550	
スズキ	385,700	3,583.00	1,381,963,100	貸付有価証券 34,300株
SUBARU	604,200	2,210.00	1,335,282,000	貸付有価証券 1,000株
安永	9,400	1,058.00	9,945,200	貸付有価証券 1,000株（900株）
ヤマハ発動機	253,800	1,639.00	415,978,200	貸付有価証券 100株
ショーワ	45,900	2,226.00	102,173,400	
TBK	23,100	452.00	10,441,200	
エクセディ	26,400	1,574.00	41,553,600	貸付有価証券 400株
豊田合成	62,800	2,231.00	140,106,800	

愛三工業	30,500	530.00	16,165,000	貸付有価証券 800株
盟和産業	3,000	934.00	2,802,000	
日本プラスト	15,200	463.00	7,037,600	
ヨロズ	18,200	1,047.00	19,055,400	
エフ・シー・シー	31,800	1,809.00	57,526,200	
シマノ	72,800	20,610.00	1,500,408,000	
テイ・エス テック	45,200	2,923.00	132,119,600	貸付有価証券 300株
ジャムコ	9,700	736.00	7,139,200	貸付有価証券 700株
テルモ	550,700	4,054.00	2,232,537,800	貸付有価証券 4,300株
クリエートメディック	6,400	993.00	6,355,200	
日機装	58,400	1,017.00	59,392,800	貸付有価証券 200株
日本エム・ディ・エム	11,200	1,609.00	18,020,800	
島津製作所	232,600	2,847.00	662,212,200	貸付有価証券 7,600株
JMS	16,400	809.00	13,267,600	
クボテック	5,000	354.00	1,770,000	貸付有価証券 2,300株
長野計器	14,100	984.00	13,874,400	
ブイ・テクノロジー	9,100	3,680.00	33,488,000	貸付有価証券 2,200株
東京計器	12,400	973.00	12,065,200	
愛知時計電機	2,600	4,545.00	11,817,000	
インターアクション	10,400	1,935.00	20,124,000	貸付有価証券 100株
オーバル	17,400	231.00	4,019,400	
東京精密	35,300	3,420.00	120,726,000	
マニー	77,500	2,900.00	224,750,000	貸付有価証券 6,600株（300株）
ニコン	297,200	878.00	260,941,600	貸付有価証券 2,700株
トプコン	98,000	839.00	82,222,000	貸付有価証券 1,800株
オリンパス	1,076,900	2,070.00	2,229,183,000	貸付有価証券 35,000株
理研計器	17,200	2,419.00	41,606,800	

タムロン	15,700	1,767.00	27,741,900	
HOYA	386,100	10,405.00	4,017,370,500	貸付有価証券 200株
シード	8,300	734.00	6,092,200	
ノーリツ銅機	13,100	1,485.00	19,453,500	
エー・アンド・デイ	17,700	687.00	12,159,900	
朝日インテック	220,400	3,105.00	684,342,000	貸付有価証券 100株
シチズン時計	227,900	343.00	78,169,700	貸付有価証券 700株
リズム時計工業	6,100	613.00	3,739,300	
大研医器	13,500	587.00	7,924,500	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
メニコン	27,600	5,340.00	147,384,000	貸付有価証券 400株
シンシア	2,100	424.00	890,400	貸付有価証券 900株
松風	8,800	1,549.00	13,631,200	
セイコーホールディングス	27,500	1,696.00	46,640,000	
ニプロ	134,700	1,187.00	159,888,900	貸付有価証券 800株
中本パックス	4,900	1,542.00	7,555,800	
スノーピーク	10,400	1,097.00	11,408,800	貸付有価証券 600株
パラマウントベッドホールディングス	20,500	4,470.00	91,635,000	
トランザクション	10,600	1,057.00	11,204,200	
粧美堂	5,700	341.00	1,943,700	
ニホンフラッシュ	18,200	1,396.00	25,407,200	貸付有価証券 600株
前田工織	21,400	2,478.00	53,029,200	貸付有価証券 700株
永大産業	25,400	316.00	8,026,400	
アートネイチャー	20,800	602.00	12,521,600	
バンダイナムコホールディングス	201,200	5,636.00	1,133,963,200	貸付有価証券 1,400株
アイフィスジャパン	5,000	723.00	3,615,000	
共立印刷	32,500	137.00	4,452,500	
SHOEI	17,000	2,655.00	45,135,000	

フランスベッドホールディングス	27,500	855.00	23,512,500	
パイロットコーポレーション	31,800	3,210.00	102,078,000	
萩原工業	10,800	1,432.00	15,465,600	
トッパン・フォームズ	41,700	1,061.00	44,243,700	
フジシールインターナショナル	43,600	2,076.00	90,513,600	貸付有価証券 100株
タカラトミー	87,300	837.00	73,070,100	貸付有価証券 700株
廣済堂	13,600	753.00	10,240,800	貸付有価証券 800株
エステールホールディングス	5,200	623.00	3,239,600	
アーク	74,300	112.00	8,321,600	貸付有価証券 1,200株
タカノ	7,600	714.00	5,426,400	
プロネクサス	16,700	1,282.00	21,409,400	
ホクシン	12,000	120.00	1,440,000	
ウッドワン	6,500	1,198.00	7,787,000	
大建工業	13,100	1,836.00	24,051,600	
凸版印刷	274,700	1,782.00	489,515,400	
大日本印刷	254,700	2,411.00	614,081,700	貸付有価証券 100株
共同印刷	6,000	2,920.00	17,520,000	
N I S S H A	39,900	996.00	39,740,400	貸付有価証券 2,400株（2,400株）
光村印刷	1,700	1,514.00	2,573,800	
TAKARA & COMPANY	9,400	1,821.00	17,117,400	
アシックス	160,600	1,183.00	189,989,800	貸付有価証券 2,800株
ツツミ	6,100	1,891.00	11,535,100	
小松ウオール工業	5,900	1,829.00	10,791,100	貸付有価証券 100株
ヤマハ	115,700	4,975.00	575,607,500	貸付有価証券 2,100株
河合楽器製作所	6,000	2,689.00	16,134,000	
クリナップ	18,100	554.00	10,027,400	
ピジョン	117,600	4,145.00	487,452,000	

オリバー	4,100	2,458.00	10,077,800	貸付有価証券 400株
兼松サステック	1,300	1,514.00	1,968,200	
キングジム	16,200	886.00	14,353,200	
リンテック	46,300	2,490.00	115,287,000	
イトーキ	41,400	350.00	14,490,000	
任天堂	119,300	48,040.00	5,731,172,000	貸付有価証券 100株
三菱鉛筆	32,000	1,370.00	43,840,000	
タカスタンダード	40,200	1,513.00	60,822,600	
コクヨ	93,300	1,302.00	121,476,600	
ナカバヤシ	19,100	581.00	11,097,100	
グローブライド	8,700	2,044.00	17,782,800	
オカムラ	67,900	736.00	49,974,400	貸付有価証券 300株
美津濃	17,700	2,106.00	37,276,200	貸付有価証券 100株
東京電力ホールディングス	1,553,600	330.00	512,688,000	貸付有価証券 689,000株
中部電力	595,400	1,368.50	814,804,900	貸付有価証券 38,600株
関西電力	737,400	1,039.00	766,158,600	貸付有価証券 20,200株
中国電力	280,700	1,442.00	404,769,400	貸付有価証券 1,400株
北陸電力	177,900	684.00	121,683,600	貸付有価証券 300株
東北電力	486,200	1,020.00	495,924,000	貸付有価証券 1,200株
四国電力	175,200	785.00	137,532,000	貸付有価証券 200株
九州電力	401,100	889.00	356,577,900	
北海道電力	182,100	404.00	73,568,400	貸付有価証券 2,800株
沖縄電力	37,800	1,770.00	66,906,000	
電源開発	154,800	2,006.00	310,528,800	貸付有価証券 100株
エフオン	10,500	601.00	6,310,500	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
イーレックス	27,700	1,404.00	38,890,800	貸付有価証券

				100株
レノバ	32,500	918.00	29,835,000	貸付有価証券 800株
東京瓦斯	374,300	2,526.50	945,668,950	貸付有価証券 1,300株
大阪瓦斯	377,700	2,111.00	797,324,700	貸付有価証券 1,200株
東邦瓦斯	95,700	5,480.00	524,436,000	貸付有価証券 12,300株
北海道瓦斯	10,400	1,625.00	16,900,000	貸付有価証券 100株
広島ガス	40,100	363.00	14,556,300	
西部瓦斯	21,900	2,731.00	59,808,900	
静岡ガス	55,200	971.00	53,599,200	
メタウォーター	9,400	4,905.00	46,107,000	
S B Sホールディングス	16,800	2,216.00	37,228,800	
東武鉄道	202,800	3,605.00	731,094,000	貸付有価証券 1,600株
相鉄ホールディングス	62,300	2,880.00	179,424,000	貸付有価証券 400株
東急	490,800	1,512.00	742,089,600	貸付有価証券 2,200株
京浜急行電鉄	249,900	1,670.00	417,333,000	貸付有価証券 9,700株
小田急電鉄	289,500	2,659.00	769,780,500	貸付有価証券 12,700株
京王電鉄	101,000	6,220.00	628,220,000	貸付有価証券 7,200株
京成電鉄	135,400	3,330.00	450,882,000	貸付有価証券 100株
富士急行	26,500	3,250.00	86,125,000	貸付有価証券 800株
新京成電鉄	5,000	2,272.00	11,360,000	
東日本旅客鉄道	342,500	7,501.00	2,569,092,500	貸付有価証券 2,000株
西日本旅客鉄道	173,400	6,040.00	1,047,336,000	貸付有価証券 14,000株
東海旅客鉄道	161,800	16,700.00	2,702,060,000	貸付有価証券 15,800株
西武ホールディングス	254,100	1,180.00	299,838,000	
鴻池運輸	31,000	1,179.00	36,549,000	

西日本鉄道	53,900	2,942.00	158,573,800	貸付有価証券 300株
ハマキョウレックス	14,900	3,150.00	46,935,000	
サカイ引越センター	10,200	5,630.00	57,426,000	
近鉄グループホールディングス	184,300	4,890.00	901,227,000	貸付有価証券 4,300株
阪急阪神ホールディングス	245,800	3,615.00	888,567,000	貸付有価証券 300株
南海電気鉄道	87,400	2,495.00	218,063,000	
京阪ホールディングス	82,100	4,825.00	396,132,500	貸付有価証券 800株
神戸電鉄	4,400	3,750.00	16,500,000	貸付有価証券 2,100株
名古屋鉄道	151,500	3,055.00	462,832,500	貸付有価証券 20,500株
山陽電気鉄道	13,200	2,230.00	29,436,000	
日本通運	63,800	5,530.00	352,814,000	貸付有価証券 400株
ヤマトホールディングス	323,100	2,342.00	756,700,200	貸付有価証券 12,800株
山九	51,200	4,060.00	207,872,000	
丸運	10,500	224.00	2,352,000	
丸全昭和運輸	14,900	3,305.00	49,244,500	
センコーグループホールディングス	101,600	801.00	81,381,600	貸付有価証券 1,500株
トナミホールディングス	4,400	5,680.00	24,992,000	
ニッコンホールディングス	66,000	2,146.00	141,636,000	
日本石油輸送	2,000	3,150.00	6,300,000	
福山通運	23,600	3,845.00	90,742,000	貸付有価証券 500株
セイノーホールディングス	138,000	1,410.00	194,580,000	貸付有価証券 200株
エスライン	5,500	1,000.00	5,500,000	
神奈川中央交通	4,600	4,130.00	18,998,000	
日立物流	33,800	2,853.00	96,431,400	
丸和運輸機関	19,400	3,015.00	58,491,000	貸付有価証券 100株
C & F ロジホールディングス	18,600	1,628.00	30,280,800	

九州旅客鉄道	161,600	2,813.00	454,580,800	
S Gホールディングス	193,500	3,500.00	677,250,000	貸付有価証券 2,800株
日本郵船	154,100	1,493.00	230,071,300	
商船三井	116,600	1,867.00	217,692,200	
川崎汽船	56,800	1,010.00	57,368,000	貸付有価証券 19,500株（5,100株）
N Sユニテッド海運	10,100	1,496.00	15,109,600	貸付有価証券 100株
明治海運	19,600	319.00	6,252,400	
飯野海運	87,300	340.00	29,682,000	
共栄タンカー	3,200	812.00	2,598,400	
乾汽船	10,600	853.00	9,041,800	貸付有価証券 1,400株
日本航空	325,900	1,899.00	618,884,100	貸付有価証券 2,700株
A N Aホールディングス	336,900	2,403.50	809,739,150	貸付有価証券 161,100株（60,000 株）
パスコ	3,600	1,477.00	5,317,200	
トランコム	5,100	7,200.00	36,720,000	
日新	15,900	1,665.00	26,473,500	貸付有価証券 100株
三菱倉庫	58,500	2,748.00	160,758,000	貸付有価証券 6,800株（5,400株）
三井倉庫ホールディング ス	21,000	1,509.00	31,689,000	
住友倉庫	66,300	1,286.00	85,261,800	貸付有価証券 400株
澁澤倉庫	10,100	2,090.00	21,109,000	
東陽倉庫	33,300	334.00	11,122,200	貸付有価証券 100株
日本トランスシティ	40,600	514.00	20,868,400	貸付有価証券 100株
ケイヒン	3,600	1,315.00	4,734,000	
中央倉庫	11,200	1,004.00	11,244,800	
川西倉庫	3,400	1,033.00	3,512,200	
安田倉庫	15,100	926.00	13,982,600	
ファイズホールディング ス	3,900	1,076.00	4,196,400	貸付有価証券 100株

東洋埠頭	5,600	1,383.00	7,744,800	
宇徳	15,800	543.00	8,579,400	
上組	102,900	2,109.00	217,016,100	貸付有価証券 800株
サンリツ	4,400	594.00	2,613,600	
キムラユニティー	4,900	1,033.00	5,061,700	
キューソー流通システム	4,600	1,617.00	7,438,200	
近鉄エクスプレス	39,200	1,855.00	72,716,000	貸付有価証券 1,500株
東海運	10,500	280.00	2,940,000	
エーアイテイー	13,000	796.00	10,348,000	
内外トランスライン	6,500	970.00	6,305,000	
日本コンセプト	5,900	1,268.00	7,481,200	
NEC ネットエスアイ	54,100	2,195.00	118,749,500	貸付有価証券 600株
クロスキャット	5,000	1,223.00	6,115,000	
システナ	68,100	1,396.00	95,067,600	貸付有価証券 2,000株
デジタルアーツ	9,400	8,920.00	83,848,000	貸付有価証券 2,700株
日鉄ソリューションズ	28,600	2,914.00	83,340,400	
キューブシステム	10,200	1,042.00	10,628,400	
エイジア	3,500	1,428.00	4,998,000	
コア	8,100	1,191.00	9,647,100	
ラクーンホールディングス	8,600	941.00	8,092,600	
ソリトンシステムズ	8,300	1,465.00	12,159,500	貸付有価証券 3,800株
ソフトクリエイトホールディングス	8,300	2,321.00	19,264,300	
T I S	191,000	2,250.00	429,750,000	貸付有価証券 1,400株
ネオス	7,600	650.00	4,940,000	貸付有価証券 1,400株
電算システム	7,300	3,730.00	27,229,000	
グリー	117,100	469.00	54,919,900	
コーエーテクモホールディングス	39,100	3,500.00	136,850,000	貸付有価証券 400株
三菱総合研究所	8,200	4,235.00	34,727,000	

ボルテージ	4,400	455.00	2,002,000	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
電算	2,100	2,233.00	4,689,300	
A G S	10,800	866.00	9,352,800	
ファインデックス	16,100	1,020.00	16,422,000	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
ブレインパッド	4,900	4,420.00	21,658,000	貸付有価証券 1,200株（900株）
K L a b	37,000	724.00	26,788,000	貸付有価証券 3,000株（2,800株）
ポルトゥウィン・ピット クルーホールディ	23,000	911.00	20,953,000	貸付有価証券 300株
イーブックイニシアティ ブジャパン	2,800	3,155.00	8,834,000	貸付有価証券 100株
ネクソン	533,300	2,488.00	1,326,850,400	貸付有価証券 5,300株
アイスタイル	53,400	256.00	13,670,400	貸付有価証券 22,000株（11,400株）
エムアップホールディン グス	5,500	2,395.00	13,172,500	貸付有価証券 1,800株（1,600株）
エイチーム	13,100	852.00	11,161,200	
エニグモ	18,000	1,259.00	22,662,000	貸付有価証券 5,800株（5,800株）
テクノスジャパン	14,800	782.00	11,573,600	
e n i s h	10,400	651.00	6,770,400	貸付有価証券 4,000株（2,200株）
コロプラ	62,600	980.00	61,348,000	貸付有価証券 22,400株
オルトプラス	11,600	424.00	4,918,400	貸付有価証券 5,400株（1,500株）
ブロードリーフ	94,600	525.00	49,665,000	貸付有価証券 45,600株
クロス・マーケティング グループ	8,400	404.00	3,393,600	
デジタルハーツホール ディングス	10,100	892.00	9,009,200	貸付有価証券 100株
システム情報	14,300	1,675.00	23,952,500	
メディアドゥ	6,000	4,370.00	26,220,000	貸付有価証券 1,700株
じげん	47,200	337.00	15,906,400	貸付有価証券 2,300株

ブイキューブ	11,800	1,326.00	15,646,800	貸付有価証券 5,400株（1,700株）
エンカレッジ・テクノロジー	4,200	850.00	3,570,000	
サイバーリンクス	2,900	2,066.00	5,991,400	
ディー・エル・イー	15,300	518.00	7,925,400	貸付有価証券 7,200株（4,900株）
フィックスターズ	20,300	1,262.00	25,618,600	
CARTA HOLDINGS	9,200	1,367.00	12,576,400	貸付有価証券 4,300株（3,700株）
オブティム	10,000	3,595.00	35,950,000	貸付有価証券 3,300株（3,300株）
セレス	6,300	1,120.00	7,056,000	貸付有価証券 100株
SHIFT	7,700	11,130.00	85,701,000	
ティーガイア	16,900	2,051.00	34,661,900	
セック	2,800	3,020.00	8,456,000	
日本アジアグループ	20,100	300.00	6,030,000	
テクマトリックス	26,900	1,903.00	51,190,700	貸付有価証券 3,600株（3,200株）
プロシップ	5,500	1,326.00	7,293,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	46,000	1,884.00	86,664,000	貸付有価証券 12,000株
GMOペイメントゲートウェイ	40,400	12,030.00	486,012,000	
ザッパラス	8,200	395.00	3,239,000	
システムリサーチ	5,100	2,052.00	10,465,200	
インターネットイニシアティブ	28,200	3,690.00	104,058,000	
さくらインターネット	20,500	646.00	13,243,000	貸付有価証券 300株
ヴィンクス	5,400	1,293.00	6,982,200	
GMOクラウド	3,500	11,120.00	38,920,000	貸付有価証券 1,600株（1,100株）
SRAホールディングス	10,100	2,415.00	24,391,500	
システムインテグレータ	6,000	993.00	5,958,000	
朝日ネット	13,500	1,286.00	17,361,000	貸付有価証券 300株
eBASE	22,800	1,342.00	30,597,600	
アバント	18,200	1,053.00	19,164,600	

アドソル日進	6,700	2,366.00	15,852,200	
フリービット	9,900	707.00	6,999,300	貸付有価証券 500株（400株）
コムチュア	21,400	2,739.00	58,614,600	
サイバーコム	3,400	1,866.00	6,344,400	
アステリア	11,600	492.00	5,707,200	貸付有価証券 3,300株（3,300株）
アイル	10,600	1,576.00	16,705,600	貸付有価証券 4,900株（2,200株）
マークラインズ	9,600	2,246.00	21,561,600	
メディカル・データ・ビ ジョン	14,500	1,276.00	18,502,000	貸付有価証券 900株
g u m i	24,500	969.00	23,740,500	貸付有価証券 1,600株
ショーケース	4,500	694.00	3,123,000	
モバイルファクトリー	4,300	1,074.00	4,618,200	貸付有価証券 1,100株
テラスカイ	6,900	2,799.00	19,313,100	貸付有価証券 500株
デジタル・インフォメー ション・テクノロジ	7,500	1,432.00	10,740,000	
P C I ホールディングス	7,200	1,169.00	8,416,800	
パイプドHD	2,500	1,506.00	3,765,000	貸付有価証券 1,100株（700株）
アイビーシー	3,100	979.00	3,034,900	
ネオジャパン	3,600	2,439.00	8,780,400	貸付有価証券 1,600株
P R T I M E S	1,600	2,756.00	4,409,600	
ランドコンピュータ	2,900	1,080.00	3,132,000	
ダブルスタンダード	2,500	5,120.00	12,800,000	貸付有価証券 100株
オーブンドア	9,400	1,252.00	11,768,800	貸付有価証券 4,400株（1,100株）
マイネット	6,100	1,085.00	6,618,500	貸付有価証券 400株（400株）
アカツキ	6,800	3,780.00	25,704,000	貸付有価証券 1,600株
ベネフィットジャパン	1,400	1,559.00	2,182,600	
U b i c o mホールディ ングス	4,200	2,293.00	9,630,600	
L I N E	43,800	5,420.00	237,396,000	貸付有価証券

				200株
カナミックネットワーク	17,400	962.00	16,738,800	
ノムラシステムコーポレーション	8,300	325.00	2,697,500	貸付有価証券 2,200株（1,800株）
チェンジ	6,700	7,700.00	51,590,000	貸付有価証券 400株
シンクロ・フード	8,100	324.00	2,624,400	貸付有価証券 700株
オークネット	11,700	1,056.00	12,355,200	貸付有価証券 100株
セグエグループ	4,200	877.00	3,683,400	貸付有価証券 900株（700株）
エイトレッド	3,200	2,060.00	6,592,000	
AOI TYO Holdings	19,300	445.00	8,588,500	貸付有価証券 9,000株（6,700株）
マクロミル	39,000	724.00	28,236,000	
ビーグリー	3,700	1,861.00	6,885,700	
オロ	5,000	2,642.00	13,210,000	貸付有価証券 300株
ユーザーローカル	1,900	3,540.00	6,726,000	
テモナ	4,100	953.00	3,907,300	
ニーズウェル	3,600	746.00	2,685,600	
サインポスト	4,000	1,730.00	6,920,000	貸付有価証券 500株（400株）
ソルクシーズ	8,100	763.00	6,180,300	
フェイス	6,700	655.00	4,388,500	
プロトコーポレーション	17,100	1,026.00	17,544,600	
ハイマックス	2,300	2,135.00	4,910,500	貸付有価証券 1,000株
野村総合研究所	270,700	2,963.00	802,084,100	貸付有価証券 3,000株
サイバネットシステム	13,600	677.00	9,207,200	貸付有価証券 500株
CEホールディングス	10,100	565.00	5,706,500	貸付有価証券 4,700株
日本システム技術	3,100	1,678.00	5,201,800	
インテージホールディングス	23,800	860.00	20,468,000	
東邦システムサイエンス	5,000	990.00	4,950,000	
ソースネクスト	90,600	270.00	24,462,000	貸付有価証券

				42,900株（17,000株）
インフォコム	20,900	3,000.00	62,700,000	貸付有価証券 200株
HEROZ	2,700	3,535.00	9,544,500	貸付有価証券 1,200株（1,100株）
ラクスル	15,300	3,005.00	45,976,500	貸付有価証券 7,200株（2,800株）
F I G	20,700	286.00	5,920,200	
システムサポート	4,300	2,144.00	9,219,200	
イーソル	9,100	1,218.00	11,083,800	貸付有価証券 800株
アルテリア・ネットワー クス	21,100	1,933.00	40,786,300	
東海ソフト	1,300	1,438.00	1,869,400	
ヒト・コミュニケーション ズ・ホールディン	3,200	1,044.00	3,340,800	
トビラシステムズ	2,300	1,811.00	4,165,300	貸付有価証券 1,000株
フォーカスシステムズ	11,800	856.00	10,100,800	
クレスコ	11,600	1,453.00	16,854,800	
フジ・メディア・ホール ディングス	184,000	1,031.00	189,704,000	
オービック	66,200	19,050.00	1,261,110,000	
ジャストシステム	31,000	7,620.00	236,220,000	
TDCソフト	16,700	1,022.00	17,067,400	
Zホールディングス	2,622,600	524.00	1,374,242,400	貸付有価証券 18,000株
トレンドマイクロ	84,900	5,930.00	503,457,000	貸付有価証券 5,500株
I Dホールディングス	7,300	1,430.00	10,439,000	
日本オラクル	38,700	12,780.00	494,586,000	
アルファシステムズ	5,900	3,760.00	22,184,000	
フューチャー	23,000	1,726.00	39,698,000	貸付有価証券 200株
CAC Holding s	12,400	1,210.00	15,004,000	
S Bテクノロジー	6,800	3,705.00	25,194,000	貸付有価証券 200株
トーセ	5,200	895.00	4,654,000	
オービックビジネスコン サルタント	19,500	5,800.00	113,100,000	貸付有価証券

				8,500株
伊藤忠テクノソリューションズ	87,000	4,035.00	351,045,000	
アイティフォー	23,100	738.00	17,047,800	
東計電算	2,800	4,480.00	12,544,000	
エックスネット	3,000	971.00	2,913,000	
大塚商会	103,300	5,720.00	590,876,000	貸付有価証券 300株
サイボウズ	22,300	3,415.00	76,154,500	
ソフトブレーン	11,200	423.00	4,737,600	貸付有価証券 1,100株
電通国際情報サービス	11,800	4,945.00	58,351,000	
A C C E S S	17,800	989.00	17,604,200	
デジタルガレージ	34,400	3,485.00	119,884,000	貸付有価証券 3,200株
EMシステムズ	26,900	1,005.00	27,034,500	
ウェザーニューズ	6,400	3,605.00	23,072,000	
C I J	13,000	848.00	11,024,000	
ビジネスエンジニアリング	2,200	2,678.00	5,891,600	貸付有価証券 1,000株
日本エンタープライズ	19,400	252.00	4,888,800	
WOWOW	9,200	2,407.00	22,144,400	貸付有価証券 300株（300株）
スカラ	12,700	689.00	8,750,300	
インテリジェント ウェイブ	11,100	820.00	9,102,000	貸付有価証券 300株
I M A G I C A G R O U P	16,200	402.00	6,512,400	
ネットワンシステムズ	72,800	3,565.00	259,532,000	貸付有価証券 5,100株
システムソフト	41,100	96.00	3,945,600	
アルゴグラフィックス	16,200	3,455.00	55,971,000	
マーベラス	29,100	705.00	20,515,500	貸付有価証券 1,100株
エイベックス	32,800	855.00	28,044,000	
日本ユニシス	59,600	3,330.00	198,468,000	貸付有価証券 700株
兼松エレクトロニクス	10,400	3,830.00	39,832,000	貸付有価証券 100株
東京放送ホールディング	116,100	1,715.00	199,111,500	貸付有価証券

ス				4,700株
日本テレビホールディングス	159,400	1,169.00	186,338,600	貸付有価証券 300株
朝日放送グループホールディングス	19,000	783.00	14,877,000	
テレビ朝日ホールディングス	52,500	1,563.00	82,057,500	貸付有価証券 18,200株
スカパーJ S A Tホールディングス	125,600	391.00	49,109,600	貸付有価証券 200株
テレビ東京ホールディングス	15,700	2,391.00	37,538,700	貸付有価証券 100株
日本BS放送	6,500	1,080.00	7,020,000	貸付有価証券 3,000株
ビジョン	17,800	673.00	11,979,400	貸付有価証券 8,300株（3,500株）
スマートバリュー	5,000	1,190.00	5,950,000	貸付有価証券 100株（100株）
USEN-NEXT HOLDINGS	7,300	1,256.00	9,168,800	貸付有価証券 1,500株（400株）
ワイヤレスゲート	9,000	704.00	6,336,000	貸付有価証券 4,200株
コネクシオ	10,800	1,412.00	15,249,600	
日本通信	148,900	172.00	25,610,800	貸付有価証券 68,600株（62,100株）
クロップス	3,500	709.00	2,481,500	
日本電信電話	2,552,800	2,503.50	6,390,934,800	貸付有価証券 123,500株
KDDI	1,392,300	3,161.00	4,401,060,300	貸付有価証券 91,200株
ソフトバンク	1,735,500	1,369.00	2,375,899,500	貸付有価証券 56,500株
光通信	19,700	24,140.00	475,558,000	
NTTドコモ	1,365,600	2,881.00	3,934,293,600	貸付有価証券 44,100株
エムティーアイ	18,500	654.00	12,099,000	
GMOインターネット	75,300	3,050.00	229,665,000	貸付有価証券 36,000株
ファイバーゲート	6,100	1,457.00	8,887,700	貸付有価証券 2,900株（1,100株）
アイドママーケティングコミュニケーション	5,700	456.00	2,599,200	
KADOKAWA	51,400	2,155.00	110,767,000	貸付有価証券

				8,300株
学研ホールディングス	25,600	1,469.00	37,606,400	
ゼンリン	38,100	1,195.00	45,529,500	貸付有価証券 6,300株
昭文社ホールディングス	8,800	407.00	3,581,600	貸付有価証券 200株
インプレスホールディングス	15,800	148.00	2,338,400	
アイネット	9,800	1,520.00	14,896,000	
松竹	12,600	14,940.00	188,244,000	貸付有価証券 5,400株（400株）
東宝	112,700	3,790.00	427,133,000	貸付有価証券 33,400株
東映	7,100	14,570.00	103,447,000	貸付有価証券 2,300株
エヌ・ティ・ティ・データ	508,500	1,177.00	598,504,500	貸付有価証券 8,500株
ピー・シー・エー	3,300	4,640.00	15,312,000	貸付有価証券 400株
ビジネスブレイン太田昭和	6,500	1,246.00	8,099,000	
D T S	42,700	2,258.00	96,416,600	貸付有価証券 400株
スクウェア・エニックス・ホールディングス	81,400	5,450.00	443,630,000	貸付有価証券 7,600株
シーイーシー	20,400	1,737.00	35,434,800	
カプコン	90,000	3,975.00	357,750,000	貸付有価証券 600株
アイ・エス・ビー	3,700	2,140.00	7,918,000	
ジャステック	12,200	1,352.00	16,494,400	
S C S K	44,100	5,090.00	224,469,000	貸付有価証券 600株
日本システムウエア	6,300	2,147.00	13,526,100	
アイネス	18,800	1,349.00	25,361,200	
T K C	16,200	5,650.00	91,530,000	
富士ソフト	24,400	4,210.00	102,724,000	
N S D	61,400	1,869.00	114,756,600	貸付有価証券 16,000株
コナミホールディングス	69,400	3,510.00	243,594,000	貸付有価証券 1,100株
福井コンピュータホール	7,500	2,724.00	20,430,000	貸付有価証券

ディングス				100株
J B C Cホールディングス	12,900	1,487.00	19,182,300	
ミロク情報サービス	16,800	2,282.00	38,337,600	貸付有価証券 400株
ソフトバンクグループ	1,515,300	5,380.00	8,152,314,000	貸付有価証券 7,000株
ハウスイ	1,500	915.00	1,372,500	
高千穂交易	7,400	940.00	6,956,000	
カワニシホールディングス	2,300	1,341.00	3,084,300	貸付有価証券 1,000株
伊藤忠食品	4,700	5,130.00	24,111,000	
エレマテック	17,900	907.00	16,235,300	
J A L U X	5,400	1,807.00	9,757,800	貸付有価証券 2,400株
あらた	15,300	4,785.00	73,210,500	貸付有価証券 100株
トーメンデバイス	2,900	3,800.00	11,020,000	
東京エレクトロン デバイス	6,900	3,315.00	22,873,500	
フィールズ	14,700	330.00	4,851,000	貸付有価証券 500株
双日	1,058,700	233.00	246,677,100	貸付有価証券 28,500株
アルフレッサ ホールディングス	213,000	2,253.00	479,889,000	貸付有価証券 200株
横浜冷凍	50,100	893.00	44,739,300	
神栄	2,600	522.00	1,357,200	
ラサ商事	10,100	913.00	9,221,300	
アルコニックス	20,400	1,159.00	23,643,600	
神戸物産	66,100	6,130.00	405,193,000	貸付有価証券 28,400株
ハイパー	2,900	574.00	1,664,600	
あい ホールディングス	27,400	1,532.00	41,976,800	
ディーブイエックス	6,800	730.00	4,964,000	貸付有価証券 2,100株
ダイワボウホールディングス	16,300	7,140.00	116,382,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	45,700	1,539.00	70,332,300	貸付有価証券 20,600株

ラクト・ジャパン	7,100	3,615.00	25,666,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	36,100	1,045.00	37,724,500	
八洲電機	14,800	943.00	13,956,400	
メディアスホールディングス	10,900	872.00	9,504,800	貸付有価証券 5,100株
レスターホールディングス	20,000	2,048.00	40,960,000	
ジューテックホールディングス	4,400	1,022.00	4,496,800	
大光	8,100	674.00	5,459,400	
OCHIホールディングス	5,600	1,550.00	8,680,000	
TOKAIホールディングス	101,300	997.00	100,996,100	貸付有価証券 300株
黒谷	5,200	541.00	2,813,200	
Cominix	3,300	732.00	2,415,600	
三洋貿易	19,300	991.00	19,126,300	
ビューティガレージ	3,100	1,695.00	5,254,500	
ウイン・パートナーズ	13,800	967.00	13,344,600	貸付有価証券 6,200株
ミタチ産業	5,700	617.00	3,516,900	
シップヘルスケアホールディングス	30,700	4,415.00	135,540,500	
明治電機工業	6,000	1,430.00	8,580,000	
デリカフーズホールディングス	6,700	612.00	4,100,400	貸付有価証券 3,200株
スターティアホールディングス	4,300	583.00	2,506,900	貸付有価証券 1,500株
コメダホールディングス	41,800	1,818.00	75,992,400	貸付有価証券 600株
ピーバンドットコム	1,900	975.00	1,852,500	
アセンテック	2,000	3,425.00	6,850,000	
富士興産	5,800	436.00	2,528,800	貸付有価証券 100株
協栄産業	2,100	1,156.00	2,427,600	
小野建	17,200	1,231.00	21,173,200	貸付有価証券 1,700株（1,200株）
南陽	4,200	1,425.00	5,985,000	
佐島電機	13,000	844.00	10,972,000	

エコートレーディング	4,400	530.00	2,332,000	
伯東	11,700	999.00	11,688,300	
コンドーテック	14,800	1,150.00	17,020,000	
中山福	11,000	483.00	5,313,000	
ナガイレーベン	25,400	2,622.00	66,598,800	
三菱食品	21,100	2,758.00	58,193,800	貸付有価証券 100株
松田産業	14,000	1,360.00	19,040,000	
第一興商	28,500	3,135.00	89,347,500	
メディopalホールディング グス	206,900	2,036.00	421,248,400	貸付有価証券 1,100株
S P K	8,200	1,428.00	11,709,600	
萩原電気ホールディング ス	7,100	2,077.00	14,746,700	
アズワン	12,500	11,830.00	147,875,000	
スズデン	6,600	1,203.00	7,939,800	
尾家産業	5,600	1,550.00	8,680,000	
シモジマ	11,700	1,192.00	13,946,400	
ドウシシャ	18,100	1,615.00	29,231,500	
小津産業	4,200	1,726.00	7,249,200	
高速	11,400	1,488.00	16,963,200	
たけびし	6,700	1,493.00	10,003,100	
リックス	4,300	1,630.00	7,009,000	
丸文	16,900	654.00	11,052,600	
ハビネット	16,000	1,136.00	18,176,000	
橋本総業ホールディング ス	3,900	2,085.00	8,131,500	
日本ライフライン	56,800	1,412.00	80,201,600	
タカショー	12,400	496.00	6,150,400	貸付有価証券 2,500株
マルカ	6,800	1,960.00	13,328,000	
I D O M	51,700	485.00	25,074,500	貸付有価証券 3,500株（3,500株）
進和	11,300	2,011.00	22,724,300	
エスケイジャパン	4,100	308.00	1,262,800	
ダイトロン	8,100	1,660.00	13,446,000	
シークス	24,400	963.00	23,497,200	
田中商事	5,900	704.00	4,153,600	

オーハシテクニカ	9,800	1,576.00	15,444,800	
白銅	6,900	1,405.00	9,694,500	
ダイコー通産	1,200	1,346.00	1,615,200	
伊藤忠商事	1,340,700	2,314.00	3,102,379,800	
丸紅	1,995,200	483.80	965,277,760	貸付有価証券 35,400株
高島	3,000	1,766.00	5,298,000	
長瀬産業	107,800	1,330.00	143,374,000	貸付有価証券 100株
蝶理	12,200	1,854.00	22,618,800	
豊田通商	213,900	2,680.00	573,252,000	貸付有価証券 1,300株
三共生興	29,000	445.00	12,905,000	
兼松	71,500	1,283.00	91,734,500	
ツカモトコーポレーショ ン	3,400	1,137.00	3,865,800	
三井物産	1,659,700	1,596.00	2,648,881,200	貸付有価証券 2,300株
日本紙パルプ商事	10,900	4,000.00	43,600,000	
カメイ	25,000	1,031.00	25,775,000	
東都水産	2,400	3,210.00	7,704,000	貸付有価証券 1,100株
ＯＵＧホールディングス	3,000	2,700.00	8,100,000	
スターゼン	7,100	4,165.00	29,571,500	
山善	74,900	916.00	68,608,400	
椿本興業	3,500	3,915.00	13,702,500	
住友商事	1,209,400	1,218.50	1,473,653,900	貸付有価証券 3,800株
内田洋行	7,600	6,310.00	47,956,000	
三菱商事	1,256,800	2,233.00	2,806,434,400	貸付有価証券 19,200株
第一実業	9,400	3,800.00	35,720,000	
キヤノンマーケティング ジャパン	47,500	2,140.00	101,650,000	貸付有価証券 1,100株
西華産業	10,800	1,255.00	13,554,000	
佐藤商事	15,800	872.00	13,777,600	
菱洋エレクトロ	19,400	2,909.00	56,434,600	貸付有価証券 400株
東京産業	17,300	514.00	8,892,200	

ユアサ商事	18,200	2,898.00	52,743,600	貸付有価証券 100株
神鋼商事	4,800	1,980.00	9,504,000	
トルク	11,400	310.00	3,534,000	
阪和興業	35,800	1,940.00	69,452,000	貸付有価証券 700株
正栄食品工業	12,400	4,290.00	53,196,000	
カナデン	15,600	1,290.00	20,124,000	
菱電商事	13,800	1,474.00	20,341,200	貸付有価証券 100株
フルサト工業	10,600	1,413.00	14,977,800	
岩谷産業	42,500	3,760.00	159,800,000	貸付有価証券 19,900株（9,100株）
ナイス	8,200	826.00	6,773,200	
昭光通商	6,100	634.00	3,867,400	
ニチモウ	3,000	1,905.00	5,715,000	
極東貿易	5,500	1,348.00	7,414,000	
イワキ	25,100	502.00	12,600,200	
三愛石油	47,200	975.00	46,020,000	貸付有価証券 300株
稲畑産業	42,200	1,300.00	54,860,000	貸付有価証券 300株
G S I クレオス	4,700	1,238.00	5,818,600	
明和産業	17,700	469.00	8,301,300	貸付有価証券 8,300株（5,400株）
クワザワ	6,800	535.00	3,638,000	
ヤマエ久野	14,000	1,210.00	16,940,000	
ワキタ	40,900	930.00	38,037,000	
東邦ホールディングス	61,500	1,995.00	122,692,500	
サンゲツ	52,200	1,514.00	79,030,800	
ミツウロコグループホールディングス	28,200	1,155.00	32,571,000	
シナネンホールディングス	7,900	2,760.00	21,804,000	
伊藤忠エネクス	42,400	863.00	36,591,200	
サンリオ	53,800	1,655.00	89,039,000	貸付有価証券 9,300株（3,600株）
サンワテクノス	13,600	916.00	12,457,600	
リョーサン	21,100	2,227.00	46,989,700	

新光商事	30,000	840.00	25,200,000	
トーヨー	8,700	1,923.00	16,730,100	
三信電気	10,300	1,551.00	15,975,300	
東陽テクニカ	20,500	997.00	20,438,500	
モスフードサービス	25,100	3,030.00	76,053,000	貸付有価証券 1,100株
加賀電子	19,100	1,959.00	37,416,900	
ソーダニッカ	19,800	503.00	9,959,400	
立花エレテック	14,200	1,752.00	24,878,400	
フォーバル	8,400	1,020.00	8,568,000	
PAL TAC	30,700	4,945.00	151,811,500	
三谷産業	25,200	343.00	8,643,600	
太平洋興発	7,500	622.00	4,665,000	
西本Wismettac ホールディングス	3,500	2,105.00	7,367,500	
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,700	1,856.00	3,155,200	
国際紙パルプ商事	45,400	277.00	12,575,800	貸付有価証券 100株
ヤマタネ	9,600	1,195.00	11,472,000	
丸紅建材リース	1,900	1,626.00	3,089,400	
日鉄物産	13,700	3,370.00	46,169,000	貸付有価証券 200株
泉州電業	5,900	3,040.00	17,936,000	
トラスコ中山	39,900	2,773.00	110,642,700	
オートバックスセブン	71,100	1,363.00	96,909,300	貸付有価証券 11,300株
モリト	14,000	673.00	9,422,000	
加藤産業	27,700	3,490.00	96,673,000	
北恵	4,800	1,002.00	4,809,600	
イノテック	9,900	947.00	9,375,300	
イエローハット	36,200	1,496.00	54,155,200	
J Kホールディングス	17,300	814.00	14,082,200	貸付有価証券 7,900株
日伝	17,300	2,403.00	41,571,900	
北沢産業	14,400	276.00	3,974,400	
杉本商事	10,300	1,899.00	19,559,700	
因幡電機産業	54,500	2,379.00	129,655,500	

東テク	6,300	2,218.00	13,973,400	
ミスミグループ本社	240,300	2,666.00	640,639,800	貸付有価証券 7,900株
アルテック	15,200	218.00	3,313,600	
タキヒヨー	5,800	1,884.00	10,927,200	
蔵王産業	3,700	1,439.00	5,324,300	
スズケン	81,200	3,990.00	323,988,000	貸付有価証券 1,600株
ジェコス	13,200	930.00	12,276,000	
グローセル	19,200	444.00	8,524,800	
ローソン	48,500	5,460.00	264,810,000	貸付有価証券 800株
サンエー	15,900	4,040.00	64,236,000	
カワチ薬品	14,900	2,726.00	40,617,400	貸付有価証券 2,000株
エービーシー・マート	29,900	6,290.00	188,071,000	
ハードオフコーポレーション	7,600	694.00	5,274,400	
アスクル	20,000	3,500.00	70,000,000	
ゲオホールディングス	34,500	1,351.00	46,609,500	
アダストリア	26,500	1,726.00	45,739,000	貸付有価証券 8,500株
ジーフット	11,600	508.00	5,892,800	貸付有価証券 5,500株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,800	530.00	1,484,000	
くら寿司	10,000	5,130.00	51,300,000	
キャンドゥ	9,100	2,102.00	19,128,200	貸付有価証券 700株
パルグループホールディングス	19,600	1,295.00	25,382,000	
エディオン	88,000	1,074.00	94,512,000	貸付有価証券 41,300株（500株）
サーラコーポレーション	38,900	570.00	22,173,000	
ワッツ	8,400	943.00	7,921,200	貸付有価証券 400株
ハローズ	7,200	3,515.00	25,308,000	
フジオフードシステム	16,200	1,476.00	23,911,200	貸付有価証券 1,600株
あみやき亭	4,100	3,165.00	12,976,500	

ひらまつ	35,200	175.00	6,160,000	
大黒天物産	4,600	4,925.00	22,655,000	
ハニーズホールディングス	16,900	1,137.00	19,215,300	
ファーマライズホールディングス	4,600	693.00	3,187,800	貸付有価証券 200株
アルペン	14,700	1,696.00	24,931,200	貸付有価証券 7,000株
ハブ	5,400	691.00	3,731,400	
クオールホールディングス	28,200	1,139.00	32,119,800	
ジンズホールディングス	10,100	6,590.00	66,559,000	貸付有価証券 4,600株
ビックカメラ	113,700	1,132.00	128,708,400	貸付有価証券 200株
DCMホールディングス	106,200	1,182.00	125,528,400	貸付有価証券 45,500株（100株）
Monotaro	136,300	4,365.00	594,949,500	貸付有価証券 8,800株（8,700株）
東京一番フーズ	4,900	511.00	2,503,900	貸付有価証券 1,400株
DDホールディングス	7,600	921.00	6,999,600	
きちりホールディングス	5,100	624.00	3,182,400	
アークランドサービスホールディングス	14,000	1,848.00	25,872,000	貸付有価証券 6,600株
J. フロント リテイリング	228,900	758.00	173,506,200	貸付有価証券 86,200株（73,200株）
ドトール・日レスホールディングス	27,600	1,719.00	47,444,400	
マツモトキヨシホールディングス	79,200	3,950.00	312,840,000	貸付有価証券 900株
ブロンコビリー	10,000	2,433.00	24,330,000	貸付有価証券 4,700株
ZOZO	131,800	2,444.00	322,119,200	貸付有価証券 14,300株
トレジャー・ファクトリー	5,600	792.00	4,435,200	
物語コーポレーション	5,100	8,150.00	41,565,000	貸付有価証券 2,400株
ココカラファイン	20,000	5,800.00	116,000,000	
三越伊勢丹ホールディング	335,100	623.00	208,767,300	貸付有価証券

ダス				100株
Hame e	6,800	1,643.00	11,172,400	貸付有価証券 1,800株
ウエルシアホールディン ダス	57,000	9,130.00	520,410,000	貸付有価証券 800株
クリエイトSDホール ディングス	32,300	3,430.00	110,789,000	
丸善CHIホールディン ダス	22,400	397.00	8,892,800	貸付有価証券 10,700株
ミサワ	3,900	541.00	2,109,900	
ティーライフ	2,800	1,099.00	3,077,200	貸付有価証券 1,300株
エー・ピーカンパニー	3,600	468.00	1,684,800	
チムニー	5,800	1,464.00	8,491,200	貸付有価証券 2,700株
シュッピン	13,000	718.00	9,334,000	
オイシックス・ラ・大地	18,900	2,117.00	40,011,300	貸付有価証券 300株
ネクステージ	27,500	868.00	23,870,000	貸付有価証券 12,800株（7,500株）
ジョイフル本田	56,100	1,439.00	80,727,900	
鳥貴族	5,600	1,509.00	8,450,400	貸付有価証券 2,600株（400株）
キリン堂ホールディン ダス	7,500	2,472.00	18,540,000	貸付有価証券 100株
ホットランド	12,800	1,162.00	14,873,600	貸付有価証券 6,000株
すかいらくホールディ ングス	214,800	1,715.00	368,382,000	貸付有価証券 103,200株
SFPホールディングス	10,900	1,619.00	17,647,100	
綿半ホールディングス	7,200	1,912.00	13,766,400	
ヨシックス	3,100	1,968.00	6,100,800	
ユナイテッド・スーパー マーケット・ホール	55,700	1,137.00	63,330,900	貸付有価証券 19,200株
ゴルフダイジェスト・オ ンライン	8,800	533.00	4,690,400	貸付有価証券 4,200株（1,000株）
BEENOS	8,900	1,014.00	9,024,600	貸付有価証券 1,200株
あさひ	14,300	1,523.00	21,778,900	貸付有価証券 500株（500株）
日本調剤	11,600	1,611.00	18,687,600	

コスモス薬品	16,900	16,810.00	284,089,000	
トーエル	9,300	706.00	6,565,800	
オンリー	3,200	602.00	1,926,400	貸付有価証券 100株（100株）
セブン&アイ・ホールディングス	749,900	3,479.00	2,608,902,100	貸付有価証券 145,500株
クリエイト・レストランツ・ホールディング	103,000	711.00	73,233,000	貸付有価証券 40,300株（6,200株）
ツルハホールディングス	41,700	15,370.00	640,929,000	貸付有価証券 4,500株（4,500株）
サンマルクホールディングス	15,100	1,640.00	24,764,000	
フェリシモ	4,200	1,053.00	4,422,600	
トリドールホールディングス	47,400	1,215.00	57,591,000	貸付有価証券 18,000株
TOKYO BASE	17,300	357.00	6,176,100	貸付有価証券 8,100株（3,000株）
ウイルプラスホールディングス	2,400	705.00	1,692,000	貸付有価証券 1,100株
JMホールディングス	14,500	3,070.00	44,515,000	貸付有価証券 6,800株
サツドラホールディングス	2,900	1,979.00	5,739,100	
アレンザホールディングス	9,600	1,006.00	9,657,600	
串カツ田中ホールディングス	3,900	1,655.00	6,454,500	貸付有価証券 1,800株
バロックジャパンリミテッド	13,300	667.00	8,871,100	貸付有価証券 500株
クスリのアオキホールディングス	17,100	9,170.00	156,807,000	貸付有価証券 700株
力の源ホールディングス	8,700	676.00	5,881,200	貸付有価証券 2,600株（2,500株）
スシローグローバルホールディングス	105,200	2,387.00	251,112,400	貸付有価証券 400株
LIXILビバ	18,900	2,595.00	49,045,500	貸付有価証券 8,900株
メディカルシステムネットワーク	18,500	494.00	9,139,000	貸付有価証券 7,300株
はるやまホールディングス	9,000	774.00	6,966,000	貸付有価証券 4,100株
ノジマ	34,100	2,623.00	89,444,300	

カップ・クリエイト	26,900	1,477.00	39,731,300	貸付有価証券 100株（100株）
ライトオン	14,300	588.00	8,408,400	貸付有価証券 6,000株
ジーンズメイト	5,800	225.00	1,305,000	貸付有価証券 2,700株（2,300株）
良品計画	254,500	1,495.00	380,477,500	貸付有価証券 11,300株
三城ホールディングス	20,300	298.00	6,049,400	
アドヴァン	29,300	1,314.00	38,500,200	
アルビス	7,300	2,201.00	16,067,300	
コナカ	22,600	305.00	6,893,000	
ハウス オブ ローゼ	2,300	1,598.00	3,675,400	貸付有価証券 200株（200株）
G-7ホールディングス	11,300	2,368.00	26,758,400	
イオン北海道	25,300	844.00	21,353,200	
コジマ	33,000	549.00	18,117,000	貸付有価証券 15,400株
ヒマラヤ	6,700	826.00	5,534,200	貸付有価証券 3,100株
コーナン商事	27,200	3,340.00	90,848,000	貸付有価証券 300株
エコス	7,000	1,948.00	13,636,000	
ワタミ	22,700	967.00	21,950,900	貸付有価証券 10,600株（2,400株）
マルシェ	5,000	603.00	3,015,000	貸付有価証券 1,200株
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	421,300	2,396.00	1,009,434,800	貸付有価証券 100株
西松屋チェーン	42,000	1,156.00	48,552,000	貸付有価証券 18,800株
ゼンショーホールディン グス	91,800	2,170.00	199,206,000	貸付有価証券 4,700株
幸楽苑ホールディングス	12,200	1,555.00	18,971,000	貸付有価証券 1,900株（700株）
ハークスレイ	4,000	1,061.00	4,244,000	
サイゼリヤ	28,400	2,130.00	60,492,000	貸付有価証券 9,000株
V Tホールディングス	79,300	347.00	27,517,100	貸付有価証券 1,000株
魚力	5,300	1,621.00	8,591,300	貸付有価証券

				2,400株
ポプラ	5,000	433.00	2,165,000	貸付有価証券 700株
フジ・コーポレーション	5,100	2,012.00	10,261,200	
ユナイテッドアローズ	20,100	1,777.00	35,717,700	
ハイデイ日高	27,700	1,760.00	48,752,000	貸付有価証券 13,100株
京都きもの友禅	12,200	275.00	3,355,000	貸付有価証券 5,600株
コロワイド	63,700	1,427.00	90,899,900	貸付有価証券 29,900株（1,600株）
ピーシーデポコーポレー ション	25,400	773.00	19,634,200	貸付有価証券 5,900株
壱番屋	13,500	4,735.00	63,922,500	
トップカルチャー	6,900	362.00	2,497,800	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
P L A N T	4,900	597.00	2,925,300	
スギホールディングス	38,300	7,440.00	284,952,000	
薬王堂ホールディングス	8,300	2,594.00	21,530,200	
ヴィア・ホールディング ス	23,500	433.00	10,175,500	貸付有価証券 1,100株（700株）
スクロール	29,500	438.00	12,921,000	
ヨンドシーホールディン グス	19,500	1,745.00	34,027,500	貸付有価証券 100株
ファミリーマート	153,100	1,795.00	274,814,500	貸付有価証券 23,200株
木曽路	25,100	2,470.00	61,997,000	貸付有価証券 600株（600株）
S R S ホールディングス	22,600	910.00	20,566,000	貸付有価証券 10,800株
千趣会	34,600	362.00	12,525,200	貸付有価証券 16,400株
タカキュー	14,800	132.00	1,953,600	貸付有価証券 300株（300株）
リテールパートナーズ	25,400	1,653.00	41,986,200	貸付有価証券 5,100株
ケーヨー	39,400	713.00	28,092,200	
上新電機	22,500	2,139.00	48,127,500	
日本瓦斯	30,300	4,680.00	141,804,000	
ロイヤルホールディング	33,500	1,890.00	63,315,000	貸付有価証券

ス				16,000株（300株）
東天紅	1,400	1,035.00	1,449,000	
いなげや	23,700	1,707.00	40,455,900	
島忠	36,000	2,930.00	105,480,000	貸付有価証券 6,900株
チヨダ	20,100	1,180.00	23,718,000	
ライフコーポレーション	14,500	3,410.00	49,445,000	貸付有価証券 200株（200株）
リンガーハット	23,600	2,383.00	56,238,800	貸付有価証券 10,300株
MrMaxHD	26,300	595.00	15,648,500	貸付有価証券 200株
テンアライド	17,700	386.00	6,832,200	貸付有価証券 8,400株
AOKIホールディングス	38,300	614.00	23,516,200	貸付有価証券 4,000株
オークワ	30,100	1,695.00	51,019,500	
コメリ	29,600	2,667.00	78,943,200	
青山商事	39,600	741.00	29,343,600	貸付有価証券 12,500株
しまむら	22,300	7,690.00	171,487,000	貸付有価証券 300株
はせがわ	10,100	330.00	3,333,000	
高島屋	139,600	907.00	126,617,200	貸付有価証券 33,600株（23,700株）
松屋	38,600	685.00	26,441,000	貸付有価証券 6,400株
エイチ・ツー・オー リ テイリング	90,800	727.00	66,011,600	
近鉄百貨店	7,300	3,055.00	22,301,500	貸付有価証券 3,400株
丸井グループ	175,700	1,965.00	345,250,500	貸付有価証券 2,100株
アクシアル リテイリン グ	15,900	4,315.00	68,608,500	
井筒屋	10,400	197.00	2,048,800	貸付有価証券 100株
イオン	737,600	2,498.00	1,842,524,800	貸付有価証券 1,800株
イズミ	39,000	3,365.00	131,235,000	貸付有価証券 100株

平和堂	38,900	1,889.00	73,482,100	貸付有価証券 17,400株
フジ	23,100	1,894.00	43,751,400	貸付有価証券 300株
ヤオコー	21,800	7,740.00	168,732,000	貸付有価証券 8,200株（1,400株）
ゼビオホールディングス	23,200	847.00	19,650,400	
ケースホールディングス	185,000	1,477.00	273,245,000	貸付有価証券 1,000株
O l y m p i cグループ	9,900	844.00	8,355,600	
日産東京販売ホールディングス	28,200	250.00	7,050,000	貸付有価証券 100株
シルバーライフ	2,600	2,237.00	5,816,200	貸付有価証券 700株（500株）
一家ダイニングプロジェクト	2,000	614.00	1,228,000	
Genky Drug Stores	8,400	3,680.00	30,912,000	
ナルミヤ・インターナショナル	4,300	676.00	2,906,800	
ブックオフグループホールディングス	11,200	819.00	9,172,800	貸付有価証券 5,300株（400株）
アインホールディングス	23,500	6,970.00	163,795,000	貸付有価証券 11,000株
元気寿司	4,800	2,316.00	11,116,800	貸付有価証券 2,500株
ヤマダ電機	584,000	535.00	312,440,000	貸付有価証券 65,300株
アークランドサカモト	30,000	1,885.00	56,550,000	貸付有価証券 10,400株（7,200株）
ニトリホールディングス	83,000	21,030.00	1,745,490,000	貸付有価証券 600株
グルメ杵屋	13,700	1,017.00	13,932,900	貸付有価証券 6,200株
愛眼	15,300	223.00	3,411,900	貸付有価証券 800株
ケーユーホールディングス	10,000	850.00	8,500,000	
吉野家ホールディングス	63,000	2,241.00	141,183,000	貸付有価証券 18,700株（10,700株）
松屋フーズホールディングス	9,200	3,685.00	33,902,000	

サガミホールディングス	25,600	1,264.00	32,358,400	貸付有価証券 12,300株
関西スーパーマーケット	15,900	1,098.00	17,458,200	
王将フードサービス	14,100	6,000.00	84,600,000	
プレナス	21,500	1,797.00	38,635,500	貸付有価証券 8,300株
ミニストップ	14,200	1,510.00	21,442,000	
アークス	39,200	2,152.00	84,358,400	貸付有価証券 700株
バローホールディングス	42,400	2,076.00	88,022,400	
藤久	2,000	1,085.00	2,170,000	貸付有価証券 900株
ベルク	9,500	7,380.00	70,110,000	
大庄	10,200	1,314.00	13,402,800	貸付有価証券 4,700株
ファーストリテイリング	25,600	60,640.00	1,552,384,000	貸付有価証券 2,200株
サンドラッグ	72,100	3,640.00	262,444,000	
サックスパー ホール ディングス	16,200	611.00	9,898,200	貸付有価証券 100株
ヤマザワ	4,500	1,705.00	7,672,500	
やまや	3,900	2,288.00	8,923,200	貸付有価証券 1,800株
ベルーナ	41,100	614.00	25,235,400	貸付有価証券 600株
島根銀行	5,100	562.00	2,866,200	
じもとホールディングス	129,700	95.00	12,321,500	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
めぶきフィナンシャルグ ループ	997,400	252.00	251,344,800	貸付有価証券 6,800株
東京きらぼしフィナン シャルグループ	25,900	1,136.00	29,422,400	
九州フィナンシャルグ ループ	420,000	468.00	196,560,000	貸付有価証券 27,100株
ゆうちょ銀行	543,800	803.00	436,671,400	貸付有価証券 259,800株
富山第一銀行	45,800	274.00	12,549,200	
コンコルディア・フィナ ンシャルグループ	1,096,300	347.00	380,416,100	貸付有価証券 6,300株
西日本フィナンシャル ホールディングス	127,700	739.00	94,370,300	貸付有価証券 1,700株

関西みらいフィナンシャルグループ	112,700	406.00	45,756,200	貸付有価証券 3,400株
三十三フィナンシャルグループ	17,800	1,359.00	24,190,200	
第四北越フィナンシャルグループ	33,300	2,185.00	72,760,500	貸付有価証券 1,100株
新生銀行	140,900	1,296.00	182,606,400	貸付有価証券 100株
あおぞら銀行	114,400	1,850.00	211,640,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	13,130,800	422.50	5,547,763,000	貸付有価証券 1,993,900株
りそなホールディングス	2,106,500	368.00	775,192,000	貸付有価証券 200株
三井住友トラスト・ホールディングス	362,800	2,928.50	1,062,459,800	貸付有価証券 300株
三井住友フィナンシャルグループ	1,327,600	3,011.00	3,997,403,600	貸付有価証券 6,600株
千葉銀行	640,600	510.00	326,706,000	貸付有価証券 27,300株
群馬銀行	368,700	344.00	126,832,800	貸付有価証券 6,200株
武蔵野銀行	28,600	1,509.00	43,157,400	
千葉興業銀行	52,600	240.00	12,624,000	
筑波銀行	79,800	176.00	14,044,800	貸付有価証券 100株
七十七銀行	64,800	1,594.00	103,291,200	貸付有価証券 400株
青森銀行	14,900	2,293.00	34,165,700	
秋田銀行	12,300	1,518.00	18,671,400	
山形銀行	21,600	1,332.00	28,771,200	
岩手銀行	12,600	2,619.00	32,999,400	
東邦銀行	171,600	228.00	39,124,800	貸付有価証券 200株
東北銀行	9,200	974.00	8,960,800	
みちのく銀行	12,300	1,130.00	13,899,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	161,700	1,682.00	271,979,400	貸付有価証券 100株
静岡銀行	467,500	696.00	325,380,000	
十六銀行	24,100	2,004.00	48,296,400	
スルガ銀行	196,400	375.00	73,650,000	貸付有価証券

				21,100株
八十二銀行	463,200	406.00	188,059,200	貸付有価証券 23,300株
山梨中央銀行	22,300	851.00	18,977,300	
大垣共立銀行	37,900	2,319.00	87,890,100	
福井銀行	16,400	1,708.00	28,011,200	
北國銀行	19,100	2,914.00	55,657,400	貸付有価証券 400株
清水銀行	7,900	1,791.00	14,148,900	
富山銀行	3,700	2,350.00	8,695,000	
滋賀銀行	38,500	2,425.00	93,362,500	貸付有価証券 800株（700株）
南都銀行	31,900	2,116.00	67,500,400	
百五銀行	172,700	326.00	56,300,200	貸付有価証券 200株
京都銀行	68,700	3,805.00	261,403,500	
紀陽銀行	68,000	1,658.00	112,744,000	
ほくほくフィナンシャル グループ	127,800	896.00	114,508,800	
広島銀行	283,400	513.00	145,384,200	貸付有価証券 600株
山陰合同銀行	113,800	545.00	62,021,000	貸付有価証券 100株
中国銀行	165,200	1,001.00	165,365,200	
鳥取銀行	6,500	1,264.00	8,216,000	
伊予銀行	273,900	658.00	180,226,200	貸付有価証券 7,800株
百十四銀行	20,400	1,936.00	39,494,400	
四国銀行	29,200	803.00	23,447,600	貸付有価証券 2,200株
阿波銀行	31,400	2,479.00	77,840,600	貸付有価証券 1,600株
大分銀行	11,000	2,408.00	26,488,000	
宮崎銀行	12,800	2,397.00	30,681,600	
佐賀銀行	11,600	1,194.00	13,850,400	
沖縄銀行	17,600	3,115.00	54,824,000	
琉球銀行	44,300	951.00	42,129,300	
セブン銀行	641,200	297.00	190,436,400	貸付有価証券 37,500株
みずほフィナンシャルグ	26,083,300	131.90	3,440,387,270	貸付有価証券

ループ				140,200株
高知銀行	7,000	668.00	4,676,000	
山口フィナンシャルグループ	239,600	654.00	156,698,400	
長野銀行	6,300	1,191.00	7,503,300	
名古屋銀行	14,300	2,345.00	33,533,500	
北洋銀行	289,400	212.00	61,352,800	
愛知銀行	6,900	2,814.00	19,416,600	
中京銀行	7,900	2,131.00	16,834,900	
大光銀行	6,600	1,559.00	10,289,400	
愛媛銀行	26,800	1,191.00	31,918,800	貸付有価証券 200株
トマト銀行	7,400	1,048.00	7,755,200	
京葉銀行	81,800	516.00	42,208,800	貸付有価証券 100株
栃木銀行	92,700	168.00	15,573,600	
北日本銀行	6,000	1,939.00	11,634,000	
東和銀行	33,700	704.00	23,724,800	
福島銀行	18,100	172.00	3,113,200	貸付有価証券 3,500株
大東銀行	10,000	632.00	6,320,000	
トモニホールディングス	148,400	345.00	51,198,000	貸付有価証券 2,400株
フィデアホールディングス	186,400	100.00	18,640,000	
池田泉州ホールディングス	220,700	166.00	36,636,200	貸付有価証券 800株
F P G	59,200	587.00	34,750,400	貸付有価証券 6,100株
マーキュリアインベストメント	8,500	595.00	5,057,500	
S B I ホールディングス	214,400	2,287.00	490,332,800	
日本アジア投資	16,200	232.00	3,758,400	貸付有価証券 800株
ジャフコ	29,500	3,575.00	105,462,500	
大和証券グループ本社	1,540,200	454.00	699,250,800	
野村ホールディングス	3,377,500	489.60	1,653,624,000	貸付有価証券 1,800株
岡三証券グループ	163,600	325.00	53,170,000	貸付有価証券 1,400株

丸三証券	57,000	412.00	23,484,000	貸付有価証券 13,700株（100株）
東洋証券	68,600	119.00	8,163,400	貸付有価証券 500株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	220,400	240.00	52,896,000	貸付有価証券 7,000株
光世証券	4,600	513.00	2,359,800	
水戸証券	55,500	197.00	10,933,500	
いちよし証券	35,900	452.00	16,226,800	
松井証券	109,700	827.00	90,721,900	貸付有価証券 700株
マネックスグループ	140,800	218.00	30,694,400	貸付有価証券 38,400株（37,400株）
極東証券	25,700	516.00	13,261,200	
岩井コスモホールディングス	18,100	1,087.00	19,674,700	
藍澤證券	34,500	685.00	23,632,500	
マネーパートナーズグループ	20,400	199.00	4,059,600	貸付有価証券 4,200株
スパークス・グループ	88,600	218.00	19,314,800	貸付有価証券 1,100株
小林洋行	5,500	257.00	1,413,500	
かんぽ生命保険	68,000	1,395.00	94,860,000	貸付有価証券 4,100株
SOMPOホールディングス	360,900	3,650.00	1,317,285,000	貸付有価証券 500株
アニコム ホールディングス	15,900	4,480.00	71,232,000	貸付有価証券 2,100株
MS & ADインシュアランスグループホール	501,900	2,971.00	1,491,144,900	貸付有価証券 700株
ソニーフィナンシャルホールディングス	157,700	2,595.00	409,231,500	貸付有価証券 8,200株
第一生命ホールディングス	1,086,200	1,283.00	1,393,594,600	
東京海上ホールディングス	678,700	4,613.00	3,130,843,100	貸付有価証券 600株
T & Dホールディングス	573,700	907.00	520,345,900	貸付有価証券 12,100株
アドバンスクリエイト	4,000	2,085.00	8,340,000	貸付有価証券 600株
全国保証	54,100	4,095.00	221,539,500	貸付有価証券

				24,900株
ジェイリース	5,300	375.00	1,987,500	貸付有価証券 2,300株
イントラスト	6,700	727.00	4,870,900	貸付有価証券 800株
日本モーゲージサービス	3,900	2,025.00	7,897,500	
C a s a	6,700	1,131.00	7,577,700	貸付有価証券 3,100株
アルヒ	30,500	1,492.00	45,506,000	貸付有価証券 14,300株（6,700株）
プレミアグループ	10,400	1,987.00	20,664,800	
クレディセゾン	134,500	1,231.00	165,569,500	貸付有価証券 3,400株
芙蓉総合リース	20,100	5,970.00	119,997,000	
みずほリース	29,600	2,356.00	69,737,600	貸付有価証券 700株
東京センチュリー	38,700	5,490.00	212,463,000	貸付有価証券 9,900株
日本証券金融	84,600	512.00	43,315,200	貸付有価証券 100株
アイフル	292,800	238.00	69,686,400	貸付有価証券 59,700株
リコーリース	15,100	2,986.00	45,088,600	
イオンフィナンシャル サービス	117,500	1,162.00	136,535,000	貸付有価証券 100株
アコム	385,800	409.00	157,792,200	貸付有価証券 19,300株
ジャックス	21,200	1,728.00	36,633,600	貸付有価証券 400株
オリエントコーポレー ション	519,200	118.00	61,265,600	貸付有価証券 1,000株
日立キャピタル	45,300	2,354.00	106,636,200	貸付有価証券 100株
アプラスフィナンシャル	92,100	66.00	6,078,600	貸付有価証券 1,500株
オリックス	1,190,900	1,305.00	1,554,124,500	貸付有価証券 4,700株
三菱UFJリース	487,200	504.00	245,548,800	
九州リースサービス	9,400	514.00	4,831,600	
日本取引所グループ	550,900	2,498.00	1,376,148,200	貸付有価証券 6,600株

イー・ギャランティ	20,500	2,512.00	51,496,000	貸付有価証券 100株
アサックス	10,000	673.00	6,730,000	貸付有価証券 4,300株
NEC キャピタルソ リューション	7,800	1,980.00	15,444,000	
いちご	244,300	265.00	64,739,500	
日本駐車場開発	189,500	137.00	25,961,500	貸付有価証券 2,400株（800株）
スター・マイカ・ホール ディングス	9,900	1,346.00	13,325,400	
ADワークスグループ	35,600	180.00	6,408,000	貸付有価証券 16,700株
ヒューリック	409,900	982.00	402,521,800	
三栄建築設計	7,700	1,290.00	9,933,000	
野村不動産ホールディン グス	116,500	1,914.00	222,981,000	貸付有価証券 1,600株
三重交通グループホール ディングス	38,900	485.00	18,866,500	貸付有価証券 18,200株
サムティ	27,200	1,346.00	36,611,200	貸付有価証券 900株
ディア・ライフ	27,100	500.00	13,550,000	
コーセーアールイー	5,600	544.00	3,046,400	
日本商業開発	12,200	1,539.00	18,775,800	
プレサンスコーポレー ション	31,500	1,178.00	37,107,000	貸付有価証券 7,400株（400株）
ハウスコム	3,300	1,380.00	4,554,000	
日本管理センター	12,600	1,202.00	15,145,200	
サンセイランディック	5,600	827.00	4,631,200	貸付有価証券 2,600株
エストラスト	2,600	665.00	1,729,000	
フージャースホールディ ングス	38,300	539.00	20,643,700	
オープンハウス	55,800	3,685.00	205,623,000	
東急不動産ホールディン グス	521,900	495.00	258,340,500	貸付有価証券 2,100株
飯田グループホールディ ングス	160,100	1,643.00	263,044,300	貸付有価証券 3,400株
イーグランド	3,100	702.00	2,176,200	
ムゲンエステート	13,200	537.00	7,088,400	貸付有価証券

				6,300株
ビーロット	9,000	667.00	6,003,000	
ファーストブラザーズ	4,400	732.00	3,220,800	
ハウスドゥ	9,400	916.00	8,610,400	貸付有価証券 4,500株
シーアールイー	4,800	1,500.00	7,200,000	貸付有価証券 700株
プロパティエージェント	3,000	1,050.00	3,150,000	
ケイアイスター不動産	6,000	1,683.00	10,098,000	
アグレ都市デザイン	3,100	501.00	1,553,100	
グッドコムアセット	4,600	1,684.00	7,746,400	貸付有価証券 1,100株
ジェイ・エス・ビー	4,100	2,718.00	11,143,800	
テンポイノベーション	4,300	649.00	2,790,700	貸付有価証券 2,000株（200株）
グローバル・リンク・マ ネジメント	3,200	645.00	2,064,000	
パーク24	103,000	1,797.00	185,091,000	貸付有価証券 12,500株
パラカ	4,900	1,663.00	8,148,700	
三井不動産	946,700	1,885.50	1,785,002,850	
三菱地所	1,344,900	1,578.00	2,122,252,200	貸付有価証券 63,500株
平和不動産	35,200	3,070.00	108,064,000	貸付有価証券 900株
東京建物	202,200	1,208.00	244,257,600	貸付有価証券 1,100株
ダイビル	49,400	988.00	48,807,200	貸付有価証券 3,400株
京阪神ビルディング	30,700	1,373.00	42,151,100	
住友不動産	431,500	2,881.00	1,243,151,500	貸付有価証券 4,400株
テーオーシー	37,700	685.00	25,824,500	
東京楽天地	3,100	4,480.00	13,888,000	貸付有価証券 1,500株
レオパレス21	251,500	210.00	52,815,000	貸付有価証券 85,600株（46,300株）
スターツコーポレーショ ン	26,100	2,184.00	57,002,400	
フジ住宅	22,300	524.00	11,685,200	

空港施設	19,200	426.00	8,179,200	
明和地所	10,500	420.00	4,410,000	
ゴールドクレスト	15,100	1,477.00	22,302,700	貸付有価証券 3,400株
エスリード	7,500	1,348.00	10,110,000	
日神グループホールディングス	28,400	367.00	10,422,800	
日本エスコン	34,700	818.00	28,384,600	貸付有価証券 8,100株（7,800株）
タカラレーベン	87,700	356.00	31,221,200	貸付有価証券 1,100株
AVANTIA	10,800	875.00	9,450,000	
イオンモール	96,200	1,390.00	133,718,000	貸付有価証券 33,600株
毎日コムネット	4,900	823.00	4,032,700	
ファースト住建	8,200	932.00	7,642,400	
カチタス	47,500	2,482.00	117,895,000	貸付有価証券 600株
トーセイ	26,400	1,109.00	29,277,600	
穴吹興産	4,200	1,615.00	6,783,000	貸付有価証券 2,000株
サンフロンティア不動産	26,500	819.00	21,703,500	
エフ・ジェー・ネクスト	16,700	863.00	14,412,100	貸付有価証券 1,000株
インテリックス	5,400	483.00	2,608,200	
ランドビジネス	6,500	344.00	2,236,000	
日本社宅サービス	5,900	1,154.00	6,808,600	
グランディハウス	14,900	373.00	5,557,700	
日本空港ビルデング	61,300	4,565.00	279,834,500	貸付有価証券 11,800株
日本工営	12,500	2,989.00	37,362,500	貸付有価証券 100株
LIFULL	64,900	417.00	27,063,300	貸付有価証券 500株
ジェイエイシーリクルートメント	12,500	1,153.00	14,412,500	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
日本M&Aセンター	140,500	4,905.00	689,152,500	貸付有価証券 5,700株
メンバーズ	5,500	1,449.00	7,969,500	貸付有価証券 100株

中広	2,600	563.00	1,463,800	
UTグループ	29,300	2,389.00	69,997,700	貸付有価証券 13,800株（4,900株）
アイティメディア	7,400	1,643.00	12,158,200	貸付有価証券 900株
タケエイ	17,800	1,068.00	19,010,400	
E・Jホールディングス	3,300	1,637.00	5,402,100	
ビーネックスグループ	23,300	937.00	21,832,100	貸付有価証券 300株
コシダカホールディングス	44,800	403.00	18,054,400	貸付有価証券 16,300株
アルトナー	4,500	909.00	4,090,500	
パソナグループ	20,200	1,162.00	23,472,400	
CDS	4,600	1,258.00	5,786,800	
リンクアンドモチベーション	41,000	384.00	15,744,000	貸付有価証券 18,900株（5,400株）
GCA	22,500	611.00	13,747,500	
エス・エム・エス	57,900	2,475.00	143,302,500	貸付有価証券 1,600株
サニーサイドアップグループ	6,400	767.00	4,908,800	貸付有価証券 3,000株（300株）
パーソルホールディングス	185,900	1,459.00	271,228,100	貸付有価証券 4,200株
リニカル	9,000	843.00	7,587,000	貸付有価証券 1,800株
クックパッド	64,900	319.00	20,703,100	
エスクリ	5,800	357.00	2,070,600	貸付有価証券 2,700株
アイ・ケイ・ケイ	9,100	600.00	5,460,000	貸付有価証券 100株
学情	6,600	1,199.00	7,913,400	貸付有価証券 1,700株
スタジオアリス	9,300	1,569.00	14,591,700	貸付有価証券 4,300株
シミックホールディングス	9,100	1,445.00	13,149,500	
エプコ	3,900	1,146.00	4,469,400	
NJS	4,100	1,732.00	7,101,200	
総合警備保障	74,000	4,940.00	365,560,000	貸付有価証券 600株
カカクコム	137,400	2,683.00	368,644,200	貸付有価証券

				1,100株
セントケア・ホールディング	12,000	411.00	4,932,000	貸付有価証券 6,600株
サイネックス	3,100	683.00	2,117,300	
ルネサンス	10,300	986.00	10,155,800	貸付有価証券 3,500株
ディップ	26,200	2,149.00	56,303,800	貸付有価証券 6,100株
オプトホールディング	10,100	1,404.00	14,180,400	貸付有価証券 1,100株
新日本科学	20,100	645.00	12,964,500	貸付有価証券 6,600株（2,500株）
ツクイ	43,800	497.00	21,768,600	
キャリアデザインセンター	4,300	950.00	4,085,000	
ベネフィット・ワン	67,700	2,198.00	148,804,600	貸付有価証券 4,900株
エムスリー	410,100	4,535.00	1,859,803,500	貸付有価証券 3,300株
ツカダ・グローバルホールディング	11,800	296.00	3,492,800	貸付有価証券 200株
プラス	2,400	552.00	1,324,800	
アウトソーシング	106,500	677.00	72,100,500	貸付有価証券 9,700株
ウェルネット	18,800	688.00	12,934,400	
ワールドホールディングス	6,400	1,692.00	10,828,800	貸付有価証券 400株（200株）
ディー・エヌ・エー	78,700	1,313.00	103,333,100	貸付有価証券 3,900株
博報堂DYホールディングス	258,700	1,239.00	320,529,300	貸付有価証券 200株
ぐるなび	32,400	715.00	23,166,000	貸付有価証券 100株
タカミヤ	19,700	544.00	10,716,800	
ジャパンベストレスキューシステム	14,700	870.00	12,789,000	貸付有価証券 2,100株
ファンコミュニケーションズ	51,100	446.00	22,790,600	貸付有価証券 200株
ライク	6,100	1,467.00	8,948,700	貸付有価証券 400株（200株）
ビジネス・ブレークス	7,800	387.00	3,018,600	

ルー				
エスプール	47,700	742.00	35,393,400	
W D Bホールディングス	8,500	2,650.00	22,525,000	貸付有価証券 800株
手間いらず	1,200	4,550.00	5,460,000	貸付有価証券 200株
ティア	10,800	523.00	5,648,400	
C D G	2,000	1,586.00	3,172,000	
バリューコマース	10,400	2,904.00	30,201,600	
インフォマート	203,800	773.00	157,537,400	貸付有価証券 13,300株
J Pホールディングス	58,400	280.00	16,352,000	
E P Sホールディングス	25,200	1,029.00	25,930,800	
レッグス	4,600	872.00	4,011,200	
プレステージ・インター ナショナル	69,600	808.00	56,236,800	
アミューズ	10,100	2,286.00	23,088,600	
ドリームインキュベータ	5,600	1,427.00	7,991,200	
クイック	11,500	1,140.00	13,110,000	
T A C	11,200	198.00	2,217,600	
ケネディクス	173,300	518.00	89,769,400	
電通グループ	191,700	2,445.00	468,706,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,100	624.00	4,430,400	
ぴあ	5,300	3,315.00	17,569,500	貸付有価証券 2,500株（1,400株）
イオンファンタジー	7,200	1,519.00	10,936,800	貸付有価証券 3,300株（3,000株）
シーティーエス	21,000	878.00	18,438,000	貸付有価証券 200株
ネクシィーズグループ	5,700	1,006.00	5,734,200	貸付有価証券 1,700株（1,700株）
みらかホールディングス	52,000	2,585.00	134,420,000	貸付有価証券 2,400株
アルプス技研	16,400	1,855.00	30,422,000	
ダイオーズ	3,700	1,024.00	3,788,800	貸付有価証券 2,100株
日本空調サービス	19,500	717.00	13,981,500	
オリエンタルランド	197,800	14,195.00	2,807,771,000	貸付有価証券 900株

ダスキン	46,200	2,740.00	126,588,000	
明光ネットワークジャパン	23,500	858.00	20,163,000	貸付有価証券 11,000株
ファルコホールディングス	10,200	1,583.00	16,146,600	
秀英予備校	4,100	420.00	1,722,000	貸付有価証券 100株
ラウンドワン	51,900	767.00	39,807,300	貸付有価証券 24,800株（1,900株）
リゾートトラスト	85,200	1,389.00	118,342,800	貸付有価証券 3,200株
ビー・エム・エル	23,900	2,875.00	68,712,500	
ワタベウェディング	3,000	308.00	924,000	
りらいあコミュニケーションズ	33,600	1,003.00	33,700,800	
リソー教育	84,900	327.00	27,762,300	貸付有価証券 4,400株
早稲田アカデミー	8,100	988.00	8,002,800	
ユー・エス・エス	208,200	1,732.00	360,602,400	
東京個別指導学院	6,600	526.00	3,471,600	貸付有価証券 100株
サイバーエージェント	114,600	5,250.00	601,650,000	貸付有価証券 11,100株（1,800株）
楽天	866,800	960.00	832,128,000	貸付有価証券 30,800株
クリーク・アンド・リバー社	9,700	1,040.00	10,088,000	貸付有価証券 300株
テー・オー・ダブリュー	29,600	365.00	10,804,000	貸付有価証券 14,100株
山田コンサルティンググループ	12,000	1,415.00	16,980,000	
セントラルスポーツ	6,900	2,302.00	15,883,800	貸付有価証券 3,100株
フルキャストホールディングス	18,600	1,415.00	26,319,000	
エン・ジャパン	33,000	2,667.00	88,011,000	貸付有価証券 2,300株
リソルホールディングス	2,000	3,525.00	7,050,000	
テクノプロ・ホールディングス	37,100	6,050.00	224,455,000	
アトラ	4,200	238.00	999,600	

インターワークス	3,600	373.00	1,342,800	
アイ・アールジャパン ホールディングス	7,500	11,840.00	88,800,000	貸付有価証券 3,500株
KeePer技研	6,800	1,528.00	10,390,400	
ファーストロジック	3,600	585.00	2,106,000	貸付有価証券 500株（300株）
三機サービス	3,600	977.00	3,517,200	
Gunosy	11,500	904.00	10,396,000	
デザインワン・ジャパン	5,500	277.00	1,523,500	
イー・ガーディアン	8,200	2,866.00	23,501,200	
リブセンス	11,900	299.00	3,558,100	貸付有価証券 100株
ジャパンマテリアル	57,200	1,687.00	96,496,400	
ベクトル	23,200	834.00	19,348,800	貸付有価証券 10,500株
ウチヤマホールディングス	9,100	320.00	2,912,000	
チャーム・ケア・コーポ レーション	15,800	834.00	13,177,200	
ライクキッズ	3,200	1,003.00	3,209,600	貸付有価証券 400株
キャリアリンク	6,100	573.00	3,495,300	貸付有価証券 2,800株
I B J	12,700	738.00	9,372,600	貸付有価証券 6,000株（2,000株）
アサンテ	7,500	1,486.00	11,145,000	
N・フィールド	12,800	540.00	6,912,000	
バリューHR	7,300	1,402.00	10,234,600	
M&Aキャピタルパート ナーズ	15,100	3,930.00	59,343,000	
ライドオンエクスプレス ホールディングス	7,100	2,501.00	17,757,100	
ERIホールディングス	5,200	661.00	3,437,200	
アビスト	2,900	2,679.00	7,769,100	
シグマクシス	12,700	1,677.00	21,297,900	
ウィルグループ	12,100	670.00	8,107,000	貸付有価証券 1,200株
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	25,700	193.00	4,960,100	貸付有価証券 3,400株
リクルートホールディン	1,332,300	3,656.00	4,870,888,800	貸付有価証券

グス				1,500株
エラン	11,000	1,891.00	20,801,000	貸付有価証券 500株
土木管理総合試験所	8,100	368.00	2,980,800	
ネットマーケティング	7,200	635.00	4,572,000	
日本郵政	1,524,300	758.10	1,155,571,830	貸付有価証券 1,600株
ベルシステム24ホールディングス	31,100	1,371.00	42,638,100	
鎌倉新書	14,000	1,138.00	15,932,000	貸付有価証券 6,100株（100株）
SMN	3,900	1,140.00	4,446,000	
一蔵	2,000	368.00	736,000	
LITALICO	6,400	2,423.00	15,507,200	貸付有価証券 600株（600株）
グローバルキッズCOMPANY	3,300	666.00	2,197,800	貸付有価証券 100株
エアトリ	9,700	1,213.00	11,766,100	貸付有価証券 4,600株
アトラエ	5,600	3,115.00	17,444,000	貸付有価証券 2,600株
ストライク	7,000	4,980.00	34,860,000	貸付有価証券 200株
ソラスト	51,300	1,028.00	52,736,400	貸付有価証券 600株
セラク	5,800	1,024.00	5,939,200	
インソース	7,700	2,542.00	19,573,400	貸付有価証券 3,400株（1,100株）
ベイカレント・コンサルティング	11,300	8,960.00	101,248,000	貸付有価証券 300株（300株）
Orchestra Holdings	3,900	1,606.00	6,263,400	
アイモバイル	6,600	746.00	4,923,600	貸付有価証券 3,100株（1,700株）
キャリアインデックス	7,600	401.00	3,047,600	貸付有価証券 3,000株（100株）
MS-Japan	6,000	783.00	4,698,000	貸付有価証券 300株（300株）
船場	3,000	950.00	2,850,000	
グレイステクノロジー	8,500	6,460.00	54,910,000	
ジャパニエレベーター	19,600	3,460.00	67,816,000	貸付有価証券

サービスホールディング				4,100株
フルテック	2,600	1,328.00	3,452,800	
グリーンズ	4,700	461.00	2,166,700	貸付有価証券 100株
ツナググループ・ホール ディングス	3,100	436.00	1,351,600	貸付有価証券 1,000株
GameW i t h	5,500	590.00	3,245,000	貸付有価証券 2,600株
ソウルドアウト	3,800	2,643.00	10,043,400	貸付有価証券 1,700株
MS&C o n s u l t i n g	3,500	525.00	1,837,500	
ミダック	2,400	1,795.00	4,308,000	
日総工産	12,400	638.00	7,911,200	貸付有価証券 200株
キュービーネットホール ディングス	7,700	2,010.00	15,477,000	
R P Aホールディングス	14,100	782.00	11,026,200	貸付有価証券 6,600株（3,500株）
スプリックス	5,200	762.00	3,962,400	貸付有価証券 100株
マネジメントソリュー ションズ	8,000	1,503.00	12,024,000	貸付有価証券 800株（300株）
プロレド・パートナーズ	2,500	4,840.00	12,100,000	
a n d f a c t o r y	1,800	995.00	1,791,000	貸付有価証券 800株
ギークス	1,900	1,285.00	2,441,500	貸付有価証券 800株（800株）
カーブスホールディング ス	51,000	583.00	29,733,000	貸付有価証券 21,900株（100株）
フォーラムエンジニアリ ング	9,700	826.00	8,012,200	
アドバンテッジリスクマ ネジメント	9,400	775.00	7,285,000	貸付有価証券 2,400株
リロググループ	101,700	1,976.00	200,959,200	
東祥	11,600	1,229.00	14,256,400	貸付有価証券 200株
エイチ・アイ・エス	29,000	1,540.00	44,660,000	貸付有価証券 13,200株（3,900株）
ラックランド	4,300	2,153.00	9,257,900	貸付有価証券 2,000株
共立メンテナンス	30,800	3,595.00	110,726,000	貸付有価証券

				11,800株
イチネンホールディングス	20,800	1,204.00	25,043,200	
建設技術研究所	12,800	1,731.00	22,156,800	
スペース	12,100	946.00	11,446,600	貸付有価証券 1,300株
長大	7,400	1,048.00	7,755,200	
燦ホールディングス	8,100	1,214.00	9,833,400	
スバル興業	1,100	8,100.00	8,910,000	
東京テアトル	7,300	1,244.00	9,081,200	
タナベ経営	3,600	1,278.00	4,600,800	
ナガワ	5,900	7,820.00	46,138,000	貸付有価証券 100株
よみうりランド	4,000	3,550.00	14,200,000	貸付有価証券 100株
東京都競馬	12,200	3,625.00	44,225,000	
常磐興産	7,500	1,507.00	11,302,500	
カナモト	30,400	2,316.00	70,406,400	貸付有価証券 2,800株
東京ドーム	75,300	778.00	58,583,400	貸付有価証券 32,100株
西尾レントオール	17,200	2,193.00	37,719,600	
トランス・コスモス	17,700	2,541.00	44,975,700	貸付有価証券 600株
乃村工藝社	79,700	891.00	71,012,700	貸付有価証券 100株
藤田観光	8,100	1,682.00	13,624,200	貸付有価証券 3,800株
KNT-CTホールディングス	11,600	994.00	11,530,400	貸付有価証券 5,400株
日本管財	19,900	1,968.00	39,163,200	
トーカイ	18,000	2,388.00	42,984,000	
白洋舎	2,100	2,888.00	6,064,800	貸付有価証券 900株
セコム	197,400	9,151.00	1,806,407,400	貸付有価証券 1,100株
セントラル警備保障	9,000	4,170.00	37,530,000	
丹青社	35,100	741.00	26,009,100	
メイテック	22,800	5,210.00	118,788,000	貸付有価証券 100株

	応用地質	20,000	1,375.00	27,500,000	
	船井総研ホールディングス	38,400	2,410.00	92,544,000	
	進学会ホールディングス	7,300	512.00	3,737,600	
	オオバ	13,200	615.00	8,118,000	貸付有価証券 100株（100株）
	いであ	4,500	1,909.00	8,590,500	
	学究社	5,400	1,087.00	5,869,800	
	ベネッセホールディングス	61,900	2,901.00	179,571,900	
	イオンディライト	22,900	3,005.00	68,814,500	
	ナック	10,300	914.00	9,414,200	貸付有価証券 2,600株
	ニチイ学館	26,500	1,657.00	43,910,500	貸付有価証券 4,600株
	ダイセキ	31,200	2,814.00	87,796,800	貸付有価証券 400株
	ステップ	6,800	1,540.00	10,472,000	
	小計 銘柄数：2,149 組入時価比率：97.8%			422,857,718,850 100.0%	
	合計			422,857,718,850	

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

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

(2)株式以外の有価証券(2020年6月29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	2020年 6月29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	9,759,362,500	—	9,529,280,000	△230,386,430
合計	9,759,362,500	—	9,529,280,000	△230,386,430

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2020年 6月29日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	3,807,437,458
コール・ローン	642,872,504
株式	620,298,763,912
投資証券	15,895,560,395
派生商品評価勘定	1,721,909
未収入金	14,228,196
未収配当金	582,737,548
差入委託証拠金	3,478,136,294
流動資産合計	644,721,458,216
資産合計	644,721,458,216
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	112,519,644
未払金	203,108,270
未払解約金	414,938,503
未払利息	683
その他未払費用	4,384,500
流動負債合計	734,951,600
負債合計	734,951,600
純資産の部	
元本等	
元本	232,611,634,156
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	411,374,872,460
元本等合計	643,986,506,616
純資産合計	643,986,506,616
負債純資産合計	644,721,458,216

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2020年 6月29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	2.7685円
(10,000口当たり純資産額)	(27,685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 2019年 6月29日 至 2020年 6月29日	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

○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

2020年 6月29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

2020年 6月29日現在	
期首	2019年 6月29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	208,953,434,339円
同期中における追加設定元本額	60,104,066,103円
同期中における一部解約元本額	36,445,866,286円
期末元本額	232,611,634,156円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト30	47,177,554円
バランスセレクト50	140,644,298円
バランスセレクト70	152,228,214円

野村外国株式インデックスファンド	517,465,181円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	4,653,071,579円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	6,101,347,236円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	4,489,229,866円
野村資産設計ファンド２０１５	16,136,271円
野村資産設計ファンド２０２０	15,904,643円
野村資産設計ファンド２０２５	30,294,342円
野村資産設計ファンド２０３０	37,344,259円
野村資産設計ファンド２０３５	29,117,766円
野村資産設計ファンド２０４０	60,093,992円
野村外国株インデックス Ｂコース（野村投資一任口座向け）	35,913,324,988円
のむラップ・ファンド（保守型）	1,037,611,878円
のむラップ・ファンド（普通型）	8,157,050,880円
のむラップ・ファンド（積極型）	5,892,870,970円
野村資産設計ファンド２０４５	9,155,884円
野村インデックスファンド・外国株式	5,408,092,791円
マイ・ロード	1,355,195,966円
ネクストコア	11,707,262円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	129,367,573円
野村外国株インデックスＢコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	1,314,163,100円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	354,386,162円
野村資産設計ファンド２０５０	14,975,485円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	4,967,845円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	2,322,367円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	1,836,938円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	1,166,841円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	198,270,024円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	474,611,459円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	2,746,458円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	3,431,126円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	22,208,634円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	8,423,895円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	30,375,897円
野村６資産均等バランス	751,304,042円
野村つみたて外国株投信	5,055,620,996円
野村外国株（含む新興国）インデックス Ｂコース（野村投資一任口座向け）	3,680,337,039円
世界６資産分散ファンド	66,163,541円
野村資産設計ファンド２０６０	5,544,788円
野村スリーゼロ先進国株式投信	14,615,342円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI 指数（為替ヘッジなし）連動型上場投信	507,315,435円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	1,170,680,373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）	243,837,034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）	172,107,396円
グローバル・インデックス・バランス４０ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,127,598,437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）	2,154,176,743円
ワールド・インデックス・ファンドＶＡ安定型（適格機関投資家専用）	2,375,920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）	6,658,552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）	1,772,579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）	2,669,931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）	41,780,856円
野村外国株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	13,770,497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）	14,207,472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）	40,169,972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）	151,914,666円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	2,992,873,701円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	44,948,890円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）	117,502,076円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国株式（適格機関投資家専用）	686,620,608円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）	15,999,115,648円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	173,891円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	2,123,889円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	11,404,205円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	11,812,192円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI（確定拠出年金向け）	70,194,668,628円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	2,882,997,811円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	9,836,418,710円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	8,737,013,790円
マイバランスDC30	954,054,559円
マイバランスDC50	1,993,489,882円
マイバランスDC70	1,561,357,654円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	23,446,570,742円
野村DC運用戦略ファンド	173,609,662円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	13,140,801円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	310,112,234円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	258,816,538円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	209,593,210円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	12,556,060円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	6,207,879円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	26,533,571円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	3,717,760円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	2,753,866円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	2,612,352円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	107,446,115円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	73,686,360円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	34,141,828円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	39,409,700円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,208,109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(2020年6月29日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES CO	101,000	14.70	1,484,700.00	
		HALLIBURTON CO	135,000	11.93	1,610,550.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	58,000	12.19	707,020.00	
		SCHLUMBERGER LTD	216,000	17.44	3,767,040.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	64,000	16.57	1,060,480.00	
		CHENIERE ENERGY INC	36,400	44.98	1,637,272.00	
		CHEVRON CORP	295,800	86.46	25,574,868.00	
		CONCHO RESOURCES INC	31,000	50.30	1,559,300.00	
		CONOCOPHILLIPS	171,600	40.35	6,924,060.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	23,100	41.13	950,103.00	
		EOG RESOURCES INC	90,700	48.76	4,422,532.00	
		EXXON MOBIL CORP	669,000	43.62	29,181,780.00	
		HESS CORP	43,200	48.48	2,094,336.00	
		HOLLYFRONTIER CORP	23,600	28.21	665,756.00	
		KINDER MORGAN INC	326,000	14.47	4,717,220.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	100,800	35.37	3,565,296.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	142,000	17.69	2,511,980.00	
		ONEOK INC	67,000	30.81	2,064,270.00	
		PHILLIPS 66	70,300	68.07	4,785,321.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	26,100	94.11	2,456,271.00	
		VALERO ENERGY CORP	65,900	56.32	3,711,488.00	
		WILLIAMS COS	191,000	18.51	3,535,410.00	
		AIR PRODUCTS	34,600	236.02	8,166,292.00	
		ALBEMARLE CORP	16,700	74.64	1,246,488.00	
		AXALTA COATING SYSTEMS LTD	36,000	21.43	771,480.00	
		CELANESE CORP-SERIES A	19,600	82.78	1,622,488.00	
		CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	35,300	27.45	968,985.00	
		CORTEVA INC	120,000	25.92	3,110,400.00	
		DOW INC	115,600	39.80	4,600,880.00	
		DUPONT DE NEMOURS INC	115,500	51.42	5,939,010.00	

EASTMAN CHEMICAL CO.	20,800	67.28	1,399,424.00	
ECOLAB INC	40,500	191.75	7,765,875.00	
FMC CORP	21,100	96.56	2,037,416.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	13,600	119.05	1,619,080.00	
LINDE PLC	83,900	206.82	17,352,198.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	42,100	63.37	2,667,877.00	
MOSAIC CO/THE	56,000	12.08	676,480.00	
PPG INDUSTRIES	36,800	102.14	3,758,752.00	
RPM INTERNATIONAL INC	21,100	71.50	1,508,650.00	
SHERWIN-WILLIAMS	13,220	557.53	7,370,546.60	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	9,700	202.79	1,967,063.00	
VULCAN MATERIALS CO	20,800	112.80	2,346,240.00	
AMCOR PLC	250,000	9.67	2,417,500.00	
AVERY DENNISON CORP	13,400	109.83	1,471,722.00	
BALL CORP	49,800	67.34	3,353,532.00	
CROWN HOLDINGS INC	21,200	63.70	1,350,440.00	
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	59,800	33.80	2,021,240.00	
PACKAGING CORP OP AMERICA	14,500	95.68	1,387,360.00	
SEALED AIR CORP	26,500	31.19	826,535.00	
WESTROCK CO	38,700	26.72	1,034,064.00	
FREEMONT-MCMORAN INC	225,000	10.79	2,427,750.00	
NEWMONT CORP	128,100	59.34	7,601,454.00	
NUCOR CORP	46,700	40.60	1,896,020.00	
STEEL DYNAMICS	33,400	25.42	849,028.00	
BOEING CO	84,700	170.01	14,399,847.00	
GENERAL DYNAMICS	39,200	146.05	5,725,160.00	
HEICO CORP	6,300	95.15	599,445.00	
HEICO CORP-CLASS A	12,400	78.65	975,260.00	
HOWMET AEROSPACE INC	57,000	15.42	878,940.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	6,500	170.96	1,111,240.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	35,200	169.61	5,970,272.00	
LOCKHEED MARTIN	40,230	356.76	14,352,454.80	
NORTHROP GRUMMAN CORP	25,210	301.86	7,609,890.60	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	238,900	59.10	14,118,990.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,770	299.18	1,726,268.60	

TEXTRON INC	37,900	31.86	1,207,494.00
TRANSDIGM GROUP INC	8,090	421.09	3,406,618.10
ALLEGION PLC	14,800	97.05	1,436,340.00
CARRIER GLOBAL CORP	130,000	20.97	2,726,100.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	21,600	60.60	1,308,960.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	118,700	33.36	3,959,832.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,700	225.33	1,284,381.00
MASCO CORP	42,500	48.30	2,052,750.00
OWENS CORNING INC	16,800	54.12	909,216.00
SMITH (A.O.) CORP	21,800	44.45	969,010.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	37,600	84.64	3,182,464.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	21,600	82.50	1,782,000.00
AMETEK INC	35,500	85.79	3,045,545.00
EATON CORP PLC	64,600	85.50	5,523,300.00
EMERSON ELEC	97,300	59.87	5,825,351.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	18,700	205.27	3,838,549.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	24,500	35.74	875,630.00
3M CORP	91,200	152.52	13,909,824.00
GENERAL ELEC CO	1,385,000	6.48	8,974,800.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	112,000	138.21	15,479,520.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	35,400	42.10	1,490,340.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	33,300	21.41	712,953.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	16,840	387.21	6,520,616.40
CATERPILLAR INC DEL	87,100	122.39	10,660,169.00
CUMMINS INC	23,500	168.75	3,965,625.00
DEERE & COMPANY	47,100	149.04	7,019,784.00
DOVER CORP	22,900	92.64	2,121,456.00
FORTIVE CORP	47,600	66.37	3,159,212.00
IDEX CORP	12,300	154.76	1,903,548.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	49,900	167.82	8,374,218.00
INGERSOLL-RAND INC	58,000	27.23	1,579,340.00
NORDSON CORP	8,700	180.37	1,569,219.00
OTIS WORLDWIDE CORP	65,000	55.79	3,626,350.00
PACCAR	53,800	72.44	3,897,272.00

PARKER HANNIFIN CORP	20,100	172.54	3,468,054.00	
PENTAIR PLC	23,200	35.80	830,560.00	
SNAP-ON INC	8,400	133.56	1,121,904.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	23,900	136.27	3,256,853.00	
WABTEC CORP	28,800	55.85	1,608,480.00	
XYLEM INC	27,800	63.16	1,755,848.00	
AERCAP HOLDINGS NV	21,000	28.79	604,590.00	
FASTENAL CO	92,100	40.99	3,775,179.00	
GRAINGER(W.W.) INC	7,480	293.12	2,192,537.60	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	26,800	33.06	886,008.00	
UNITED RENTALS INC	11,300	140.40	1,586,520.00	
CINTAS CORP	14,200	256.50	3,642,300.00	
COPART INC	33,700	79.62	2,683,194.00	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	35,900	80.52	2,890,668.00	
ROLLINS INC	23,900	41.29	986,831.00	
WASTE CONNECTIONS INC	42,300	90.61	3,832,803.00	
WASTE MANAGEMENT INC	66,800	102.81	6,867,708.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	22,100	76.66	1,694,186.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	27,300	73.54	2,007,642.00	
FEDEX CORPORATION	39,100	130.08	5,086,128.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	111,200	107.32	11,933,984.00	
XPO LOGISTICS INC	14,300	72.96	1,043,328.00	
DELTA AIR LINES INC	25,200	26.91	678,132.00	
SOUTHWEST AIRLINES	19,800	31.96	632,808.00	
AMERCO	1,170	295.44	345,664.80	
CSX CORP	122,800	65.91	8,093,748.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	13,200	119.30	1,574,760.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	14,800	145.71	2,156,508.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	20,800	41.35	860,080.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	40,300	169.81	6,843,343.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	15,300	163.00	2,493,900.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	150,800	29.61	4,465,188.00	
UNION PAC CORP	108,500	162.64	17,646,440.00	
APTIV PLC	41,500	74.13	3,076,395.00	

AUTOLIV INC	11,900	62.56	744,464.00	
BORGWARNER INC	35,000	33.23	1,163,050.00	
LEAR CORP	8,400	104.55	878,220.00	
FORD MOTOR COMPANY	607,000	5.91	3,587,370.00	
GENERAL MOTORS CO	205,000	24.46	5,014,300.00	
TESLA INC	23,200	959.74	22,265,968.00	
DR HORTON INC	53,800	53.03	2,853,014.00	
GARMIN LTD	22,700	94.86	2,153,322.00	
LENNAR CORP-A	43,000	59.00	2,537,000.00	
MOHAWK INDUSTRIES	10,200	95.71	976,242.00	
NEWELL BRANDS INC	66,000	15.05	993,300.00	
NVR INC	559	3,167.64	1,770,710.76	
PULTEGROUP INC	43,000	31.93	1,372,990.00	
WHIRLPOOL CORP	9,400	122.80	1,154,320.00	
HASBRO INC	21,400	70.61	1,511,054.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	19,600	289.53	5,674,788.00	
NIKE INC-B	196,800	93.67	18,434,256.00	
RALPH LAUREN CORPORATION	7,800	67.70	528,060.00	
V F CORP	52,000	57.14	2,971,280.00	
ARAMARK	34,000	21.54	732,360.00	
CARNIVAL CORP	72,000	15.78	1,136,160.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,120	1,033.15	4,256,578.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	19,800	72.95	1,444,410.00	
DOMINOS PIZZA INC	6,280	365.81	2,297,286.80	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	43,400	71.16	3,088,344.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	53,800	43.33	2,331,154.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	42,900	80.94	3,472,326.00	
MCDONALD'S CORP	117,300	179.74	21,083,502.00	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	15.15	515,100.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	71,000	15.72	1,116,120.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	26,600	46.41	1,234,506.00	
STARBUCKS CORP	184,400	71.57	13,197,508.00	
VAIL RESORTS INC	6,000	176.19	1,057,140.00	
WYNN RESORTS LTD	15,500	69.05	1,070,275.00	
YUM BRANDS INC	46,800	84.79	3,968,172.00	

GENUINE PARTS CO	23,200	83.66	1,940,912.00	
LKQ CORP	44,000	24.77	1,089,880.00	
AMAZON.COM INC	66,720	2,692.87	179,668,286.40	
BOOKING HOLDINGS INC	6,520	1,541.25	10,048,950.00	
EBAY INC	124,500	50.89	6,335,805.00	
EXPEDIA GROUP INC	20,500	77.59	1,590,595.00	
MERCADOLIBRE INC	6,980	973.17	6,792,726.60	
WAYFAIR INC - CLASS A	10,600	201.94	2,140,564.00	
DOLLAR GENERAL CORP	39,800	189.39	7,537,722.00	
DOLLAR TREE INC	37,600	92.62	3,482,512.00	
TARGET CORP	80,500	117.02	9,420,110.00	
ADVANCE AUTO PARTS	10,900	139.99	1,525,891.00	
AUTOZONE	3,670	1,104.93	4,055,093.10	
BEST BUY COMPANY INC	36,000	84.80	3,052,800.00	
BURLINGTON STORES INC	10,500	194.43	2,041,515.00	
CARMAX INC	26,100	86.58	2,259,738.00	
HOME DEPOT	171,800	241.01	41,405,518.00	
LOWES COS INC	121,100	129.41	15,671,551.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	11,970	415.47	4,973,175.90	
ROSS STORES INC	56,000	83.75	4,690,000.00	
TIFFANY & CO	16,900	119.57	2,020,733.00	
TJX COS INC	190,300	49.54	9,427,462.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	18,000	129.98	2,339,640.00	
ULTA BEAUTY INC	8,600	189.99	1,633,914.00	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	69,810	296.56	20,702,853.60	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,000	4.53	203,850.00	
KROGER CO	126,900	32.68	4,147,092.00	
SYSCO CORP	75,800	52.30	3,964,340.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	120,900	41.17	4,977,453.00	
WALMART INC	223,200	118.32	26,409,024.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	50,000	61.00	3,050,000.00	
COCA COLA CO	641,600	43.57	27,954,512.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	32,600	37.27	1,215,002.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	26,800	168.99	4,528,932.00	
KEURIG DR PEPPER INC	56,000	28.22	1,580,320.00	

MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	31,400	34.43	1,081,102.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	63,800	67.90	4,332,020.00	
PEPSICO INC	218,700	128.93	28,196,991.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	88,400	38.93	3,441,412.00	
BUNGE LIMITED	22,000	40.22	884,840.00	
CAMPBELL SOUP CO	27,400	48.40	1,326,160.00	
CONAGRA BRANDS INC	76,900	32.64	2,510,016.00	
GENERAL MILLS	94,400	59.21	5,589,424.00	
HERSHEY CO/THE	23,500	125.85	2,957,475.00	
HORMEL FOODS CORP	45,600	48.21	2,198,376.00	
INGREDION INC	11,200	79.86	894,432.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,600	103.01	1,915,986.00	
KELLOGG CO	40,000	63.86	2,554,400.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	108,800	30.90	3,361,920.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	23,900	62.53	1,494,467.00	
MCCORMICK & CO INC.	19,900	176.25	3,507,375.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	224,800	50.08	11,257,984.00	
TYSON FOODS INC-CL A	46,900	58.28	2,733,332.00	
ALTRIA GROUP INC	294,500	38.19	11,246,955.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	245,700	68.87	16,921,359.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	39,500	76.15	3,007,925.00	
CLOROX CO	20,100	215.30	4,327,530.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	129,300	71.52	9,247,536.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	54,500	136.89	7,460,505.00	
PROCTER & GAMBLE CO	389,000	115.23	44,824,470.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	35,400	184.14	6,518,556.00	
ABBOTT LABORATORIES	277,500	88.71	24,617,025.00	
ABIOMED INC	7,200	239.27	1,722,744.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	11,800	263.14	3,105,052.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	81,000	84.31	6,829,110.00	
BECTON,DICKINSON	42,900	233.57	10,020,153.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	218,600	33.28	7,275,008.00	
DANAHER CORP	99,200	171.71	17,033,632.00	
DENTSPLY SIRONA INC	35,200	43.12	1,517,824.00	
DEXCOM INC	14,480	383.06	5,546,708.80	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	99,600	67.13	6,686,148.00	
HOLOGIC INC	43,300	53.52	2,317,416.00	
IDEXX LABORATORIES INC	13,600	324.86	4,418,096.00	
INSULET CORP	9,800	187.20	1,834,560.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	18,200	549.85	10,007,270.00	
MASIMO CORP	8,200	217.50	1,783,500.00	
MEDTRONIC PLC	211,800	88.77	18,801,486.00	
RESMED INC	22,500	185.63	4,176,675.00	
STERIS PLC	13,800	148.33	2,046,954.00	
STRYKER CORP	53,100	173.76	9,226,656.00	
TELEFLEX INC	7,530	355.87	2,679,701.10	
THE COOPER COMPANIES, INC.	8,070	272.98	2,202,948.60	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	14,200	116.72	1,657,424.00	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	11,800	222.45	2,624,910.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	33,200	115.43	3,832,276.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	23,900	99.18	2,370,402.00	
ANTHEM INC	39,600	255.65	10,123,740.00	
CARDINAL HEALTH INC	47,200	50.55	2,385,960.00	
CENTENE CORP	92,100	59.75	5,502,975.00	
CIGNA CORP	59,200	185.06	10,955,552.00	
CVS HEALTH CORP	206,200	63.45	13,083,390.00	
DAVITA INC	14,800	75.56	1,118,288.00	
HCA HEALTHCARE INC	42,200	92.48	3,902,656.00	
HENRY SCHEIN INC	23,100	56.67	1,309,077.00	
HUMANA INC	21,070	374.64	7,893,664.80	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15,800	161.96	2,558,968.00	
MCKESSON CORP	25,600	148.21	3,794,176.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	9,700	169.09	1,640,173.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	20,500	110.22	2,259,510.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	149,400	286.88	42,859,872.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	13,200	89.34	1,179,288.00	
ABBVIE INC	278,718	96.13	26,793,161.34	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	34,400	113.61	3,908,184.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	17,500	151.90	2,658,250.00	
AMGEN INC	92,800	232.84	21,607,552.00	

BEIGENE, LTD ADR	6,300	195.41	1,231,083.00
BIOGEN INC	27,620	258.66	7,144,189.20
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	28,000	124.02	3,472,560.00
EXACT SCIENCES CORP	22,600	80.96	1,829,696.00
GILEAD SCIENCES INC	200,400	74.57	14,943,828.00
INCYTE CORP	28,500	101.43	2,890,755.00
IONIS PHARMACEUTICALS INC	21,400	60.09	1,285,926.00
MODERNA INC	43,200	61.28	2,647,296.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,200	130.36	1,851,112.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	16,010	611.36	9,787,873.60
SAREPTA THERAPEUTICS INC	11,300	162.63	1,837,719.00
SEATTLE GENETICS INC	18,700	165.59	3,096,533.00
VERTEX PHARMACEUTICALS	41,100	286.14	11,760,354.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	355,100	57.54	20,432,454.00
CATALENT INC	24,800	73.06	1,811,888.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	60,000	21.16	1,269,600.00
ELI LILLY & CO.	135,300	162.83	22,030,899.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	9,000	107.94	971,460.00
JOHNSON & JOHNSON	415,200	137.81	57,218,712.00
MERCK & CO INC	399,300	75.19	30,023,367.00
MYLAN NV	86,000	15.89	1,366,540.00
PERRIGO CO PLC	19,600	53.94	1,057,224.00
PFIZER INC	875,200	32.04	28,041,408.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	179,000	12.19	2,182,010.00
ZOETIS INC	75,600	132.66	10,029,096.00
BANK OF AMERICA CORP	1,237,000	23.15	28,636,550.00
CITIGROUP	331,200	49.58	16,420,896.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	70,000	23.16	1,621,200.00
COMERICA INC	23,000	35.37	813,510.00
EAST WEST BANCORP INC	20,700	33.81	699,867.00
FIFTH THIRD BANCORP	112,000	18.76	2,101,120.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	27,100	103.82	2,813,522.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	169,000	8.80	1,487,200.00
JPMORGAN CHASE & CO	484,300	92.59	44,841,337.00
KEYCORP	158,000	11.76	1,858,080.00

M & T BANK CORP	20,000	100.46	2,009,200.00	
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	71,000	10.83	768,930.00	
PNC FINANCIAL	68,700	100.93	6,933,891.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	150,000	10.65	1,597,500.00	
SIGNATURE BANK	8,900	102.63	913,407.00	
SVB FINANCIAL GROUP	8,100	203.86	1,651,266.00	
TRUIST FINANCIAL CORP	213,300	35.95	7,668,135.00	
US BANCORP	217,400	36.06	7,839,444.00	
WELLS FARGO CO	612,400	25.34	15,518,216.00	
ZIONS BANCORP NA	27,500	32.29	887,975.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	218,300	175.37	38,283,271.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	62,000	18.99	1,177,380.00	
VOYA FINANCIAL INC	21,700	45.21	981,057.00	
AFLAC INC	108,900	34.68	3,776,652.00	
ALLEGHANY CORP	2,300	475.90	1,094,570.00	
ALLSTATE CORP	50,300	94.58	4,757,374.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,500	58.73	734,125.00	
AMERICAN INTL GROUP	137,800	29.71	4,094,038.00	
AON PLC	36,900	190.02	7,011,738.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	63,900	27.70	1,770,030.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	29,700	96.67	2,871,099.00	
ASSURANT INC	9,000	99.21	892,890.00	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,200	30.06	637,272.00	
BROWN & BROWN INC	38,800	40.08	1,555,104.00	
CHUBB LTD	70,800	123.96	8,776,368.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	24,600	62.00	1,525,200.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	3,700	186.05	688,403.50	
EVEREST RE GROUP LTD	6,200	200.87	1,245,394.00	
FNF GROUP	45,400	30.16	1,369,264.00	
GLOBE LIFE INC	15,700	70.85	1,112,345.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	58,300	37.44	2,182,752.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	29,900	34.65	1,036,035.00	
LOEWS CORP	43,300	32.81	1,420,673.00	
MARKEL CORP	2,130	882.33	1,879,362.90	
MARSH & MCLENNAN COS	78,900	104.75	8,264,775.00	

METLIFE INC	125,000	35.07	4,383,750.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	44,400	39.14	1,737,816.00	
PROGRESSIVE CO	91,500	77.89	7,126,935.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	63,000	58.10	3,660,300.00	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	10,500	74.98	787,290.00	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	6,700	167.50	1,122,250.00	
TRAVELERS COS INC/THE	40,800	111.00	4,528,800.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	20,200	194.55	3,929,910.00	
WR BERKLEY CORP	24,100	55.41	1,335,381.00	
ACCENTURE PLC-CL A	100,300	212.47	21,310,741.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	25,800	105.37	2,718,546.00	
AUTOMATIC DATA PROCESS	67,700	144.72	9,797,544.00	
BLACK KNIGHT INC	24,200	72.62	1,757,404.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	22,600	74.39	1,681,214.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	17,900	124.64	2,231,056.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	86,600	55.21	4,781,186.00	
EPAM SYSTEMS INC	8,400	244.38	2,052,792.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	97,400	130.51	12,711,674.00	
FISERV INC	90,600	94.92	8,599,752.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	13,800	238.52	3,291,576.00	
GARTNER INC	14,100	117.85	1,661,685.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	47,300	162.92	7,706,116.00	
GODADDY INC - CLASS A	26,900	71.56	1,924,964.00	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	140,300	117.19	16,441,757.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	12,500	178.49	2,231,125.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	21,500	89.78	1,930,270.00	
MASTERCARD INC	140,900	289.34	40,768,006.00	
MONGODB INC	7,400	224.51	1,661,374.00	
OKTA INC	18,000	203.49	3,662,820.00	
PAYCHEX INC	50,500	71.79	3,625,395.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	176,200	170.87	30,107,294.00	
SQUARE INC - A	55,700	104.30	5,809,510.00	
TWILIO INC - A	18,600	221.15	4,113,390.00	
VERISIGN INC	16,200	203.64	3,298,968.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	268,800	189.27	50,875,776.00	

WESTERN UNION CO	66,000	21.11	1,393,260.00	
WIX.COM LTD	7,700	251.83	1,939,091.00	
ADOBE INC	75,890	426.92	32,398,958.80	
ANSYS INC	13,400	283.08	3,793,272.00	
AUTODESK INC.	35,000	232.74	8,145,900.00	
AVALARA INC	11,800	134.14	1,582,852.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	44,600	93.84	4,185,264.00	
CDK GLOBAL INC	20,000	40.20	804,000.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	18,900	105.90	2,001,510.00	
CITRIX SYSTEMS INC	18,400	142.77	2,626,968.00	
COUPA SOFTWARE INC	10,600	275.70	2,922,420.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,400	98.79	1,620,156.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	5,500	95.15	523,325.00	
DATADOG INC - CLASS A	16,700	84.50	1,411,150.00	
DOCUSIGN INC	27,100	177.58	4,812,418.00	
DROPBOX INC-CLASS A	39,000	21.47	837,330.00	
DYNATRACE INC	20,100	41.40	832,140.00	
FAIR ISAAC CORP	4,630	406.20	1,880,706.00	
FORTINET INC	22,800	134.55	3,067,740.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	13,600	110.64	1,504,704.00	
INTUIT INC	41,300	286.52	11,833,276.00	
MICROSOFT CORP	1,139,400	196.33	223,698,402.00	
NORTONLIFELOCK INC	91,000	19.12	1,739,920.00	
ORACLE CORPORATION	353,000	54.18	19,125,540.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	15,200	225.39	3,425,928.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,100	306.37	2,481,597.00	
PTC INC	17,000	75.53	1,284,010.00	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	11,200	289.29	3,240,048.00	
SALESFORCE.COM INC	132,600	183.17	24,288,342.00	
SERVICENOW INC	30,120	399.97	12,047,096.40	
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	48,800	32.53	1,587,464.00	
SPLUNK INC	24,800	196.80	4,880,640.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	36,700	54.26	1,991,342.00	
SYNOPSYS INC	23,900	190.42	4,551,038.00	

TRADE DESK INC/THE -CLASS A	6,480	407.03	2,637,554.40	
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,100	340.79	2,078,819.00	
VMWARE INC - CLASS A	13,000	146.50	1,904,500.00	
WORKDAY INC-CLASS A	26,500	187.48	4,968,220.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,200	256.80	4,416,960.00	
ARISTA NETWORKS INC	8,700	210.63	1,832,481.00	
CISCO SYSTEMS	670,800	46.31	31,064,748.00	
F5 NETWORKS INC	9,300	140.12	1,303,116.00	
JUNIPER NETWORKS INC	53,000	22.17	1,175,010.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	26,800	138.78	3,719,304.00	
APPLE INC	689,980	353.63	243,997,627.40	
DELL TECHNOLOGIES-C	38,300	52.25	2,001,175.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	202,000	9.50	1,919,000.00	
HP INC	223,000	16.61	3,704,030.00	
NETAPP INC	35,200	43.99	1,548,448.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	37,300	46.97	1,751,981.00	
WESTERN DIGITAL CORP	47,600	40.87	1,945,412.00	
AMPHENOL CORP-CL A	46,400	93.97	4,360,208.00	
ARROW ELECTRS INC	12,100	65.16	788,436.00	
CDW CORPORATION	22,400	108.49	2,430,176.00	
COGNEX CORP	27,800	58.64	1,630,192.00	
CORNING INC	119,000	25.41	3,023,790.00	
FLIR SYSTEMS INC	20,700	39.07	808,749.00	
IPG PHOTONICS CORP	5,900	155.22	915,798.00	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	30,400	97.56	2,965,824.00	
TE CONNECTIVITY LTD	52,400	78.68	4,122,832.00	
TRIMBLE INC	38,800	42.37	1,643,956.00	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	8,400	246.42	2,069,928.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	185,600	50.10	9,298,560.00	
ANALOG DEVICES INC	58,100	117.87	6,848,247.00	
APPLIED MATERIALS	143,800	58.38	8,395,044.00	
BROADCOM INC	62,810	307.41	19,308,422.10	
INTEL CORP	673,600	57.50	38,732,000.00	
KLA CORP	24,400	189.57	4,625,508.00	
LAM RESEARCH	23,100	302.52	6,988,212.00	

MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	106,400	33.23	3,535,672.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	42,400	59.20	2,510,080.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	37,300	100.05	3,731,865.00	
MICRON TECHNOLOGY	174,000	48.49	8,437,260.00	
NVIDIA CORP	96,360	366.20	35,287,032.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	44,700	108.15	4,834,305.00	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	69,000	19.09	1,317,210.00	
QORVO INC	17,700	107.37	1,900,449.00	
QUALCOMM INC	181,000	88.02	15,931,620.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	27,200	125.85	3,423,120.00	
TERADYNE INC	27,400	81.85	2,242,690.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	146,800	123.37	18,110,716.00	
XILINX INC	39,900	91.02	3,631,698.00	
AT & T INC	1,129,500	29.08	32,845,860.00	
CENTURYLINK INC	147,000	9.51	1,397,970.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	651,300	53.16	34,623,108.00	
T-MOBILE US INC	85,830	105.20	9,029,316.00	
T-MOBILE US INC-RIGHTS	67,830	0.26	17,635.80	
ALLIANT ENERGY CORP	37,600	47.05	1,769,080.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	77,200	78.00	6,021,600.00	
DUKE ENERGY CORP	116,300	78.93	9,179,559.00	
EDISON INTERNATIONAL	58,000	54.82	3,179,560.00	
ENTERGY CORP	31,300	91.66	2,868,958.00	
EVERGY INC	35,900	58.11	2,086,149.00	
EVERSOURCE ENERGY	52,100	81.85	4,264,385.00	
EXELON CORPORATION	154,800	34.71	5,373,108.00	
FIRSTENERGY CORP	86,600	36.85	3,191,210.00	
NEXTERA ENERGY INC	77,200	236.22	18,236,184.00	
NRG ENERGY INC	40,500	31.57	1,278,585.00	
OGE ENERGY CORP	32,500	29.37	954,525.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	17,000	71.05	1,207,850.00	
PPL CORPORATION	121,800	25.07	3,053,526.00	
SOUTHERN CO.	165,200	50.92	8,411,984.00	
XCEL ENERGY INC	83,600	62.31	5,209,116.00	
ATMOS ENERGY CORP	18,400	97.46	1,793,264.00	

UGI CORP	30,900	30.52	943,068.00
AMEREN CORPORATION	39,100	68.90	2,693,990.00
CENTERPOINT ENERGY INC	75,400	17.70	1,334,580.00
CMS ENERGY CORP	45,600	56.52	2,577,312.00
CONSOLIDATED EDISON INC	52,500	71.28	3,742,200.00
DOMINION ENERGY INC	133,000	79.68	10,597,440.00
DTE ENERGY COMPANY	30,500	104.12	3,175,660.00
NISOURCE INC	58,200	22.35	1,300,770.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	81,000	47.50	3,847,500.00
SEMPRA ENERGY	46,400	112.61	5,225,104.00
WEC ENERGY GROUP INC	49,800	85.54	4,259,892.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,300	124.08	3,511,464.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	34,900	41.14	1,435,786.00
ALLY FINANCIAL INC	57,400	18.85	1,081,990.00
AMERICAN EXPRESS CO	109,000	93.42	10,182,780.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	72,500	61.16	4,434,100.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	49,600	48.67	2,414,032.00
SYNCHRONY FINANCIAL	88,000	21.39	1,882,320.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	19,000	147.03	2,793,570.00
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	27,500	46.24	1,271,600.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	127,100	36.32	4,616,272.00
BLACKROCK INC	23,930	534.85	12,798,960.50
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	106,900	54.35	5,810,015.00
CARLYLE GROUP INC/THE	22,000	26.47	582,340.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	17,900	91.51	1,638,029.00
CME GROUP INC	56,500	162.45	9,178,425.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	35,000	48.54	1,698,900.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,920	328.65	1,945,608.00
FRANKLIN RESOURCES INC	43,400	20.04	869,736.00
GOLDMAN SACHS GROUP	52,100	189.19	9,856,799.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	86,700	90.40	7,837,680.00
INVESCO LTD	58,000	10.00	580,000.00
KKR & CO INC-A	78,400	29.59	2,319,856.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,160	489.83	3,017,352.80
MOODYS CORP	26,800	268.98	7,208,664.00

MORGAN STANLEY	190,300	47.05	8,953,615.00
MSCI INC	13,650	332.20	4,534,530.00
NASDAQ INC	18,400	115.82	2,131,088.00
NORTHERN TRUST CORP	32,100	76.20	2,446,020.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	19,600	66.40	1,301,440.00
S&P GLOBAL INC	38,520	321.60	12,388,032.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	183,700	31.75	5,832,475.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	52.90	1,010,390.00
STATE STREET CORP	56,200	60.53	3,401,786.00
T ROWE PRICE GROUP INC	36,600	118.94	4,353,204.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	41,200	34.21	1,409,452.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	13,000	59.58	774,540.00
AES CORP	101,000	13.75	1,388,750.00
VISTRA ENERGY CORP	70,000	18.13	1,269,100.00
CERNER CORP	49,900	66.54	3,320,346.00
TELADOC HEALTH INC	11,200	193.26	2,164,512.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	20,700	234.93	4,863,051.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	49,000	85.90	4,209,100.00
AVANTOR INC	68,000	16.76	1,139,680.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	3,640	432.55	1,574,482.00
ILLUMINA INC	23,390	360.08	8,422,271.20
IQVIA HOLDINGS INC	30,600	135.99	4,161,294.00
METTLER-TOLEDO INTL	3,880	772.30	2,996,524.00
PERKINELMER INC	17,400	93.93	1,634,382.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	62,730	350.95	22,015,093.50
WATERS CORP	9,500	174.76	1,660,220.00
COSTAR GROUP INC	6,180	691.07	4,270,812.60
EQUIFAX INC	19,500	167.53	3,266,835.00
IHS MARKIT LTD	59,000	72.69	4,288,710.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	54,000	14.08	760,320.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17,100	50.60	865,260.00
TRUNSION	29,000	83.03	2,407,870.00
VERISK ANALYTICS INC	24,100	162.89	3,925,649.00
CBRE GROUP INC	51,400	43.04	2,212,256.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	184,000	4.05	745,200.00
JONES LANG LASALLE INC	7,600	98.12	745,712.00

ALTICE USA INC-A	53,000	22.45	1,189,850.00
CABLE ONE INC	730	1,714.18	1,251,351.40
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	23,320	502.27	11,712,936.40
COMCAST CORP-CL A	717,700	38.65	27,739,105.00
DISCOVERY INC - A	24,500	20.26	496,370.00
DISCOVERY INC - C	57,000	18.51	1,055,070.00
DISH NETWORK CORP-A	38,400	32.55	1,249,920.00
FOX CORP-CLASS A	52,000	25.70	1,336,400.00
FOX CORP-CLASS B	25,400	25.75	654,050.00
INTERPUBRIC GROUP	58,000	16.22	940,760.00
LIBERTY BROADBAND CORP-A	4,000	121.10	484,400.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	16,700	123.30	2,059,110.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	64,000	20.72	1,326,080.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	20.92	502,080.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	25,800	32.13	828,954.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	32.14	414,606.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	55,000	11.48	631,400.00
OMNICOM GROUP	34,500	52.78	1,820,910.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	175,000	5.54	969,500.00
VIACOMCBS INC-CLASS B	88,000	22.32	1,964,160.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	120,900	76.40	9,236,760.00
DISNEY (WALT) CO	284,300	109.10	31,017,130.00
ELECTRONIC ARTS	46,100	130.93	6,035,873.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	34,000	30.85	1,048,900.00
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	23,000	42.62	980,260.00
NETFLIX INC	69,300	443.40	30,727,620.00
ROKU INC	14,200	122.55	1,740,210.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	18,100	141.18	2,555,358.00
ALPHABET INC-CL A	47,260	1,362.54	64,393,640.40
ALPHABET INC-CL C	48,360	1,359.90	65,764,764.00
FACEBOOK INC-A	379,200	216.08	81,937,536.00
IAC/INTERACTIVE CORP	12,600	304.91	3,841,866.00
MATCH GROUP INC	8,400	101.18	849,912.00
PINTEREST INC- CLASS A	58,000	21.61	1,253,380.00
	139,000	23.07	3,206,730.00

小計	SNAP INC-A				
	TWITTER INC	124,100	29.05	3,605,105.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	20,200	55.59	1,122,918.00	
	銘柄数：590			4,084,548,404.20 (438,026,970,866)	
	組入時価比率：68.0%			70.7%	
カナダドル	CAMECO CORP	69,000	13.52	932,880.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	187,000	23.38	4,372,060.00	
	CENOVUS ENERGY INC	156,000	6.07	946,920.00	
	ENBRIDGE INC	321,300	40.49	13,009,437.00	
	IMPERIAL OIL	37,500	21.03	788,625.00	
	INTER PIPELINE LTD	60,000	12.00	720,000.00	
	KEYERA CORP	34,000	19.84	674,560.00	
	PARKLAND CORP	21,700	32.42	703,514.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	88,000	32.37	2,848,560.00	
	SUNCOR ENERGY INC	244,000	22.28	5,436,320.00	
	TC ENERGY CORP	146,800	57.15	8,389,620.00	
	NUTRIEN LTD	90,000	45.10	4,059,000.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	24,700	42.17	1,041,599.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	37,700	84.09	3,170,193.00	
	B2GOLD CORP	176,000	7.38	1,298,880.00	
	BARRICK GOLD	283,000	35.36	10,006,880.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	93,000	9.89	919,770.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	29,500	187.62	5,534,790.00	
	KINROSS GOLD CORP	198,000	9.43	1,867,140.00	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	44,100	53.01	2,337,741.00	
	LUNDIN MINING CORP	95,000	6.99	664,050.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	31,000	39.02	1,209,620.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	82,000	13.48	1,105,360.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	71,600	57.74	4,134,184.00	
	YAMANA GOLD INC	163,000	7.13	1,162,190.00	
	CAE INC	41,000	21.80	893,800.00	
	WSP GLOBAL INC	17,700	81.21	1,437,417.00	
	RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	18,800	54.08	1,016,704.00	
	AIR CANADA	20,400	16.70	340,680.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	112,600	118.18	13,307,068.00	

CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	21,300	339.71	7,235,823.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	45,100	58.50	2,638,350.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	31,800	19.77	628,686.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	46,000	71.92	3,308,320.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	8,600	116.39	1,000,954.00	
DOLLARAMA INC	46,600	44.58	2,077,428.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	139,000	42.20	5,865,800.00	
EMPIRE CO LTD A	26,000	32.64	848,640.00	
LOBLAW COMPANIES	28,500	65.34	1,862,190.00	
METRO INC	39,600	55.50	2,197,800.00	
WESTON(GEORGE)LTD	12,300	97.23	1,195,929.00	
SAPUTO INC	41,000	31.71	1,300,110.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	51,000	24.94	1,271,940.00	
CANOPY GROWTH CORP	33,000	21.82	720,060.00	
CRONOS GROUP INC	25,000	8.20	205,000.00	
BANK OF MONTREAL	102,000	70.74	7,215,480.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	189,900	54.44	10,338,156.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	69,600	90.13	6,273,048.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	52,300	60.14	3,145,322.00	
ROYAL BANK OF CANADA	223,700	91.20	20,401,440.00	
TORONTO DOMINION BANK	287,200	59.48	17,082,656.00	
ONEX CORPORATION	13,200	60.16	794,112.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,140	417.00	1,726,380.00	
GREAT-WEST LIFE CO INC	42,000	23.28	977,760.00	
IA FINANCIAL CORP INC	18,300	44.67	817,461.00	
INTACT FINANCIAL CORP	22,700	127.10	2,885,170.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	303,000	17.85	5,408,550.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	86,950	24.03	2,089,408.50	
SUN LIFE FINANCIAL INC	92,300	48.38	4,465,474.00	
CGI INC	38,400	85.36	3,277,824.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	16,400	1,242.59	20,378,476.00	
BLACKBERRY LTD	71,000	6.47	459,370.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,200	1,526.58	4,885,056.00	
OPEN TEXT CORP	41,700	58.14	2,424,438.00	

	BCE INC	25,600	55.80	1,428,480.00	
	TELUS CORP	58,600	22.36	1,310,296.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	54,500	54.09	2,947,905.00	
	EMERA INC	37,900	51.77	1,962,083.00	
	FORTIS INC	71,200	50.16	3,571,392.00	
	HYDRO ONE LTD	55,000	24.91	1,370,050.00	
	ALTAGAS LTD	42,000	14.98	629,160.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	85,000	17.29	1,469,650.00	
	ATCO LTD CL1	13,000	38.50	500,500.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	20,300	31.96	648,788.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	209,800	44.46	9,327,708.00	
	CI FINANCIAL CORP	33,600	16.95	569,520.00	
	IGM FINANCIAL INC	15,000	31.83	477,450.00	
	TMX GROUP LTD	9,500	128.86	1,224,170.00	
	THOMSON REUTERS CORP	27,800	91.19	2,535,082.00	
	QUEBECOR INC-CL B	27,000	28.98	782,460.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	77,000	21.98	1,692,460.00	
小計	銘柄数：81			274,179,327.50	
				(21,509,368,242)	
	組入時価比率：3.3%			3.5%	
ユーロ	TENARIS SA	71,000	5.74	407,824.00	
	ENI SPA	403,000	8.39	3,383,991.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	81,000	10.40	842,400.00	
	NESTE OYJ	66,800	35.03	2,340,004.00	
	OMV AG	25,200	29.68	747,936.00	
	REPSOL SA	220,484	7.77	1,713,160.68	
	REPSOL SA-RTS	220,484	0.42	94,697.87	
	TOTAL SA	388,400	35.14	13,650,318.00	
	VOPAK	11,400	47.83	545,262.00	
	AIR LIQUIDE SA	75,100	126.10	9,470,110.00	
	AKZO NOBEL	30,800	79.56	2,450,448.00	
	ARKEMA	10,200	83.94	856,188.00	
	BASF SE	144,400	48.69	7,031,558.00	
	COVESTRO AG	26,900	33.33	896,577.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	33,000	22.87	754,710.00	
		10,500	35.50	372,750.00	

FUCHS PETROLUB SE -PFD				
KONINKLIJKE DSM NV	27,300	121.80	3,325,140.00	
LANXESS	12,000	46.65	559,800.00	
SOLVAY SA	11,400	70.86	807,804.00	
SYMRISE AG	21,000	101.55	2,132,550.00	
UMICORE	31,000	41.46	1,285,260.00	
CRH PLC	125,300	30.25	3,790,325.00	
HEIDELBERGCEMENT AG	22,600	46.77	1,057,002.00	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	35,300	28.92	1,020,876.00	
ARCELORMITTAL	108,000	8.99	971,136.00	
THYSSENKRUPP AG	62,000	5.90	365,800.00	
VOESTALPINE AG	20,000	18.79	375,800.00	
STORA ENSO OYJ-R	97,000	10.64	1,032,565.00	
UPM-KYMMENE OYJ	83,200	25.58	2,128,256.00	
AIRBUS SE	91,800	61.88	5,680,584.00	
DASSAULT AVIATION SA	330	805.00	265,650.00	
LEONARDO SPA	64,000	5.85	374,400.00	
MTU AERO ENGINES AG	8,400	150.40	1,263,360.00	
SAFRAN SA	50,000	87.80	4,390,000.00	
THALES SA	16,300	70.50	1,149,150.00	
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	79,000	31.46	2,485,340.00	
KINGSPAN GROUP PLC	24,500	56.80	1,391,600.00	
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	40,394	1.35	54,552.09	
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	40,394	21.98	887,860.12	
BOUYGUES	34,800	29.00	1,009,200.00	
EIFPAGE SA	12,100	80.58	975,018.00	
FERROVIAL SA	78,084	24.25	1,893,537.00	
HOCHTIEF AG	3,800	77.05	292,790.00	
VINCI	80,800	81.32	6,570,656.00	
LEGRAND SA	42,900	67.18	2,882,022.00	
PRYSMIAN SPA	37,000	20.43	755,910.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	87,000	97.30	8,465,100.00	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	38,000	15.40	585,200.00	
SIEMENS AG	120,600	101.84	12,281,904.00	
ALSTOM	30,300	41.45	1,255,935.00	

ANDRITZ AG	11,700	33.40	390,780.00	
CNH INDUSTRIAL NV	154,000	6.01	926,772.00	
GEA GROUP AG	24,200	28.46	688,732.00	
KION GROUP AG	9,900	53.66	531,234.00	
KNORR-BREMSE AG	7,100	90.01	639,071.00	
KONE OYJ	54,000	61.60	3,326,400.00	
METSO OYJ	16,200	30.18	488,916.00	
WARTSILA OYJ	63,000	7.22	455,364.00	
BRENNTAG AG	23,800	46.13	1,097,894.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	158,100	31.40	4,964,340.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	42,000	8.99	377,748.00	
ADP	4,700	92.30	433,810.00	
AENA SME SA	10,700	119.40	1,277,580.00	
ATLANTIA SPA	79,000	14.52	1,147,080.00	
FRAPORT AG	6,300	38.84	244,692.00	
GETLINK	72,000	12.97	933,840.00	
CONTINENTAL AG	17,500	85.04	1,488,200.00	
FAURECIA	10,500	33.43	351,015.00	
MICHELIN (CGDE)	26,700	92.26	2,463,342.00	
PIRELLI & C. SPA	53,000	3.80	201,824.00	
VALEO SA	37,300	22.53	840,369.00	
BAYER MOTOREN WERK	52,100	55.77	2,905,617.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,200	42.68	435,336.00	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	135,800	35.01	4,754,358.00	
FERRARI NV	20,000	151.40	3,028,000.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	170,000	8.63	1,467,950.00	
PEUGEOT CITROEN	97,000	13.85	1,343,450.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	25,400	50.60	1,285,240.00	
RENAULT SA	28,100	20.96	589,116.50	
VOLKSWAGEN AG	5,100	142.30	725,730.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	28,900	133.32	3,852,948.00	
SEB SA	3,800	144.20	547,960.00	
ADIDAS AG	29,800	233.00	6,943,400.00	
ESSILORLUXOTTICA	45,300	115.20	5,218,560.00	
HERMES INTERNATIONAL	5,010	737.80	3,696,378.00	

KERING SA	12,060	477.00	5,752,620.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	43,900	387.70	17,020,030.00	
MONCLER SPA	28,100	34.30	963,830.00	
PUMA SE	12,600	67.50	850,500.00	
ACCOR SA	32,000	23.81	761,920.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	15,939	121.40	1,934,994.60	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	15,400	27.83	428,582.00	
SODEXO	13,200	59.96	791,472.00	
DELIVERY HERO SE	20,900	92.76	1,938,684.00	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	18,900	92.74	1,752,786.00	
PROSUS NV	76,800	79.94	6,139,392.00	
ZALANDO SE	23,100	63.22	1,460,382.00	
INDITEX SA	174,000	23.75	4,132,500.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	95,000	13.94	1,324,775.00	
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	8,300	33.06	274,398.00	
COLRUYT SA	8,700	48.69	423,603.00	
JERONIMO MARTINS	38,000	15.78	599,830.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	171,000	23.99	4,102,290.00	
METRO AG	25,000	8.38	209,500.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	120,100	43.34	5,205,134.00	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	91,000	7.53	685,230.00	
HEINEKEN HOLDING NV	17,500	73.90	1,293,250.00	
HEINEKEN NV	40,400	83.56	3,375,824.00	
PERNOD RICARD SA	33,500	140.05	4,691,675.00	
REMY COINTREAU	4,000	121.20	484,800.00	
DANONE	97,000	63.44	6,153,680.00	
KERRY GROUP PLC-A	24,500	111.20	2,724,400.00	
HENKEL AG & CO KGAA	16,300	72.45	1,180,935.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	27,400	81.54	2,234,196.00	
BEIERSDORF AG	16,000	101.40	1,622,400.00	
LOREAL-ORD	39,840	285.10	11,358,384.00	
UNILEVER NV	229,200	49.07	11,246,844.00	
BIOMERIEUX	6,900	122.00	841,800.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	6,000	88.05	528,300.00	
DIASORIN SPA	4,000	171.40	685,600.00	

KONINKLIJKE PHILIPS NV	142,600	41.73	5,951,411.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	5,800	298.00	1,728,400.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,900	43.23	1,033,197.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	33,300	76.48	2,546,784.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	67,300	43.97	2,959,181.00	
ORPEA	8,700	103.55	900,885.00	
GALAPAGOS NV	7,000	177.50	1,242,500.00	
GRIFOLS SA	46,800	27.57	1,290,276.00	
BAYER AG-REG	154,800	66.79	10,339,092.00	
IPSEN	5,500	75.10	413,050.00	
MERCK KGAA	20,000	102.50	2,050,000.00	
ORION OYJ	16,500	44.55	735,075.00	
RECORDATI SPA	16,800	44.91	754,488.00	
SANOFI	178,100	91.10	16,224,910.00	
UCB SA	19,300	103.40	1,995,620.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	70,000	7.41	519,260.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,056,000	2.99	3,165,888.00	
BANCO SANTANDER SA	2,610,000	2.12	5,537,115.00	
BANKINTER S.A.	94,000	4.17	391,980.00	
BNP PARIBAS	176,000	34.48	6,069,360.00	
CAIXABANK	590,000	1.84	1,089,140.00	
COMMERZBANK AG	158,000	3.75	593,290.00	
CREDIT AGRICOLE SA	184,000	8.08	1,487,456.00	
ERSTE GROUP BANK AG	42,000	20.61	865,620.00	
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	102,000	11.81	1,205,130.00	
ING GROEP NV	617,000	6.02	3,714,340.00	
INTESA SANPAOLO	2,320,000	1.66	3,851,200.00	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00	
KBC GROEP NV	40,600	50.52	2,051,112.00	
MEDIOBANCA S.P.A.	107,000	6.25	668,964.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	20,100	16.21	325,821.00	
SOCIETE GENERALE	127,000	14.48	1,839,468.00	
UNICREDIT SPA	337,000	7.90	2,665,333.00	
EURAZEO SE	5,953	44.98	267,765.94	
EXOR NV	17,200	49.10	844,520.00	

GROUPE BRUXELLES LAM	17,794	73.46	1,307,147.24	
SOFINA SA	2,300	230.00	529,000.00	
WENDEL	4,300	84.10	361,630.00	
AEGON NV	293,000	2.58	757,991.00	
AGEAS	28,900	30.47	880,583.00	
ALLIANZ SE-REG	65,500	178.00	11,659,000.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	175,000	13.28	2,324,000.00	
AXA	308,000	18.52	5,706,008.00	
CNP ASSURANCES	28,000	10.04	281,120.00	
HANNOVER RUECK SE	9,600	151.70	1,456,320.00	
MAPFRE SA	163,000	1.57	256,236.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	22,800	225.50	5,141,400.00	
NN GROUP NV	47,000	29.38	1,380,860.00	
POSTE ITALIANE SPA	88,000	7.74	681,648.00	
SAMPO OYJ-A SHS	76,400	30.28	2,313,392.00	
SCOR SE	23,200	23.56	546,592.00	
ADYEN NV	2,850	1,284.50	3,660,825.00	
AMADEUS IT GROUP SA	67,000	46.61	3,122,870.00	
ATOS SE	15,300	75.58	1,156,374.00	
CAPGEMINI SA	25,900	103.35	2,676,765.00	
EDENRED	38,200	39.25	1,499,350.00	
NEXI SPA	60,000	15.05	903,300.00	
WORLDLINE SA	22,600	74.52	1,684,152.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	20,900	151.40	3,164,260.00	
NEMETSCHEK SE	9,200	61.50	565,800.00	
SAP SE	164,300	122.12	20,064,316.00	
TEAMVIEWER AG	20,600	47.64	981,384.00	
NOKIA OYJ	878,000	3.89	3,418,054.00	
INGENICO GROUP	9,500	138.75	1,318,125.00	
ASML HOLDING NV	67,250	324.00	21,789,000.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	199,000	20.55	4,089,450.00	
STMICROELECTRONICS NV	101,000	23.45	2,368,450.00	
CELLNEX TELECOM SA	38,400	52.78	2,026,752.00	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	530,000	14.55	7,714,150.00	
ELISA OYJ	22,100	53.84	1,189,864.00	

ILIAD SA	2,400	171.00	410,400.00	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	38,000	8.88	337,440.00	
KONINKLIJKE KPN NV	560,000	2.33	1,306,480.00	
ORANGE SA	310,000	10.39	3,220,900.00	
PROXIMUS	26,000	18.59	483,470.00	
TELECOM ITALIA SPA	1,170,000	0.35	413,244.00	
TELECOM ITALIA-RNC	880,000	0.35	308,352.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	150,000	2.60	390,450.00	
TELEFONICA SA	732,000	4.21	3,083,184.00	
TELEFONICA SA-RTS	732,000	0.17	128,319.60	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	36.65	615,720.00	
ELECTRICITE DE FRANCE	94,000	7.97	749,932.00	
ELIA GROUP SA/NV	4,800	95.40	457,920.00	
ENDESA S.A.	50,000	22.67	1,133,500.00	
ENEL SPA	1,291,000	7.63	9,861,949.00	
ENERGIAS DE PORTUGAL	417,000	4.18	1,743,060.00	
FORTUM OYJ	72,000	16.71	1,203,480.00	
IBERDROLA SA	917,000	10.04	9,206,680.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	70,000	17.34	1,214,150.00	
TERNA SPA	222,000	6.07	1,348,872.00	
VERBUND AG	11,000	38.38	422,180.00	
ENAGAS SA	39,000	21.80	850,200.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	49,000	16.41	804,335.00	
SNAM SPA	320,000	4.30	1,378,560.00	
E.ON SE	355,000	9.73	3,455,570.00	
ENGIE	290,000	10.89	3,159,550.00	
RWE AG	93,100	31.48	2,930,788.00	
SUEZ	52,000	10.19	530,140.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	87,000	20.03	1,742,610.00	
AMUNDI SA	10,000	69.35	693,500.00	
DEUTSCHE BANK AG-REG	314,000	8.13	2,553,762.00	
DEUTSCHE BOERSE AG	30,400	159.75	4,856,400.00	
NATIXIS	158,000	2.37	375,724.00	
UNIPER SE	31,100	28.46	885,106.00	
EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,950	552.00	1,076,400.00	

	QIAGEN NV	35,400	38.93	1,378,122.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,600	222.20	1,022,120.00	
	BUREAU VERITAS SA	47,000	18.80	883,835.00	
	RANDSTAD NV	18,400	40.03	736,552.00	
	TELEPERFORMANCE	9,000	224.30	2,018,700.00	
	WOLTERS KLUWER	43,800	68.12	2,983,656.00	
	AROUNDTOWN SA	185,000	5.11	946,460.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	52,500	39.57	2,077,425.00	
	LEG IMMOBILIEN AG	11,000	114.38	1,258,180.00	
	VONOVIA SE	82,400	54.16	4,462,784.00	
	ALTICE EUROPE N.V.	99,000	3.54	350,559.00	
	JC DECAUX SA	15,000	16.24	243,600.00	
	PUBLICIS GROUPE	32,400	27.63	895,212.00	
	SES FDR	56,000	6.02	337,120.00	
	TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	37.52	251,384.00	
	BOLLORE	138,000	2.78	383,916.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	14,400	70.64	1,017,216.00	
	VIVENDI SA	130,000	23.00	2,990,000.00	
	SCOUT24 AG	17,100	68.70	1,174,770.00	
小計	銘柄数：244			579,595,342.64 (69,771,687,347)	
	組入時価比率：10.8%			11.2%	
英ポンド	BP PLC	3,213,000	3.04	9,786,798.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	653,000	13.19	8,618,294.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	588,000	12.58	7,398,216.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	21,500	52.24	1,123,160.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	30,200	20.88	630,576.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	191,000	18.39	3,513,636.00	
	ANTOFAGASTA PLC	59,000	9.14	539,732.00	
	BHP GROUP PLC	337,000	16.39	5,523,430.00	
	EVRAZ PLC	76,000	2.90	220,400.00	
	GLENCORE PLC	1,590,000	1.66	2,651,166.00	
	RIO TINTO PLC-REG	175,800	45.33	7,969,893.00	
	MONDI PLC	75,000	14.93	1,119,750.00	
	BAE SYSTEMS PLC	502,000	4.85	2,435,704.00	
		277,000	2.85	789,450.00	

ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC				
MELROSE INDUSTRIES PLC	730,000	1.14	833,295.00	
DCC PLC	16,000	67.00	1,072,000.00	
SMITHS GROUP PLC	61,000	13.00	793,000.00	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	11,600	100.20	1,162,320.00	
ASHTED GROUP PLC	69,200	27.00	1,868,400.00	
BUNZLE	56,000	21.45	1,201,200.00	
FERGUSON PLC	36,600	63.56	2,326,296.00	
RENTOKIL INTIAL PLC	285,000	5.10	1,455,780.00	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	159,000	5.01	797,544.00	
PERSIMMON PLC	48,000	22.83	1,095,840.00	
TAYLOR WIMPEY PLC	500,000	1.42	712,750.00	
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	19,500	41.05	800,475.00	
BURBERRY GROUP PLC	66,000	15.34	1,012,770.00	
COMPASS GROUP PLC	277,000	10.96	3,037,305.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,561	110.45	945,562.45	
GVC HOLDINGS PLC	87,000	7.63	664,332.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	28,500	36.26	1,033,410.00	
WHITBREAD PLC	31,650	21.95	694,717.50	
OCADO GROUP PLC	72,000	20.33	1,463,760.00	
NEXT PLC	22,100	48.00	1,060,800.00	
JD SPORTS FASHION PLC	76,000	6.25	475,456.00	
KINGFISHER PLC	308,000	2.14	661,276.00	
MORRISON SUPERMARKETS	370,000	1.91	709,845.00	
SAINSBURY	299,000	2.07	620,724.00	
TESCO PLC	1,520,000	2.30	3,506,640.00	
COCA-COLA HBC AG-DI	34,000	20.57	699,380.00	
DIAGEO PLC	366,900	27.00	9,906,300.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	54,100	18.98	1,027,088.50	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	363,700	31.09	11,309,251.50	
IMPERIAL BRANDS PLC	149,000	15.25	2,272,995.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	112,700	72.70	8,193,290.00	
UNILEVER PLC	183,200	45.19	8,278,808.00	
SMITH & NEPHEW PLC	137,000	15.22	2,085,825.00	
NMC HEALTH PLC	13,300	0.24	3,192.00	

ASTRAZENECA PLC	207,300	84.56	17,529,288.00	
GLAXOSMITHKLINE PLC	788,000	16.47	12,978,360.00	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	24,900	22.53	560,997.00	
BARCLAYS PLC	2,740,000	1.10	3,040,852.00	
HSBC HOLDINGS PLC	3,207,000	3.80	12,194,617.50	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	11,050,000	0.31	3,434,892.50	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	770,000	1.18	912,450.00	
STANDARD CHARTERED PLC	438,000	4.22	1,850,988.00	
M&G PLC	440,000	1.61	710,160.00	
ADMIRAL GROUP PLC	30,800	23.13	712,404.00	
AVIVA PLC	604,000	2.69	1,624,760.00	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	219,000	2.70	592,833.00	
LEGAL & GENERAL	940,000	2.16	2,033,220.00	
PRUDENTIAL PLC	410,000	11.89	4,876,950.00	
RSA INSURANCE GROUP PLC	162,000	4.13	670,518.00	
AVEVA GROUP PLC	11,200	41.26	462,112.00	
SAGE GROUP PLC (THE)	175,000	6.69	1,170,750.00	
HALMA PLC	59,000	23.00	1,357,000.00	
BT GROUP PLC	1,370,000	1.14	1,569,335.00	
VODAFONE GROUP PLC	4,190,000	1.25	5,247,556.00	
SSE PLC	165,000	13.63	2,249,775.00	
NATIONAL GRID PLC	547,000	9.66	5,286,208.00	
SEVERN TRENT PLC	37,000	24.66	912,420.00	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	106,000	9.15	970,324.00	
3I GROUP PLC	155,000	8.23	1,276,270.00	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	52,000	16.61	863,980.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	49,300	83.58	4,120,494.00	
SCHRODERS PLC	19,700	29.26	576,422.00	
ST JAMES S PLACE PLC	81,000	9.45	765,936.00	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	366,000	2.61	955,626.00	
EXPERIAN PLC	145,200	28.17	4,090,284.00	
INTERTEK GROUP PLC	25,600	54.60	1,397,760.00	
RELX PLC	308,000	18.93	5,830,440.00	
INFORMA PLC	248,000	4.67	1,158,408.00	
ITV PLC	640,000	0.71	459,136.00	

小計	PEARSON	126,000	5.62	708,120.00	
	WPP PLC	200,000	6.12	1,225,600.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,000	5.33	762,190.00	
	銘柄数：86			233,241,268.95	
	組入時価比率：4.8%			(30,888,141,247)	5.0%
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	32,000	18.19	582,080.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,220	722.00	880,840.00	
	GIVAUDAN-REG	1,458	3,439.00	5,014,062.00	
	SIKA AG-REG	22,000	181.55	3,994,100.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	81,200	40.65	3,300,780.00	
	GEBERIT AG-REG	5,960	466.90	2,782,724.00	
	ABB LTD	294,000	20.84	6,126,960.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,000	221.00	663,000.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,700	221.80	1,486,060.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	8,400	154.30	1,296,120.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	81,400	60.08	4,890,512.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,700	186.00	874,200.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	36.24	268,176.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,842.00	847,320.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	177	7,605.00	1,346,085.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	16	79,700.00	1,275,200.00	
	NESTLE SA-REG	468,800	105.04	49,242,752.00	
	ALCON INC	76,500	55.42	4,239,630.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	8,858	193.65	1,715,351.70	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,600	796.00	1,273,600.00	
	NOVARTIS AG-REG	338,100	83.17	28,119,777.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	110,640	333.50	36,898,440.00	
	VIFOR PHARMA AG	7,600	149.30	1,134,680.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	5,400	89.80	484,920.00	
	BALOISE HOLDING AG	7,400	139.90	1,035,260.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	5,190	345.60	1,793,664.00	
	SWISS RE LTD	46,200	71.84	3,319,008.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	23,520	330.60	7,775,712.00	
	TEMENOS AG-REG	10,400	141.45	1,471,080.00	
		27,100	59.68	1,617,328.00	

	LOGITECH INTERNATIONAL-REG				
	SWISSCOM AG-REG	4,030	491.40	1,980,342.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	385,000	9.58	3,691,380.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	35,800	39.50	1,414,100.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,990	852.00	2,547,480.00	
	UBS GROUP AG	582,000	10.74	6,253,590.00	
	LONZA AG-REG	11,880	498.90	5,926,932.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	24,900	44.52	1,108,548.00	
	SGS SA-REG	980	2,294.00	2,248,120.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	11,400	87.45	996,930.00	
小計	銘柄数：39			201,916,843.70	
				(22,846,890,864)	
	組入時価比率：3.5%			3.7%	
スウェーデン ローナ	LUNDIN ENERGY AB	28,800	221.70	6,384,960.00	
	BOLIDEN AB	44,000	201.50	8,866,000.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B	100,000	111.15	11,115,000.00	
	ASSA ABLOY AB-B	159,000	189.70	30,162,300.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	51,000	206.70	10,541,700.00	
	SKANSKA AB-B SHS	51,000	184.80	9,424,800.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	26,000	168.90	4,391,400.00	
	ALFA LAVAL AB	51,000	204.10	10,409,100.00	
	ATLAS COPCO AB-A	107,600	394.30	42,426,680.00	
	ATLAS COPCO AB-B	62,700	344.60	21,606,420.00	
	EPIROC AB - A	103,000	115.15	11,860,450.00	
	EPIROC AB - B	58,000	113.00	6,554,000.00	
	SANDVIK AB	178,000	169.65	30,197,700.00	
	SKF AB-B SHARES	58,000	173.85	10,083,300.00	
	VOLVO AB-B SHS	234,000	144.40	33,789,600.00	
	SECURITAS AB-B SHS	55,000	124.05	6,822,750.00	
	ELECTROLUX AB-B	34,000	155.25	5,278,500.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	58,000	75.70	4,390,600.00	
	EVOLUTION GAMING GROUP	21,000	577.60	12,129,600.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	127,000	137.05	17,405,350.00	
	ICA GRUPPEN AB	13,800	449.00	6,196,200.00	
	SWEDISH MATCH AB	26,000	666.20	17,321,200.00	

	ESSITY AKTIEBOLAG-B	97,400	298.90	29,112,860.00	
	NORDEA BANK ABP	515,000	63.86	32,887,900.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	250,000	79.66	19,915,000.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	243,000	89.30	21,699,900.00	
	SWEDBANK AB	148,000	116.74	17,277,520.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	212.30	5,307,500.00	
	INVESTOR AB-B SHS	71,500	488.30	34,913,450.00	
	KINNEVIK AB - B	39,000	242.30	9,449,700.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	12,600	427.80	5,390,280.00	
	ERICSSON LM-B	463,000	86.50	40,049,500.00	
	HEXAGON AB-B SHS	42,300	543.40	22,985,820.00	
	TELIA CO AB	381,000	34.87	13,285,470.00	
	TELE 2 AB-B SHS	78,000	122.65	9,566,700.00	
	EQT AB	41,000	159.75	6,549,750.00	
小計	銘柄数：36			585,748,960.00	
				(6,724,398,060)	
	組入時価比率：1.0%			1.1%	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	158,000	139.15	21,985,700.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,600	332.30	9,836,080.00	
	NORSK HYDRO	218,000	26.27	5,726,860.00	
	MOWI ASA	69,000	179.25	12,368,250.00	
	ORKLA ASA	115,000	84.54	9,722,100.00	
	DNB ASA	145,000	128.00	18,560,000.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,000	174.00	5,394,000.00	
	TELENOR ASA	116,000	141.50	16,414,000.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	224.60	2,897,340.00	
小計	銘柄数：9			102,904,330.00	
				(1,137,092,846)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	16,700	686.40	11,462,880.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	33,700	380.80	12,832,960.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	31,600	664.00	20,982,400.00	
	DSV PANALPINA A S	34,000	791.80	26,921,200.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	460	7,075.00	3,254,500.00	

	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,040	7,604.00	7,908,160.00	
	PANDORA A/S	16,000	356.50	5,704,000.00	
	CARLSBERG B	17,300	878.40	15,196,320.00	
	AMBU A/S-B	24,000	215.60	5,174,400.00	
	COLOPLAST-B	19,300	1,035.00	19,975,500.00	
	DEMANT A/S	16,000	177.70	2,843,200.00	
	GN STORE NORD A/S	19,000	357.50	6,792,500.00	
	GENMAB A/S	10,000	2,130.00	21,300,000.00	
	H LUNDBECK A/S	10,500	255.80	2,685,900.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	279,500	440.00	122,980,000.00	
	DANSKE BANK AS	109,000	87.04	9,487,360.00	
	TRYG A/S	19,900	185.00	3,681,500.00	
	ORSTED A/S	30,000	756.20	22,686,000.00	
小計	銘柄数：18			321,868,780.00	
				(5,198,180,797)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
豪ドル	AMPOL LTD	40,000	27.91	1,116,400.00	
	OIL SEARCH LTD	280,000	3.12	873,600.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	265,000	5.93	1,571,450.00	
	SANTOS LTD.	265,000	5.21	1,380,650.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	19.69	334,730.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	152,000	21.16	3,216,320.00	
	ORICA LTD	59,000	16.37	965,830.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	67,000	26.38	1,767,460.00	
	BHP GROUP LIMITED	462,000	36.05	16,655,100.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	88,000	11.41	1,004,080.00	
	EVOLUTION MINING LTD	272,000	5.35	1,455,200.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	273,000	14.18	3,871,140.00	
	NEWCREST MINING	125,000	31.14	3,892,500.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	124,000	13.13	1,628,120.00	
	RIO TINTO LTD	59,600	98.99	5,899,804.00	
	SOUTH32 LTD	780,000	2.00	1,560,000.00	
	CIMIC GROUP LTD	18,000	23.96	431,280.00	
	BRAMBLES LTD	251,000	10.74	2,695,740.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	108,000	3.81	411,480.00	

AURIZON HOLDINGS LTD	305,000	4.78	1,457,900.00
SYDNEY AIRPORT	168,000	5.58	937,440.00
TRANSURBAN GROUP	434,000	14.49	6,288,660.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	88,000	25.60	2,252,800.00
CROWN RESORTS LTD	55,000	9.58	526,900.00
TABCORP HOLDINGS	340,000	3.31	1,125,400.00
WESFARMERS LIMITED	181,000	43.91	7,947,710.00
COLES GROUP LTD	213,000	16.79	3,576,270.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	201,000	36.39	7,314,390.00
COCA-COLA AMATIL LTD	77,000	8.68	668,360.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	111,000	10.47	1,162,170.00
COCHLEAR LTD	10,300	189.66	1,953,498.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	29,500	65.49	1,931,955.00
SONIC HEALTHCARE LTD	69,000	30.28	2,089,320.00
CSL LIMITED	71,600	292.74	20,960,184.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	453,000	18.80	8,516,400.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	280,800	69.27	19,451,016.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	500,000	18.40	9,200,000.00
WESTPAC BANKING CORP	563,000	17.99	10,128,370.00
AMP LIMITED	530,000	1.86	985,800.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	361,000	5.84	2,108,240.00
MEDIBANK PRIVATE LTD	450,000	3.01	1,354,500.00
QBE INSURANCE	241,000	8.88	2,140,080.00
SUNCORP GROUP LTD	190,000	9.54	1,812,600.00
AFTERPAY LTD	35,800	57.00	2,040,600.00
COMPUTERSHARE LTD	76,000	13.07	993,320.00
WISETECH GLOBAL LTD	21,000	21.64	454,440.00
TELSTRA CORP LTD	650,000	3.13	2,034,500.00
TPG TELECOM LTD	52,000	8.89	462,280.00
AUSNET SERVICES	330,000	1.71	564,300.00
APA GROUP	180,000	11.46	2,062,800.00
AGL ENERGY LTD	105,000	16.90	1,774,500.00
ASX LTD	30,700	84.73	2,601,211.00
MACQUARIE GROUP LIMITED	53,000	119.19	6,317,070.00
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	19,200	58.04	1,114,368.00

	小計	REA GROUP LTD	8,800	104.90	923,120.00	
		SEEK LTD	48,000	21.39	1,026,720.00	
		銘柄数：56			188,990,076.00	
					(13,917,229,196)	
		組入時価比率：2.2%			2.2%	
	ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	193,000	6.23	1,202,390.00	
		A2 MILK CO LTD	117,000	19.44	2,274,480.00	
		FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	95,000	32.00	3,040,000.00	
		RYMAN HEALTHCARE LTD	58,000	12.90	748,200.00	
		SPARK NEW ZEALAND LTD	307,000	4.43	1,360,010.00	
		MERCURY NZ LTD	100,000	4.60	460,000.00	
		MERIDIAN ENERGY LTD	201,000	4.82	968,820.00	
		小計			10,053,900.00	
		銘柄数：7			(692,110,476)	
		組入時価比率：0.1%			0.1%	
	香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	425,040	49.85	21,188,244.00	
		NWS HOLDINGS LTD	220,500	6.72	1,481,760.00	
		TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	212,000	75.50	16,006,000.00	
		MTR CORP	243,000	40.35	9,805,050.00	
		GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	335,000	52.00	17,420,000.00	
		SANDS CHINA LTD	384,000	31.00	11,904,000.00	
		SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	8.80	2,376,000.00	
		WYNN MACAU LTD	228,000	13.52	3,082,560.00	
		BUDWEISER BREWING CO APAC LT	290,000	22.30	6,467,000.00	
		WH GROUP LIMITED	1,440,000	6.70	9,648,000.00	
		BANK OF EAST ASIA	220,060	17.64	3,881,858.40	
		BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	564,000	24.50	13,818,000.00	
		HANG SENG BANK	119,000	132.60	15,779,400.00	
		AIA GROUP LTD	1,909,000	74.10	141,456,900.00	
		ASM PACIFIC TECHNOLOGY	48,000	83.60	4,012,800.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	599,600	11.36	6,811,456.00	
		PCCW LTD	750,000	4.44	3,330,000.00	
		CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	107,000	40.60	4,344,200.00	
		CLP HLDGS	265,000	76.15	20,179,750.00	

	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	225,000	43.35	9,753,750.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,640,365	12.00	19,684,380.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	188,100	319.40	60,079,140.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	409,040	47.30	19,347,592.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	310,000	18.28	5,666,800.00	
	HENDERSON LAND	229,443	29.60	6,791,512.80	
	KERRY PROPERTIES	114,000	19.90	2,268,600.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	234,916	38.30	8,997,282.80	
	SINO LAND CO.LTD	480,000	9.68	4,646,400.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	207,000	99.75	20,648,250.00	
	SWIRE PACIFIC-A	75,000	42.90	3,217,500.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	173,000	19.80	3,425,400.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	154,000	37.45	5,767,300.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	134,000	61.30	8,214,200.00	
小計	銘柄数：33			491,501,086.00	
				(6,802,375,030)	
	組入時価比率：1.1%			1.1%	
シンガポール ド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	249,000	3.32	826,680.00	
	KEPPEL CORP.	232,000	6.04	1,401,280.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	440,000	0.95	420,200.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	192,600	3.82	735,732.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	850,000	0.76	646,000.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	14,000	20.17	282,380.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	289,000	4.17	1,205,130.00	
	DBS GROUP HLDGS	284,000	20.82	5,912,880.00	
	OCBC-ORD	524,000	9.04	4,736,960.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	187,000	20.35	3,805,450.00	
	VENTURE CORP LTD	45,000	16.27	732,150.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,290,000	2.49	3,212,100.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	129,000	8.21	1,059,090.00	
	CAPITALAND LIMITED	430,000	2.86	1,229,800.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	8.45	591,500.00	
	UOL GROUP LIMITED	85,000	6.80	578,000.00	

	小計	銘柄数：16			27,375,332.00	
					(2,107,900,564)	
		組入時価比率：0.3%			0.3%	
	新シェケル	ICL GROUP LTD	125,000	10.17	1,271,250.00	
		ELBIT SYSTEMS LTD	3,600	460.00	1,656,000.00	
		BANK HAPOALIM BM	183,000	20.65	3,778,950.00	
		BANK LEUMI LE-ISRAEL	238,000	17.38	4,136,440.00	
		ISRAEL DISCOUNT BANK-A	172,000	10.70	1,840,400.00	
		MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	23,000	65.86	1,514,780.00	
		NICE LTD	10,100	642.80	6,492,280.00	
		AZRIELI GROUP	6,500	149.10	969,150.00	
	小計	銘柄数：8			21,659,250.00	
					(676,418,377)	
組入時価比率：0.1%				0.1%		
合計					620,298,763,912	
					(620,298,763,912)	

(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(2020年6月29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	80,000	1,020,800.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,500	3,155,685.00	
		AMERICAN TOWER CORP	70,200	17,302,896.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	237,000	1,549,980.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,900	3,315,222.00	
		BOSTON PROPERTIES	22,600	1,971,624.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,000	1,419,040.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	66,000	10,647,780.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	41,900	5,890,721.00	
		DUKE REALTY CORP	56,600	1,957,228.00	
		EQUINIX INC	13,540	9,295,751.60	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,500	1,642,470.00	

小計	EQUITY RESIDENTIAL	59,900	3,414,300.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,700	2,405,253.00	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	20,700	1,883,907.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,100	918,747.00	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	81,000	2,145,690.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	109,000	1,170,660.00	
	INVITATION HOMES INC	85,000	2,314,550.00	
	IRON MOUNTAIN INC	43,100	1,063,277.00	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	83,000	1,515,580.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,600	1,940,752.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	27,900	963,666.00	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,500	1,051,930.00	
	PROLOGIS INC	117,000	10,510,110.00	
	PUBLIC STORAGE	24,500	4,637,360.00	
	REALTY INCOME CORP	52,400	3,060,684.00	
	REGENCY CENTERS CORP	26,200	1,165,638.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	17,770	5,227,756.30	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	47,900	2,965,010.00	
	SUN COMMUNITIES INC	14,300	1,944,657.00	
	UDR INC	46,300	1,684,857.00	
	VENTAS INC	57,400	2,050,328.00	
	VEREIT INC	160,000	1,038,400.00	
	VICI PROPERTIES INC	76,000	1,522,280.00	
	VORNADO REALTY TRUST	27,000	989,280.00	
	WELLTOWER INC	63,100	3,138,594.00	
	WEYERHAEUSER CO	115,000	2,471,350.00	
	WP CAREY INC	27,400	1,818,264.00	
	銘柄数：39	2,129,510	124,182,077.90	
			(13,317,286,033)	
	組入時価比率：2.1%		83.8%	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	717,882.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	16,000	220,640.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	331,320.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,000	226,710.00	
小計	銘柄数：4	63,900	1,496,552.00	

			(117,404,504)	
	組入時価比率：0.0%		0.7%	
ユーロ	COVIVIO	8,500	547,825.00	
	GECINA SA	7,100	793,070.00	
	ICADE	5,200	321,620.00	
	KLEPIERRE	32,300	549,746.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21,400	1,058,016.00	
小計	銘柄数：5	74,500	3,270,277.00	
			(393,675,945)	
	組入時価比率：0.1%		2.5%	
英ポンド	BRITISH LAND	128,000	490,880.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	111,000	615,162.00	
	SEGRO PLC	176,000	1,575,552.00	
小計	銘柄数：3	415,000	2,681,594.00	
			(355,123,493)	
	組入時価比率：0.1%		2.2%	
豪ドル	DEXUS	171,000	1,653,570.00	
	GOODMAN GROUP	254,000	3,881,120.00	
	GPT GROUP	330,000	1,419,000.00	
	LENDLEASE GROUP	111,000	1,350,870.00	
	MIRVAC GROUP	660,000	1,491,600.00	
	SCENTRE GROUP	790,000	1,730,100.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	350,000	1,242,500.00	
	VICINITY CENTRES	470,000	672,100.00	
小計	銘柄数：8	3,136,000	13,440,860.00	
			(989,784,930)	
	組入時価比率：0.2%		6.2%	
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	3,788,200.00	
	LINK REIT	330,000	21,054,000.00	
小計	銘柄数：2	800,000	24,842,200.00	
			(343,816,048)	
	組入時価比率：0.1%		2.2%	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	440,800	1,397,336.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	439,972	761,151.56	
	CAPITALAND MALL TRUST	390,000	780,000.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	721,500.00	

		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	420,000	823,200.00	
		SUNTEC REIT	300,000	432,000.00	
	小計	銘柄数：6	2,360,772	4,915,187.56	
				(378,469,442)	
		組入時価比率：0.1%		2.4%	
	合計			15,895,560,395	
				(15,895,560,395)	

(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	2020年 6月29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	7,614,946,213	—	7,503,966,933	△110,979,280
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	157,446,555	—	157,628,100	181,545
米ドル	157,446,555	—	157,628,100	181,545
合計	—	—	—	△110,797,735

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2020年 6月29日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,851,607,641
国債証券	542,208,271,300
地方債証券	48,210,535,902
特殊債券	62,999,345,355
社債券	28,548,705,650
未収入金	545,687,500
未収利息	1,020,929,370
前払費用	23,115,324
流動資産合計	688,408,198,042
資産合計	688,408,198,042
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,309,698,391
未払利息	5,161
流動負債合計	1,309,703,552
負債合計	1,309,703,552
純資産の部	
元本等	
元本	516,819,689,676
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	170,278,804,814
元本等合計	687,098,494,490
純資産合計	687,098,494,490
負債純資産合計	688,408,198,042

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2020年 6月29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	1.3295円
(10,000口当たり純資産額)	(13,295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 2019年 6月29日 至 2020年 6月29日	
1.金融商品に対する取組方針	
当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	
当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。	
当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。	
これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	
3.金融商品に係るリスク管理体制	
委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。	
○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

2020年 6月29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

2020年 6月29日現在	
期首	2019年 6月29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	492,843,207,997円
同期中における追加設定元本額	114,820,515,234円
同期中における一部解約元本額	90,844,033,555円
期末元本額	516,819,689,676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	464,872,235円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	38,525,928,773円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	16,838,998,858円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	2,654,963,010円
野村資産設計ファンド2015	345,519,623円
野村資産設計ファンド2020	355,380,285円
野村資産設計ファンド2025	289,935,055円
野村資産設計ファンド2030	214,360,413円
野村資産設計ファンド2035	107,949,115円
野村資産設計ファンド2040	156,517,282円
野村日本債券インデックスファンド	906,117,526円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	154,080,112,383円
のむラップ・ファンド（保守型）	12,667,502,760円
のむラップ・ファンド（普通型）	9,010,629,020円
のむラップ・ファンド（積極型）	1,158,950,511円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）	10,842,874,897円
野村資産設計ファンド2045	15,525,651円
野村円債投資インデックスファンド	1,039,787,310円
野村インデックスファンド・国内債券	3,139,037,560円
マイ・ロード	34,297,732,101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	1,171,032,593円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）	14,663,321,436円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	3,091,034,125円
野村資産設計ファンド2050	19,373,839円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	19,183,066円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	5,089,295円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	3,077,708円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,713,159円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	765,736,349円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	228,123,713円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	57,867,127円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	29,103,574円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	73,320,565円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	13,725,547円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	13,394,659円
野村6資産均等バランス	1,555,144,664円
世界6資産分散ファンド	136,947,054円
野村資産設計ファンド2060	5,653,839円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信	1,474,234,987円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	16,623,876,245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）	605,668,943円
グローバル・インデックス・バランス５０ＶＡ（適格機関投資家専用）	142,497,201円
グローバル・インデックス・バランス４０ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,951,399,651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）	1,342,071,433円
ワールド・インデックス・ファンドＶＡ安定型（適格機関投資家専用）	18,033,860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）	10,024,225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）	667,038円
野村インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	3,398,187,558円
野村ワールド・インデックス・バランス３５ＶＡ（適格機関投資家専用）	11,053,200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）	86,486,881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）	78,426,591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）	332,579,323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）	314,451,700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）	774,378,159円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	185,899,437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）	288,587,585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）	3,085,846,368円
野村ＦＯＦｓ用・ターゲット・リターン・８資産バランス（２％コース向け）（適格機関投資家専用）	1,439,606円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	33,485,706,899円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	41,121,775,009円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	14,724,651,529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）	49,490,813,022円
マイバランスＤＣ３０	11,119,145,912円
マイバランスＤＣ５０	8,408,532,248円
マイバランスＤＣ７０	2,643,496,382円
野村ＤＣ国内債券インデックスファンド・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合	12,559,665,810円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	625,994,021円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	1,445,827,525円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	637,083,849円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	103,958,454円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	17,132,414円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	15,692,092円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	21,340,433円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	7,172,569円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	3,379,613円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	389,209,485円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	184,738,906円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	56,536,824円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	65,259,947円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	1,230,062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(2020年6月29日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2020年6月29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403回	1,500,000,000	1,504,410,000	
		国庫債券 利付（2年）第406回	4,000,000,000	4,013,960,000	
		国庫債券 利付（5年）第129回	7,200,000,000	7,222,968,000	
		国庫債券 利付（5年）第130回	7,500,000,000	7,528,200,000	
		国庫債券 利付（5年）第131回	5,300,000,000	5,322,366,000	
		国庫債券 利付（5年）第132回	3,000,000,000	3,014,220,000	
		国庫債券 利付（5年）第133回	6,200,000,000	6,233,852,000	
		国庫債券 利付（5年）第134回	3,000,000,000	3,018,240,000	
		国庫債券 利付（5年）第135回	3,500,000,000	3,523,415,000	
		国庫債券 利付（5年）第136回	3,300,000,000	3,324,123,000	
		国庫債券 利付（5年）第137回	4,000,000,000	4,031,080,000	
		国庫債券 利付（5年）第138回	4,900,000,000	4,940,180,000	
		国庫債券 利付（5年）第139回	4,400,000,000	4,438,632,000	
		国庫債券 利付（5年）第140回	3,400,000,000	3,431,892,000	
		国庫債券 利付（5年）第141回	4,000,000,000	4,039,080,000	
		国庫債券 利付（5年）第143回	2,970,000,000	2,999,581,200	
		国庫債券 利付（40年）第1回	2,360,000,000	3,489,897,200	
		国庫債券 利付（40年）第2回	900,000,000	1,292,355,000	
		国庫債券 利付（40年）第3回	900,000,000	1,300,941,000	
		国庫債券 利付（40年）第4回	1,130,000,000	1,645,946,700	
		国庫債券 利付（40年）第5回	1,200,000,000	1,692,804,000	
		国庫債券 利付（40年）第6回	1,300,000,000	1,809,236,000	
		国庫債券 利付（40年）第7回	1,400,000,000	1,876,644,000	
		国庫債券 利付（40年）第8回	1,500,000,000	1,879,920,000	
		国庫債券 利付（40年）第9回	2,500,000,000	2,342,575,000	
		国庫債券 利付（40年）第10回	2,300,000,000	2,526,619,000	
		国庫債券 利付（40年）第11回	1,900,000,000	2,026,217,000	
		国庫債券 利付（40年）第12回	2,070,000,000	1,995,542,100	
		国庫債券 利付（10年）第317回	1,800,000,000	1,827,936,000	
		国庫債券 利付（10年）第318回	3,200,000,000	3,245,728,000	
		国庫債券 利付（10年）第319回	1,850,000,000	1,884,299,000	
		国庫債券 利付（10年）第320回	3,500,000,000	3,559,710,000	

国庫債券 利付（１０年）第３２１回	3,200,000,000	3,263,168,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２２回	2,400,000,000	2,443,248,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２３回	1,700,000,000	1,734,969,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２４回	3,200,000,000	3,259,488,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２５回	4,400,000,000	4,492,796,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２６回	2,100,000,000	2,144,058,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２７回	3,100,000,000	3,172,726,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２８回	5,250,000,000	5,356,785,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２９回	6,000,000,000	6,168,300,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３０回	3,800,000,000	3,915,672,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３１回	1,900,000,000	1,945,543,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３２回	5,400,000,000	5,538,510,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３３回	3,600,000,000	3,698,928,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３４回	6,600,000,000	6,793,710,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３５回	5,200,000,000	5,339,152,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３６回	1,450,000,000	1,490,759,500	
国庫債券 利付（１０年）第３３７回	3,700,000,000	3,769,893,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３８回	5,000,000,000	5,121,000,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３９回	4,000,000,000	4,101,960,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４０回	4,200,000,000	4,314,786,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４１回	5,300,000,000	5,422,642,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４２回	2,750,000,000	2,784,842,500	
国庫債券 利付（１０年）第３４３回	5,900,000,000	5,978,057,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４４回	5,800,000,000	5,878,126,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４５回	5,000,000,000	5,070,100,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４６回	4,900,000,000	4,971,344,000	
	5,400,000,000	5,479,650,000	

国庫債券 利付（１０年）第３４７回			
国庫債券 利付（１０年）第３４８回	4,600,000,000	4,668,632,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４９回	4,100,000,000	4,161,746,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５０回	5,850,000,000	5,936,404,500	
国庫債券 利付（１０年）第３５１回	5,600,000,000	5,680,864,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５２回	6,600,000,000	6,692,796,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５３回	5,100,000,000	5,167,269,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５４回	4,350,000,000	4,403,287,500	
国庫債券 利付（１０年）第３５５回	5,100,000,000	5,157,324,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５６回	4,400,000,000	4,446,728,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５７回	1,900,000,000	1,917,993,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５８回	4,870,000,000	4,912,515,100	
国庫債券 利付（３０年）第１回	500,000,000	629,435,000	
国庫債券 利付（３０年）第２回	500,000,000	615,425,000	
国庫債券 利付（３０年）第３回	160,000,000	196,094,400	
国庫債券 利付（３０年）第４回	900,000,000	1,166,976,000	
国庫債券 利付（３０年）第５回	150,000,000	184,722,000	
国庫債券 利付（３０年）第６回	600,000,000	757,140,000	
国庫債券 利付（３０年）第７回	600,000,000	755,070,000	
国庫債券 利付（３０年）第８回	100,000,000	120,522,000	
国庫債券 利付（３０年）第９回	265,000,000	306,499,000	
国庫債券 利付（３０年）第１０回	250,000,000	279,995,000	
国庫債券 利付（３０年）第１１回	160,000,000	191,678,400	
国庫債券 利付（３０年）第１２回	220,000,000	275,629,200	
国庫債券 利付（３０年）第１３回	290,000,000	360,377,200	
国庫債券 利付（３０年）第１４回	800,000,000	1,039,888,000	
国庫債券 利付（３０年）第１５回	900,000,000	1,185,390,000	
国庫債券 利付（３０年）第１６回	915,000,000	1,208,577,750	
国庫債券 利付（３０年）第１７回	1,200,000,000	1,572,468,000	
国庫債券 利付（３０年）第１８回	1,500,000,000	1,949,040,000	
国庫債券 利付（３０年）第１９回	1,600,000,000	2,083,904,000	
国庫債券 利付（３０年）第２０回	1,400,000,000	1,870,218,000	
国庫債券 利付（３０年）第２１回	1,400,000,000	1,833,020,000	
国庫債券 利付（３０年）第２２回	600,000,000	806,028,000	
国庫債券 利付（３０年）第２３回	840,000,000	1,132,026,000	

国庫債券	利付（３０年）第２４回	700,000,000	945,574,000
国庫債券	利付（３０年）第２５回	500,000,000	661,130,000
国庫債券	利付（３０年）第２６回	850,000,000	1,140,555,500
国庫債券	利付（３０年）第２７回	1,550,000,000	2,115,424,500
国庫債券	利付（３０年）第２８回	1,200,000,000	1,645,584,000
国庫債券	利付（３０年）第２９回	1,500,000,000	2,040,780,000
国庫債券	利付（３０年）第３０回	1,700,000,000	2,292,484,000
国庫債券	利付（３０年）第３１回	1,200,000,000	1,604,208,000
国庫債券	利付（３０年）第３２回	1,400,000,000	1,905,358,000
国庫債券	利付（３０年）第３３回	2,400,000,000	3,142,008,000
国庫債券	利付（３０年）第３４回	2,100,000,000	2,845,059,000
国庫債券	利付（３０年）第３５回	2,300,000,000	3,037,771,000
国庫債券	利付（３０年）第３６回	2,300,000,000	3,047,592,000
国庫債券	利付（３０年）第３７回	2,300,000,000	3,010,286,000
国庫債券	利付（３０年）第３８回	1,600,000,000	2,066,528,000
国庫債券	利付（３０年）第３９回	1,600,000,000	2,104,928,000
国庫債券	利付（３０年）第４０回	1,300,000,000	1,683,175,000
国庫債券	利付（３０年）第４１回	1,500,000,000	1,912,290,000
国庫債券	利付（３０年）第４２回	1,600,000,000	2,041,776,000
国庫債券	利付（３０年）第４３回	1,300,000,000	1,660,594,000
国庫債券	利付（３０年）第４４回	1,400,000,000	1,790,068,000
国庫債券	利付（３０年）第４５回	1,700,000,000	2,098,140,000
国庫債券	利付（３０年）第４６回	1,800,000,000	2,222,910,000
国庫債券	利付（３０年）第４７回	1,700,000,000	2,141,286,000
国庫債券	利付（３０年）第４８回	1,900,000,000	2,306,277,000
国庫債券	利付（３０年）第４９回	1,900,000,000	2,307,227,000
国庫債券	利付（３０年）第５０回	1,600,000,000	1,713,280,000
国庫債券	利付（３０年）第５１回	2,650,000,000	2,513,710,500
国庫債券	利付（３０年）第５２回	1,900,000,000	1,893,407,000
国庫債券	利付（３０年）第５３回	1,700,000,000	1,733,660,000
国庫債券	利付（３０年）第５４回	1,700,000,000	1,815,923,000
国庫債券	利付（３０年）第５５回	1,500,000,000	1,601,235,000
国庫債券	利付（３０年）第５６回	1,900,000,000	2,029,276,000
国庫債券	利付（３０年）第５７回	1,600,000,000	1,707,696,000
国庫債券	利付（３０年）第５８回	2,100,000,000	2,239,734,000
国庫債券	利付（３０年）第５９回	1,600,000,000	1,664,224,000
国庫債券	利付（３０年）第６０回	1,150,000,000	1,254,466,000
国庫債券	利付（３０年）第６１回	1,000,000,000	1,038,200,000
国庫債券	利付（３０年）第６２回	500,000,000	492,575,000
国庫債券	利付（３０年）第６３回	1,400,000,000	1,340,808,000
国庫債券	利付（３０年）第６４回	1,500,000,000	1,434,315,000
国庫債券	利付（３０年）第６５回	1,200,000,000	1,145,628,000
国庫債券	利付（３０年）第６６回	2,900,000,000	2,764,164,000

国庫債券 利付（２０年）第５２回	100,000,000	102,779,000	
国庫債券 利付（２０年）第５３回	250,000,000	258,307,500	
国庫債券 利付（２０年）第５４回	100,000,000	103,471,000	
国庫債券 利付（２０年）第５５回	231,000,000	239,558,550	
国庫債券 利付（２０年）第５６回	120,000,000	125,079,600	
国庫債券 利付（２０年）第５７回	210,000,000	218,473,500	
国庫債券 利付（２０年）第５８回	180,000,000	188,215,200	
国庫債券 利付（２０年）第５９回	230,000,000	240,534,000	
国庫債券 利付（２０年）第６０回	780,000,000	809,920,800	
国庫債券 利付（２０年）第６１回	300,000,000	309,381,000	
国庫債券 利付（２０年）第６２回	440,000,000	452,342,000	
国庫債券 利付（２０年）第６３回	300,000,000	317,370,000	
国庫債券 利付（２０年）第６４回	400,000,000	426,360,000	
国庫債券 利付（２０年）第６５回	455,000,000	487,232,200	
国庫債券 利付（２０年）第６６回	300,000,000	320,205,000	
国庫債券 利付（２０年）第６７回	310,000,000	333,525,900	
国庫債券 利付（２０年）第６８回	290,000,000	315,261,900	
国庫債券 利付（２０年）第６９回	560,000,000	606,687,200	
国庫債券 利付（２０年）第７０回	540,000,000	594,550,800	
国庫債券 利付（２０年）第７１回	200,000,000	218,608,000	
国庫債券 利付（２０年）第７２回	670,000,000	733,469,100	
国庫債券 利付（２０年）第７３回	1,600,000,000	1,752,576,000	
国庫債券 利付（２０年）第７４回	900,000,000	989,865,000	
国庫債券 利付（２０年）第７５回	600,000,000	662,916,000	
国庫債券 利付（２０年）第７６回	910,000,000	996,786,700	
国庫債券 利付（２０年）第７７回	700,000,000	770,084,000	
国庫債券 利付（２０年）第７８回	800,000,000	880,176,000	
国庫債券 利付（２０年）第７９回	860,000,000	950,489,200	
国庫債券 利付（２０年）第８０回	900,000,000	999,198,000	
国庫債券 利付（２０年）第８１回	360,000,000	399,913,200	
国庫債券 利付（２０年）第８２回	820,000,000	915,226,600	
国庫債券 利付（２０年）第８３回	1,370,000,000	1,537,153,700	
国庫債券 利付（２０年）第８４回	1,200,000,000	1,339,800,000	
国庫債券 利付（２０年）第８５回	400,000,000	451,016,000	
国庫債券 利付（２０年）第８６回	1,400,000,000	1,594,684,000	
国庫債券 利付（２０年）第８７回	500,000,000	566,650,000	
国庫債券 利付（２０年）第８８回	1,100,000,000	1,259,753,000	
国庫債券 利付（２０年）第８９回	470,000,000	535,433,400	
国庫債券 利付（２０年）第９０回	1,500,000,000	1,717,170,000	
国庫債券 利付（２０年）第９１回	250,000,000	287,760,000	
国庫債券 利付（２０年）第９２回	650,000,000	743,665,000	
国庫債券 利付（２０年）第９３回	300,000,000	342,855,000	

国庫債券 利付（２０年）第９４回	200,000,000	229,926,000
国庫債券 利付（２０年）第９５回	700,000,000	818,244,000
国庫債券 利付（２０年）第９６回	400,000,000	461,948,000
国庫債券 利付（２０年）第９７回	600,000,000	700,422,000
国庫債券 利付（２０年）第９８回	300,000,000	348,027,000
国庫債券 利付（２０年）第９９回	2,100,000,000	2,446,962,000
国庫債券 利付（２０年）第１００回	1,520,000,000	1,789,906,400
国庫債券 利付（２０年）第１０１回	250,000,000	298,280,000
国庫債券 利付（２０年）第１０２回	500,000,000	599,250,000
国庫債券 利付（２０年）第１０３回	600,000,000	714,288,000
国庫債券 利付（２０年）第１０４回	400,000,000	469,776,000
国庫債券 利付（２０年）第１０５回	1,900,000,000	2,240,138,000
国庫債券 利付（２０年）第１０６回	400,000,000	474,912,000
国庫債券 利付（２０年）第１０７回	300,000,000	354,888,000
国庫債券 利付（２０年）第１０８回	1,600,000,000	1,865,504,000
国庫債券 利付（２０年）第１０９回	900,000,000	1,052,325,000
国庫債券 利付（２０年）第１１０回	1,100,000,000	1,305,425,000
国庫債券 利付（２０年）第１１１回	800,000,000	960,064,000
国庫債券 利付（２０年）第１１２回	1,800,000,000	2,143,962,000
国庫債券 利付（２０年）第１１３回	2,000,000,000	2,390,740,000
国庫債券 利付（２０年）第１１４回	1,700,000,000	2,038,215,000
国庫債券 利付（２０年）第１１５回	1,000,000,000	1,208,420,000
国庫債券 利付（２０年）第１１６回	1,100,000,000	1,333,937,000
国庫債券 利付（２０年）第１１７回	1,400,000,000	1,684,144,000
国庫債券 利付（２０年）第１１８回	500,000,000	598,530,000
国庫債券 利付（２０年）第１１９回	800,000,000	941,720,000
国庫債券 利付（２０年）第１２０回	800,000,000	925,800,000
国庫債券 利付（２０年）第１２１回	1,700,000,000	2,023,000,000
国庫債券 利付（２０年）第１２２回	1,100,000,000	1,297,802,000

国庫債券 利付（２０年）第１２３回	1,500,000,000	1,821,345,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２４回	1,000,000,000	1,203,800,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２５回	900,000,000	1,105,740,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２６回	1,000,000,000	1,207,290,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２７回	1,200,000,000	1,435,956,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２８回	1,800,000,000	2,159,856,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２９回	800,000,000	951,216,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３０回	1,400,000,000	1,668,800,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３１回	800,000,000	944,696,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３２回	1,300,000,000	1,538,563,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３３回	1,400,000,000	1,672,818,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３４回	1,400,000,000	1,676,682,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３５回	700,000,000	830,228,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３６回	700,000,000	822,115,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３７回	1,000,000,000	1,188,590,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３８回	800,000,000	931,952,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３９回	1,000,000,000	1,176,760,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４０回	2,300,000,000	2,739,461,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４１回	2,600,000,000	3,102,944,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４２回	950,000,000	1,145,443,500	
国庫債券 利付（２０年）第１４３回	1,300,000,000	1,538,160,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４４回	1,300,000,000	1,521,910,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４５回	2,300,000,000	2,755,377,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４６回	2,400,000,000	2,880,504,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４７回	4,200,000,000	4,994,388,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４８回	2,100,000,000	2,472,813,000	
	3,850,000,000	4,539,535,000	

		国庫債券 利付（２０年）第１４９回			
		国庫債券 利付（２０年）第１５０回	3,330,000,000	3,885,377,400	
		国庫債券 利付（２０年）第１５１回	2,500,000,000	2,849,650,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１５２回	2,650,000,000	3,022,431,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１５３回	2,200,000,000	2,542,540,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１５４回	1,720,000,000	1,963,964,800	
		国庫債券 利付（２０年）第１５５回	2,600,000,000	2,892,656,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１５６回	2,850,000,000	2,908,054,500	
		国庫債券 利付（２０年）第１５７回	3,190,000,000	3,153,378,800	
		国庫債券 利付（２０年）第１５８回	2,100,000,000	2,171,694,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１５９回	2,000,000,000	2,097,480,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６０回	2,300,000,000	2,448,419,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６１回	2,100,000,000	2,199,960,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６２回	1,700,000,000	1,779,152,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６３回	2,750,000,000	2,875,042,500	
		国庫債券 利付（２０年）第１６４回	2,600,000,000	2,671,760,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６５回	2,200,000,000	2,257,706,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６６回	2,300,000,000	2,440,001,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６７回	2,600,000,000	2,663,050,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６８回	2,700,000,000	2,714,175,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６９回	2,530,000,000	2,494,175,200	
		国庫債券 利付（２０年）第１７０回	2,000,000,000	1,969,560,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１７１回	1,300,000,000	1,278,823,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１７２回	3,540,000,000	3,543,221,400	
		メキシコ合衆国 第２５回円貨社債（２０１８）	100,000,000	98,220,000	
	小計	銘柄数：258	497,636,000,000	542,208,271,300	
		組入時価比率：78.9%		79.5%	
	合計			542,208,271,300	

地方債証券	日本円	東京都 公募第703回	100,000,000	101,432,000	
		東京都 公募第707回	100,000,000	101,459,000	
		東京都 公募第708回	100,000,000	101,716,000	
		東京都 公募第710回	100,000,000	101,558,000	
		東京都 公募第712回	100,000,000	101,672,000	
		東京都 公募第715回	100,000,000	101,833,000	
		東京都 公募第716回	200,000,000	203,716,000	
		東京都 公募第731回	100,000,000	102,286,000	
		東京都 公募第736回	100,000,000	102,048,000	
		東京都 公募第745回	300,000,000	307,647,000	
		東京都 公募第760回	100,000,000	99,875,000	
		東京都 公募第761回	100,000,000	100,061,000	
		東京都 公募第769回	500,000,000	505,025,000	
		東京都 公募第778回	100,000,000	100,651,000	
		東京都 公募（30年）第7回	100,000,000	135,943,000	
		東京都 公募第10回	200,000,000	267,986,000	
		東京都 公募第1回	300,000,000	313,560,000	
		東京都 公募（20年）第3回	200,000,000	216,656,000	
		東京都 公募第7回	100,000,000	110,995,000	
		東京都 公募（20年）第13回	100,000,000	115,384,000	
		東京都 公募（20年）第16回	200,000,000	232,304,000	
		東京都 公募（20年）第17回	200,000,000	233,650,000	
		東京都 公募第23回	100,000,000	119,885,000	
		東京都 公募（20年）第26回	100,000,000	117,521,000	
		北海道 公募平成24年度第6回	100,000,000	101,738,000	
		北海道 公募平成24年度第9回	100,000,000	101,755,000	
		北海道 公募平成25年度第1回	300,000,000	304,569,000	
		北海道 公募平成26年度第13回	100,000,000	101,888,000	
		北海道 公募平成27年度第7回	100,000,000	102,361,000	
		北海道 公募平成28年度第13回	200,000,000	199,936,000	
		北海道 公募平成29年度第5回	200,000,000	201,322,000	
		北海道 公募平成29年度第6回	700,000,000	699,559,000	
		北海道 公募平成29年度第7回	100,000,000	100,783,000	
		北海道 公募平成29年度第9回	100,000,000	100,763,000	
		宮城県 公募第32回2号	100,000,000	100,248,000	
		神奈川県 公募第188回	200,000,000	203,536,000	
		神奈川県 公募第196回	100,000,000	101,791,000	
		神奈川県 公募第200回	100,000,000	102,596,000	
		神奈川県 公募第205回	100,000,000	102,394,000	
		神奈川県 公募第206回	100,000,000	102,518,000	
		神奈川県 公募第210回	200,000,000	203,854,000	
		神奈川県 公募第231回	200,000,000	202,080,000	

神奈川県 公募（３０年）第３回	100,000,000	135,429,000	
神奈川県 公募第７回	300,000,000	343,257,000	
神奈川県 公募（２０年）第１４回	100,000,000	117,905,000	
神奈川県 公募（２０年）第１７回	200,000,000	238,318,000	
神奈川県 公募（２０年）第２６回	100,000,000	115,632,000	
大阪府 公募第３５６回	100,000,000	101,532,000	
大阪府 公募第３７８回	104,000,000	106,359,760	
大阪府 公募第３８１回	100,000,000	102,372,000	
大阪府 公募第３８２回	100,000,000	102,389,000	
大阪府 公募第３８３回	100,000,000	102,520,000	
大阪府 公募第３８４回	100,000,000	102,482,000	
大阪府 公募第３８７回	300,000,000	306,060,000	
大阪府 公募第３８９回	100,000,000	102,143,000	
大阪府 公募第４１７回	102,000,000	103,168,920	
大阪府 公募第４２３回	100,000,000	100,676,000	
大阪府 公募第４２９回	179,000,000	180,455,270	
大阪府 公募第４５２回	100,000,000	99,219,000	
大阪府 公募第５回	100,000,000	119,636,000	
大阪府 公募第８回	100,000,000	117,964,000	
大阪府 公募（５年）第１３７回	1,024,000,000	1,023,354,880	
大阪府 公募（５年）第１４１回	230,000,000	229,832,100	
京都府 公募平成２４年度第２回	100,000,000	101,756,000	
京都府 公募平成２４年度第６回	100,000,000	101,805,000	
京都府 公募平成２５年度第１５回	200,000,000	204,758,000	
京都府 公募平成２６年度第５回	100,000,000	115,406,000	
京都府 公募平成２６年度第７回	200,000,000	204,592,000	
京都府 公募（１５年）平成２７年度第８回	100,000,000	105,951,000	
京都府 公募（２０年）平成２８年度第５回	100,000,000	98,819,000	
京都府 公募平成２９年度第４回	100,000,000	100,868,000	
兵庫県 公募平成２６年度第１７回	100,000,000	101,978,000	
兵庫県 公募平成２９年度第２２回	100,000,000	100,751,000	
兵庫県 公募（３０年）第２回	200,000,000	270,440,000	
兵庫県 公募（１５年）第１回	300,000,000	328,788,000	
兵庫県 公募（１５年）第３回	200,000,000	217,644,000	
兵庫県 公募（１２年）第３回	300,000,000	307,542,000	
兵庫県 公募第２回	100,000,000	116,353,000	
兵庫県 公募第９回	100,000,000	119,736,000	
兵庫県 公募（２０年）第１１回	200,000,000	233,156,000	
兵庫県 公募（２０年）第１４回	100,000,000	117,124,000	
兵庫県 公募（２０年）第２２回	100,000,000	114,508,000	
静岡県 公募平成２４年度第５回	100,060,000	101,765,022	

静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	101,794,000	
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	103,808,810	
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	169,247,100	
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	102,305,000	
静岡県	公募平成26年度第9回	200,000,000	204,610,000	
静岡県	公募平成27年度第11回	115,400,000	115,794,668	
静岡県	公募平成28年度第2回	300,000,000	300,513,000	
静岡県	公募平成29年度第3回	100,000,000	100,702,000	
静岡県	公募（31年）第1回	174,000,000	173,925,180	
静岡県	公募（15年）第5回	200,000,000	216,612,000	
静岡県	公募（15年）第9回	100,000,000	105,561,000	
静岡県	公募（20年）第11回	100,000,000	116,805,000	
静岡県	公募（20年）第14回	200,000,000	234,950,000	
静岡県	公募（20年）第18回	100,000,000	115,559,000	
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	116,404,000	
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	101,644,000	
愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	101,757,000	
愛知県	公募（20年）平成24年度第4回	100,000,000	116,878,000	
愛知県	公募平成24年度第8回	150,000,000	152,649,000	
愛知県	公募（15年）平成24年度第14回	400,000,000	436,592,000	
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	119,235,000	
愛知県	公募（30年）平成25年度第8回	120,000,000	157,036,800	
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	126,640,000	
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	114,258,000	
愛知県	公募（15年）平成27年度第2回	100,000,000	105,764,000	
愛知県	公募平成27年度第15回	100,000,000	102,272,000	
愛知県	公募平成29年度第8回	100,000,000	100,855,000	
愛知県	公募平成29年度第9回	100,000,000	100,501,000	
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	101,909,000	
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	205,052,000	
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	111,204,837	
広島県	公募平成29年度第4回	211,300,000	213,476,390	
埼玉県	公募平成24年度第4回	300,000,000	305,091,000	
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	102,762,000	
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	151,774,000	
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	102,379,000	
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	102,373,000	
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	102,527,000	
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	204,528,000	
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	408,180,000	

埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	101,904,000	
埼玉県	公募平成27年度第9回	100,000,000	101,044,000	
埼玉県	公募平成28年度第5回	100,000,000	99,909,000	
埼玉県	公募平成30年度第4回	200,000,000	201,984,000	
埼玉県	公募平成30年度第7回	200,000,000	200,000,000	
埼玉県	公募（15年）第1回	100,000,000	107,561,000	
埼玉県	公募（15年）第3回	100,000,000	102,222,000	
埼玉県	公募（20年）第6回	100,000,000	117,728,000	
埼玉県	公募（20年）第16回	100,000,000	112,359,000	
埼玉県	公募（20年）第20回	100,000,000	103,246,000	
福岡県	公募平成23年度第5回	100,000,000	101,322,000	
福岡県	公募平成26年度第1回	100,000,000	102,528,000	
福岡県	公募平成27年度第1回	300,000,000	308,346,000	
福岡県	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,938,000	
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	109,108,000	
福岡県	公募（15年）令和元年度第1回	100,000,000	98,919,000	
福岡県	公募（30年）平成19年度第1回	100,000,000	136,317,000	
福岡県	公募（30年）平成26年度第1回	100,000,000	126,915,000	
福岡県	公募（30年・定時償還）平成29年度第2回	100,000,000	107,568,000	
福岡県	公募（20年）平成20年度第2回	100,000,000	116,488,000	
福岡県	公募（20年）平成24年度第2回	100,000,000	116,513,000	
千葉県	公募平成24年度第1回	100,000,000	101,875,000	
千葉県	公募平成24年度第2回	100,000,000	101,693,000	
千葉県	公募平成24年度第7回	100,000,000	101,787,000	
千葉県	公募平成24年度第8回	100,000,000	102,111,000	
千葉県	公募平成25年度第3回	100,000,000	102,594,000	
千葉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	102,762,000	
千葉県	公募平成26年度第3回	200,000,000	204,808,000	
千葉県	公募平成28年度第4回	200,000,000	200,248,000	
千葉県	公募平成29年度第4回	100,000,000	100,503,000	
千葉県	公募平成29年度第8回	100,000,000	100,922,000	
千葉県	公募（20年）第1回	400,000,000	443,888,000	
千葉県	公募（20年）第8回	100,000,000	119,794,000	
千葉県	公募（20年）第16回	200,000,000	233,242,000	
千葉県	公募（20年）第17回	100,000,000	114,721,000	
群馬県	公募第8回	100,000,000	101,422,000	
群馬県	公募第12回	100,000,000	102,399,000	
群馬県	公募（20年）第3回	100,000,000	116,999,000	
岐阜県	公募平成26年度第1回	186,670,000	190,907,409	

大分県 公募平成23年度第1回	902,000,000	913,789,140	
共同発行市場地方債 公募第101回	300,000,000	303,570,000	
共同発行市場地方債 公募第102回	150,000,000	151,875,000	
共同発行市場地方債 公募第103回	100,000,000	101,296,000	
共同発行市場地方債 公募第104回	200,000,000	202,844,000	
共同発行市場地方債 公募第108回	200,000,000	203,438,000	
共同発行市場地方債 公募第110回	200,000,000	203,310,000	
共同発行市場地方債 公募第111回	200,000,000	203,452,000	
共同発行市場地方債 公募第112回	100,000,000	101,697,000	
共同発行市場地方債 公募第113回	800,000,000	812,936,000	
共同発行市場地方債 公募第114回	243,700,000	248,054,919	
共同発行市場地方債 公募第115回	100,000,000	101,813,000	
共同発行市場地方債 公募第116回	200,000,000	203,758,000	
共同発行市場地方債 公募第118回	100,000,000	102,111,000	
共同発行市場地方債 公募第119回	200,000,000	204,144,000	
共同発行市場地方債 公募第120回	300,000,000	305,409,000	
共同発行市場地方債 公募第121回	100,000,000	101,551,000	
共同発行市場地方債 公募第122回	400,000,000	406,964,000	
共同発行市場地方債 公募第124回	300,000,000	308,193,000	
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	102,558,000	
共同発行市場地方債 公募第128回	700,000,000	715,246,000	
共同発行市場地方債 公募第129回	100,000,000	102,406,000	
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	102,644,000	
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	102,390,000	
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	204,808,000	
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	204,528,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	158,507,650	

共同発行市場地方債 公募第 1 4 3 回	540,000,000	550,756,800	
共同発行市場地方債 公募第 1 4 5 回	1,000,000,000	1,018,590,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 5 6 回	200,000,000	200,570,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 5 7 回	300,000,000	300,522,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 6 1 回	300,000,000	299,907,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 7 2 回	600,000,000	606,108,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 8 4 回	100,000,000	100,681,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 9 0 回	610,000,000	613,525,800	
共同発行市場地方債 公募第 1 9 1 回	100,000,000	100,355,000	
堺市 公募平成 2 2 年度第 1 回	100,000,000	118,019,000	
堺市 公募平成 2 6 年度第 1 回	100,000,000	123,948,000	
島根県 公募平成 2 8 年度第 3 回	100,000,000	99,973,000	
佐賀県 公募平成 2 8 年度第 1 回	100,000,000	100,095,000	
福島県 公募平成 2 6 年度第 1 回	200,000,000	204,192,000	
滋賀県 公募平成 2 5 年度第 1 回	100,000,000	102,152,000	
滋賀県 公募平成 2 6 年度第 1 回	142,000,000	144,976,320	
栃木県 公募平成 2 4 年度第 1 回	100,000,000	101,865,000	
栃木県 公募平成 2 5 年度第 1 回	100,000,000	102,152,000	
熊本市 公募平成 2 9 年度第 1 回	100,000,000	100,811,000	
新潟市 公募平成 2 5 年度第 1 回	233,200,000	238,897,076	
新潟市 公募平成 2 9 年度第 1 回	100,000,000	100,967,000	
奈良県 公募平成 2 8 年度第 1 回	100,000,000	99,972,000	
浜松市 公募平成 2 6 年度第 1 回	100,000,000	101,438,000	
大阪市 公募平成 2 5 年度第 6 回	100,000,000	102,290,000	
大阪市 公募平成 2 6 年度第 5 回	100,000,000	102,431,000	
大阪市 公募（ 5 年）平成 2 8 年度第 5 回	100,000,000	99,972,000	
大阪市 公募（ 1 5 年）第 1 回	100,000,000	110,171,000	
大阪市 公募（ 2 0 年）第 1 回	300,000,000	348,867,000	
大阪市 公募（ 2 0 年）第 5 回	100,000,000	119,443,000	
大阪市 公募（ 2 0 年）第 6 回	100,000,000	117,834,000	
大阪市 公募（ 2 0 年）第 1 7 回	100,000,000	117,801,000	
名古屋市 公募第 4 7 8 回	100,000,000	101,791,000	
名古屋市 公募第 4 8 1 回	100,000,000	101,793,000	
名古屋市 公募第 4 8 8 回	300,000,000	307,323,000	
名古屋市 公募第 5 0 3 回	100,000,000	100,960,000	
名古屋市 公募第 5 0 4 回	200,000,000	201,980,000	
名古屋市 公募（ 1 2 年）第 1 回	200,000,000	210,068,000	

名古屋市 公募（１５年）第２回	100,000,000	107,241,000	
京都市 公募平成２３年度第４回	100,000,000	101,551,000	
京都市 公募平成２９年度第１回	100,000,000	100,925,000	
京都市 公募平成２９年度第４回	101,280,000	102,463,963	
京都市 公募（２０年）第２回	100,000,000	110,786,000	
京都市 公募（２０年）第５回	200,000,000	229,578,000	
京都市 公募（２０年）第６回	100,000,000	116,508,000	
京都市 公募（２０年）第１３回	100,000,000	114,150,000	
神戸市 公募平成２６年度第１７回	300,000,000	303,570,000	
神戸市 公募平成２８年度第１回	200,000,000	200,346,000	
横浜市 公募公債平成２４年度２回	200,000,000	203,660,000	
横浜市 公募公債平成２５年度１回	200,000,000	203,716,000	
横浜市 公募公債平成２５年度５回	200,000,000	204,298,000	
横浜市 公募公債平成２６年度５回	200,000,000	204,016,000	
横浜市 公募平成２８年度第５回	300,000,000	303,273,000	
横浜市 公募平成２９年度第３回	100,000,000	100,991,000	
横浜市 公募（３０年）第２回	200,000,000	261,024,000	
横浜市 公募（２０年）第１８回	100,000,000	118,573,000	
横浜市 公募（２０年）第２６回	100,000,000	118,616,000	
横浜市 公募（２０年）第３０回	100,000,000	114,371,000	
札幌市 公募（１５年）平成２３年度第９回	100,000,000	109,419,000	
札幌市 公募（２０年）平成２４年度第１回	100,000,000	118,013,000	
札幌市 公募（２０年）平成２４年度第１１回	100,000,000	118,886,000	
札幌市 公募平成２６年度第４回	100,000,000	102,065,000	
札幌市 公募平成２６年度第９回	200,000,000	203,666,000	
川崎市 公募第８５回	100,000,000	101,734,000	
川崎市 公募（２０年）第１７回	100,000,000	115,694,000	
川崎市 公募（２０年）第１９回	100,000,000	114,179,000	
北九州市 公募（２０年）第３回	200,000,000	232,014,000	
北九州市 公募（２０年）第１４回	100,000,000	117,574,000	
福岡市 公募（２０年）平成２３年度第４回	100,000,000	118,349,000	
福岡市 公募平成２６年度第２回	100,000,000	115,806,000	
福岡市 公募平成２６年度第５回	100,000,000	102,246,000	
福岡市 公募平成２６年度第８回	160,000,000	163,368,000	
広島市 公募平成２６年度第２回	100,000,000	101,955,000	
広島市 公募平成２７年度第２回	500,000,000	511,330,000	
広島市 公募（１０年）平成３０年度第６回	241,000,000	241,978,460	
千葉市 公募平成２４年度第１回	100,000,000	101,875,000	
三重県 公募平成２４年度第１回	140,660,000	143,212,979	

	小計	三重県 公募平成28年度第1回	155,000,000	156,001,300	
		鹿児島県 公募（5年）平成28年度第1回	100,000,000	99,974,000	
		福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	101,242,000	
		福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	200,406,000	
		山梨県 公募平成24年度第1回	200,000,000	203,638,000	
		岡山県 公募平成28年度第2回	168,900,000	170,489,349	
		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	117,251,000	
		愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回	300,000,000	355,929,000	
		福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	116,587,000	
		福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	104,985,000	
		銘柄数：275	45,862,820,000	48,210,535,902	
		組入時価比率：7.0%		7.1%	
		合計		48,210,535,902	
特殊債券	日本円	フランス預金供託公庫 第4回円貨債券（2014）	100,000,000	101,667,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	153,722,530	
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	196,220,030	
		新関西国際空港債券 政府保証第5回	117,000,000	117,826,020	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	107,954,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第22回	200,000,000	200,068,000	
		日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	106,634,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000	305,088,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	107,983,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000	302,493,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第96回	100,000,000	100,516,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000	103,931,880	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	159,000,000	162,008,280	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第38回	1,500,000,000	1,501,230,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	300,000,000	302,565,000	
		道路債券 財投機関債第17回	300,000,000	311,292,000	
		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	132,789,000	

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	226,992,000	
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	113,948,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第23回	300,000,000	347,778,000	
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	312,414,000	
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	236,468,000	
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	119,807,000	
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	101,579,000	
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	406,872,000	
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	203,174,000	
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	117,116,000	
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	203,784,000	
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	101,758,000	
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	410,854,500	
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	119,464,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第107回	100,000,000	102,705,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第116回	400,000,000	408,988,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第122回	100,000,000	102,524,000	
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	102,472,000	
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	204,126,000	
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	203,880,000	
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	204,582,000	
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	358,713,000	
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	121,478,000	
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	106,583,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第164回	100,000,000	111,229,000	
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	94,445,000	
	100,000,000	102,950,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第188回			
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	237,470,000	
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	237,888,000	
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	240,150,000	
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	238,968,000	
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	235,606,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	100,000,000	130,534,000	
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	850,525,200	
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	142,090,200	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回	100,000,000	101,513,000	
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	142,220,400	
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	1,018,270,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回	100,000,000	126,521,000	
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	101,810,000	
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	117,058,000	
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	221,939,260	
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	116,230,000	
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	385,335,000	
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	203,834,000	
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	203,848,000	
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	203,822,000	
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	920,169,000	
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	118,597,000	
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	199,169,320	
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	407,420,000	
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	1,027,400,000	
	272,000,000	279,159,040	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回			
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	307,221,000	
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	140,292,110	
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	148,477,100	
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	116,327,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第217回	100,000,000	125,262,000	
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	116,284,000	
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	102,554,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第224回	100,000,000	125,364,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回	190,000,000	194,366,200	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第229回	630,000,000	644,590,800	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回	100,000,000	102,072,000	
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	561,200,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第261回	401,000,000	408,831,530	
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	151,000,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第297回	100,000,000	100,291,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第306回	403,000,000	405,849,210	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第315回	100,000,000	100,628,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第321回	600,000,000	604,932,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第324回	100,000,000	100,361,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第335回	100,000,000	105,540,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第339回	500,000,000	505,920,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第342回	131,000,000	132,062,410	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第351回	100,000,000	100,837,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第354回	200,000,000	201,288,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第357回	100,000,000	101,294,000	
	130,000,000	136,544,200	

日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第13回			
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	531,084,000	
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	134,646,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第38回	1,000,000,000	1,093,690,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	134,778,000	
地方公営企業等金融機構債券（20年）第1回	100,000,000	116,265,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	100,000,000	118,351,000	
地方公共団体金融機構債券 F16回	100,000,000	112,518,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	300,000,000	359,601,000	
地方公共団体金融機構債券 F24回	100,000,000	104,507,000	
地方公共団体金融機構債券（20年）第10回	300,000,000	347,082,000	
地方公共団体金融機構債券 第27回	300,000,000	303,567,000	
地方公共団体金融機構債券 第28回	500,000,000	506,450,000	
地方公共団体金融機構債券 F104回	100,000,000	106,010,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	104,586,000	
地方公共団体金融機構債券 F122回	100,000,000	109,005,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第37回	604,000,000	615,228,360	
地方公共団体金融機構債券 第37回	400,000,000	406,640,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第38回	194,000,000	197,445,440	
地方公共団体金融機構債券 F132回	500,000,000	525,840,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	100,000,000	101,770,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第40回	101,000,000	102,902,840	
政保 地方公共団体金融機構債券 第41回	102,000,000	103,931,880	
地方公共団体金融機構債券 第41回	600,000,000	610,860,000	
地方公共団体金融機構債券 F142回	100,000,000	104,348,000	
地方公共団体金融機構債券 F145回	200,000,000	209,700,000	
	100,000,000	107,842,000	

地方公共団体金融機構債券 F 1 4 7 回			
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	108,000,000	110,147,040	
地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	100,000,000	101,888,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 3 回	202,000,000	205,809,720	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 4 回	145,000,000	148,211,750	
地方公共団体金融機構債券 第 4 4 回	100,000,000	101,989,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 5 回	223,000,000	227,975,130	
地方公共団体金融機構債券 F 1 6 0 回	100,000,000	107,299,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 8 回	500,000,000	509,145,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 9 回	13,000,000	13,351,650	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 0 回	100,000,000	102,755,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 1 回	600,000,000	615,480,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 2 回	300,000,000	307,671,000	
地方公共団体金融機構債券（1 5 年） 第 2 回	200,000,000	217,232,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 6 回	591,000,000	606,608,310	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 9 回	116,000,000	118,916,240	
地方公共団体金融機構債券（2 0 年） 第 3 8 回	100,000,000	115,566,000	
地方公共団体金融機構債券 F 2 4 0 回	300,000,000	325,665,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	102,268,000	
地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	102,307,000	
地方公共団体金融機構債券（2 0 年） 第 3 9 回	100,000,000	114,824,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 5 回	400,000,000	409,180,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 9 回	320,000,000	326,070,400	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 2 回	189,000,000	193,666,410	
地方公共団体金融機構債券 第 7 4 回	300,000,000	306,816,000	
地方公共団体金融機構債券 第 7 7 回	100,000,000	102,181,000	
	509,000,000	518,889,870	

政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 8 回			
地方公共団体金融機構債券 第 7 9 回	400,000,000	408,836,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (8 年) 第 5 回	500,000,000	503,010,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 8 3 回	116,000,000	116,000,000	
地方公共団体金融機構債券 第 9 5 回	200,000,000	201,150,000	
地方公共団体金融機構債券 第 1 0 1 回	400,000,000	403,340,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 0 8 回	157,000,000	158,295,250	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 0 回	100,000,000	100,641,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 3 回	110,000,000	111,535,600	
公営企業債券 (2 0 年) 第 2 回財 投機関債	100,000,000	103,541,000	
公営企業債券 (2 0 年) 第 5 回財 投機関債	200,000,000	213,446,000	
公営企業債券 (2 0 年) 第 1 9 回 財投機関債	100,000,000	114,558,000	
公営企業債券 (2 0 年) 第 2 0 回 財投機関債	100,000,000	114,267,000	
公営企業債券 (2 0 年) 第 2 4 回 財投機関債	100,000,000	116,815,000	
公営企業債券 (2 0 年) 第 2 5 回 財投機関債	100,000,000	118,754,000	
都市再生債券 財投機関債第 5 5 回	100,000,000	101,291,000	
都市再生債券 財投機関債第 9 6 回	200,000,000	204,718,000	
都市再生債券 財投機関債第 9 7 回	100,000,000	107,892,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 0 1 回	100,000,000	107,131,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 0 9 回	100,000,000	107,180,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 1 3 回	300,000,000	319,896,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第 7 回	100,000,000	110,885,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第 1 6 回	360,000,000	368,265,600	
東京交通債券 第 3 4 2 回	200,000,000	209,140,000	
東京交通債券 第 3 4 7 回	157,000,000	168,318,130	
関西国際空港社債 財投機関債第 3 2 回	100,000,000	101,406,000	
関西国際空港社債 財投機関債第 3 8 回	100,000,000	101,627,000	
福祉医療機構債券 第 3 1 回財投機 関債	100,000,000	101,796,000	
	368,000,000	375,014,080	

中部国際空港債券 政府保証第18回			
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	200,000,000	228,610,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	100,000,000	106,852,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	100,000,000	108,952,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第49回	100,000,000	118,906,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	100,000,000	117,926,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	100,000,000	119,940,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回	300,000,000	329,895,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	100,000,000	119,904,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第79回	100,000,000	101,291,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第86回	200,000,000	202,526,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回	200,000,000	219,082,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第120回	100,000,000	118,962,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第123回	100,000,000	118,390,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回	100,000,000	134,924,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第132回	200,000,000	214,860,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第137回	100,000,000	109,357,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第143回	100,000,000	108,730,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第177回	250,000,000	255,502,500	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第198回	300,000,000	300,768,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第223回	100,000,000	101,533,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第244回	130,000,000	131,506,700	
成田国際空港 第10回	100,000,000	101,321,000	
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	204,032,000	
成田国際空港 第17回	400,000,000	407,948,000	
商工債券 利付第806回い号	300,000,000	300,216,000	
商工債券 利付第811回い号	300,000,000	300,786,000	
商工債券 利付第815回い号	100,000,000	100,268,000	
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	100,260,000	

商工債券 利付第 8 1 9 回い号	300,000,000	300,897,000	
商工債券 利付第 8 2 9 回い号	200,000,000	200,158,000	
商工債券 利付第 8 3 1 回い号	200,000,000	199,750,000	
商工債券 利付第 8 3 3 回い号	100,000,000	99,741,000	
しんきん中金債券 利付第 3 2 7 回	200,000,000	200,082,000	
しんきん中金債券 利付第 3 3 5 回	200,000,000	200,258,000	
商工債券 利付（3 年）第 2 2 3 回	500,000,000	500,460,000	
商工債券 利付（3 年）第 2 3 1 回	200,000,000	200,162,000	
商工債券 利付（3 年）第 2 3 6 回	500,000,000	499,505,000	
商工債券 利付（1 0 年）第 1 5 回	200,000,000	203,420,000	
国際協力機構債券 第 6 回財投機関債	200,000,000	239,248,000	
東日本高速道路 第 6 1 回	200,000,000	199,104,000	
中日本高速道路 第 6 3 回	100,000,000	102,435,000	
中日本高速道路 第 6 6 回	1,200,000,000	1,200,000,000	
西日本高速道路 第 2 0 回	200,000,000	204,634,000	
西日本高速道路 第 2 2 回	400,000,000	410,460,000	
西日本高速道路 第 2 3 回	100,000,000	102,190,000	
西日本高速道路 第 3 0 回	300,000,000	300,876,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 2 回	100,000,000	102,393,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 8 回	200,000,000	204,470,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 9 回	100,000,000	114,967,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 7 1 回	500,000,000	510,680,000	
貸付債権担保第 1 2 回住宅金融公庫債券	31,062,000	31,285,335	
貸付債権担保第 1 9 回住宅金融公庫債券	57,405,000	58,344,145	
貸付債権担保第 5 回 S 種住宅金融公庫債券	35,235,000	35,865,001	
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融公庫債券	38,802,000	40,376,973	
貸付債権担保第 7 回 S 種住宅金融公庫債券	12,211,000	12,557,792	
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融公庫債券	26,256,000	27,098,029	
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融公庫債券	30,110,000	31,491,145	
貸付債権担保第 1 5 回住宅金融公庫債券	33,786,000	34,269,815	
貸付債権担保第 3 2 回住宅金融公庫債券	55,912,000	57,616,197	
貸付債権担保第 2 0 回住宅金融公庫債券	58,020,000	59,221,594	
貸付債権担保第 4 4 回住宅金融公庫債券	51,888,000	53,839,507	

貸付債権担保第 8 回住宅金融支援機構債券	86,166,000	89,431,691	
貸付債権担保第 7 回住宅金融支援機構債券	14,503,000	15,132,430	
貸付債権担保第 2 5 回住宅金融支援機構債券	22,940,000	24,752,260	
貸付債権担保第 2 8 回住宅金融支援機構債券	73,389,000	78,551,916	
貸付債権担保 S 種第 1 6 回住宅金融支援機構債券	14,404,000	14,652,613	
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融支援機構債券	78,074,000	82,484,400	
貸付債権担保 S 種第 1 7 回住宅金融支援機構債券	28,946,000	29,482,369	
貸付債権担保第 4 5 回住宅金融支援機構債券	93,300,000	99,300,123	
貸付債権担保第 5 2 回住宅金融支援機構債券	70,400,000	74,431,808	
貸付債権担保第 2 4 回住宅金融支援機構債券	40,690,000	43,612,355	
貸付債権担保第 4 8 回住宅金融支援機構債券	88,227,000	93,952,050	
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融支援機構債券	97,635,000	102,307,811	
貸付債権担保第 6 2 回住宅金融支援機構債券	134,619,000	141,349,950	
貸付債権担保第 6 0 回住宅金融支援機構債券	130,245,000	137,491,831	
貸付債権担保第 6 1 回住宅金融支援機構債券	84,148,000	88,495,085	
貸付債権担保第 5 1 回住宅金融支援機構債券	32,518,000	34,462,251	
貸付債権担保第 4 3 回住宅金融支援機構債券	75,756,000	80,524,840	
貸付債権担保第 7 9 回住宅金融支援機構債券	43,674,000	45,544,120	
貸付債権担保第 8 1 回住宅金融支援機構債券	93,988,000	98,131,930	
貸付債権担保第 7 2 回住宅金融支援機構債券	42,494,000	44,322,091	
貸付債権担保第 2 2 回住宅金融公庫債券	24,484,000	25,052,518	
貸付債権担保第 7 0 回住宅金融支援機構債券	127,362,000	133,800,149	
貸付債権担保第 3 3 回住宅金融支援機構債券	27,579,000	29,526,904	
貸付債権担保第 3 4 回住宅金融支援機構債券	29,849,000	32,005,888	
貸付債権担保第 3 5 回住宅金融支援機構債券	28,306,000	30,172,780	
貸付債権担保第 4 6 回住宅金融支援機構債券	31,540,000	33,613,439	
	85,728,000	90,700,224	

貸付債権担保第 5 5 回住宅金融支援 機構債券			
貸付債権担保第 5 6 回住宅金融支援 機構債券	121,947,000	128,987,000	
貸付債権担保第 5 7 回住宅金融支援 機構債券	40,735,000	43,123,293	
貸付債権担保第 7 6 回住宅金融支援 機構債券	82,484,000	86,462,203	
貸付債権担保 S 種第 3 回住宅金融公 庫債券	11,267,000	11,458,426	
貸付債権担保 S 種第 1 4 回住宅金融 支援機構債券	59,315,000	59,919,419	
貸付債権担保 S 種第 1 5 回住宅金融 支援機構債券	24,310,000	24,560,149	
貸付債権担保第 2 3 回住宅金融支援 機構債券	78,880,000	84,137,352	
貸付債権担保第 3 2 回住宅金融支援 機構債券	79,836,000	85,196,189	
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融支援 機構債券	157,090,000	165,409,486	
貸付債権担保第 5 8 回住宅金融支援 機構債券	86,866,000	91,934,631	
貸付債権担保第 6 4 回住宅金融支援 機構債券	141,735,000	148,536,862	
貸付債権担保第 7 1 回住宅金融支援 機構債券	123,984,000	129,226,043	
貸付債権担保第 7 3 回住宅金融支援 機構債券	95,906,000	101,223,987	
貸付債権担保第 7 5 回住宅金融支援 機構債券	82,298,000	86,491,906	
貸付債権担保第 8 3 回住宅金融支援 機構債券	199,244,000	207,823,446	
貸付債権担保第 8 4 回住宅金融支援 機構債券	343,483,000	357,747,848	
貸付債権担保第 8 8 回住宅金融支援 機構債券	52,100,000	54,074,069	
貸付債権担保第 8 9 回住宅金融支援 機構債券	54,658,000	56,800,593	
貸付債権担保第 9 0 回住宅金融支援 機構債券	55,935,000	57,929,642	
貸付債権担保第 9 2 回住宅金融支援 機構債券	116,290,000	119,658,921	
貸付債権担保第 9 3 回住宅金融支援 機構債券	122,330,000	124,941,745	
貸付債権担保第 9 4 回住宅金融支援 機構債券	65,295,000	67,412,516	
貸付債権担保第 9 6 回住宅金融支援 機構債券	68,912,000	70,933,878	
貸付債権担保第 9 7 回住宅金融支援 機構債券	204,633,000	211,680,560	
貸付債権担保第 9 8 回住宅金融支援 機構債券	211,791,000	219,953,425	
	141,638,000	146,943,759	

		貸付債権担保第 9 9 回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第 1 0 0 回住宅金融支援機構債券	69,566,000	72,048,114	
		貸付債権担保第 1 0 1 回住宅金融支援機構債券	69,818,000	72,511,578	
		貸付債権担保第 1 1 5 回住宅金融支援機構債券	253,635,000	256,087,650	
		貸付債権担保第 1 1 6 回住宅金融支援機構債券	170,178,000	172,701,739	
		貸付債権担保第 1 1 7 回住宅金融支援機構債券	171,128,000	173,409,136	
		貸付債権担保第 1 1 8 回住宅金融支援機構債券	85,660,000	86,864,379	
		貸付債権担保第 1 1 9 回住宅金融支援機構債券	171,578,000	173,871,997	
		貸付債権担保第 1 2 0 回住宅金融支援機構債券	86,703,000	87,526,678	
		貸付債権担保第 1 2 1 回住宅金融支援機構債券	86,877,000	87,869,135	
		貸付債権担保第 1 2 3 回住宅金融支援機構債券	88,265,000	89,438,041	
		貸付債権担保第 1 2 5 回住宅金融支援機構債券	353,984,000	357,693,752	
		貸付債権担保第 1 2 6 回住宅金融支援機構債券	266,928,000	269,885,562	
		貸付債権担保第 1 2 8 回住宅金融支援機構債券	178,114,000	179,962,823	
		貸付債権担保第 1 2 9 回住宅金融支援機構債券	180,400,000	182,741,592	
		貸付債権担保第 1 3 4 回住宅金融支援機構債券	184,678,000	186,149,883	
		貸付債権担保第 1 3 5 回住宅金融支援機構債券	92,384,000	93,113,833	
		貸付債権担保第 1 3 6 回住宅金融支援機構債券	92,891,000	93,988,971	
		貸付債権担保第 1 4 0 回住宅金融支援機構債券	93,925,000	94,640,708	
		貸付債権担保第 1 4 2 回住宅金融支援機構債券	285,318,000	286,162,541	
		貸付債権担保第 1 4 4 回住宅金融支援機構債券	286,506,000	287,497,310	
		貸付債権担保第 1 5 0 回住宅金融支援機構債券	488,055,000	484,692,301	
		貸付債権担保第 1 5 2 回住宅金融支援機構債券	197,092,000	197,596,555	
		貸付債権担保第 1 5 4 回住宅金融支援機構債券	198,528,000	198,494,250	
		貸付債権担保第 1 5 8 回住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,524,000	
	小計	銘柄数：314	60,065,824,000	62,999,345,355	
		組入時価比率：9.2%		9.2%	
	合計			62,999,345,355	

社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行（B F C M） 第14回円貨社債	200,000,000	199,808,000	
		フランス相互信用連合銀行（B F C M） 第29回円貨社債	200,000,000	196,376,000	
		フランス相互信用連合銀行（B F C M） 第31回円貨社債	100,000,000	95,645,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第14回円貨社債	100,000,000	99,213,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第1回非上位円貨社債	200,000,000	200,656,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債（2014）	100,000,000	101,743,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第15回円貨社債（2018）	100,000,000	99,658,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第16回円貨社債（2018）	100,000,000	99,026,000	
		スタンダード・チャータード 第3回円貨社債（2015）	100,000,000	100,316,000	
		エイチエスビーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第2回円	100,000,000	100,642,000	
		エイチエスビーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第3回円	100,000,000	100,718,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第1回円貨社債	100,000,000	99,745,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第6回円貨社債	100,000,000	98,151,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第7回円貨社債	100,000,000	93,985,000	
		サンタンデール銀行 第1回円貨社債	100,000,000	98,691,000	
		フランス電力 第4回円貨社債（2017）	100,000,000	102,958,000	
		現代キャピタル・サービス・インク 第15回円貨社債	200,000,000	194,836,000	
		ビー・エヌ・ビー・パリバ 第1回円貨社債（2017）	100,000,000	99,773,000	
		ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第12回円貨社	200,000,000	200,434,000	
		オーストラリア・ニュージーランド銀行 第10回円貨社債	200,000,000	199,464,000	
		ソシエテ・ジェネラル 第1回非上位円貨社債（2017）	100,000,000	99,548,000	
		大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,291,000	
		明治ホールディングス 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,812,000	
		アサヒグループホールディングス 第8回特定社債間限定同順位特	100,000,000	100,341,000	
		麒麟ホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,150,000	
		味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,780,000	
		日本たばこ産業 第13回	100,000,000	100,359,000	

三越伊勢丹ホールディングス 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,858,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,592,000	
野村不動産ホールディングス 第5回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,018,000	
森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特約付	200,000,000	196,490,000	
森ビル 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,739,000	
東急不動産ホールディングス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,275,000	
東レ 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,521,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,263,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,972,000	
王子ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,399,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,335,000	
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,924,000	
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,801,000	
三菱ケミカルホールディングス 第29回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,605,000	
電通 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,613,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,267,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,914,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,974,000	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,720,000	
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,868,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,427,000	
JXホールディングス 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,111,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,256,000	
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,860,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,986,000	
日本特殊陶業 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,714,000	
	100,000,000	99,801,000	

新日鐵住金 第7回社債間限定同順位特約付			
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	300,000,000	297,564,000	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,664,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第22回（J F Eス保証	100,000,000	101,293,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順位	100,000,000	98,504,000	
DOWAホールディングス 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,563,000	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,336,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	217,578,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,735,000	
日本電産 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,470,000	
日本電気 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,829,000	
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,394,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,204,000	
ソニー 第32回	200,000,000	200,190,000	
東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,622,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,948,000	
三菱重工業 第35回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,408,000	
J A三井リース 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,925,000	
J A三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,868,000	
三井住友トラスト・パナソニックファイナンス 第2回社債間限定	100,000,000	100,085,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	102,441,000	
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,338,000	
楽天カード 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,907,000	
ドンキホーテホールディングス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,158,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,746,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,249,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,702,000	

豊田通商 第 1 9 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	207,244,000	
三井物産 第 7 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,240,000	
住友商事 第 4 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,664,000	
住友商事 第 4 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,480,000	
住友商事 第 5 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,994,000	
高島屋 第 1 1 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,366,000	
丸井グループ 第 2 8 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,858,000	
クレディセゾン 第 5 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,137,000	
クレディセゾン 第 5 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,142,000	
クレディセゾン 第 6 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,377,000	
イオン 第 2 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,365,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第 1 回劣後特約付	100,000,000	101,535,000	
りそなホールディングス 第 1 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,858,000	
りそなホールディングス 第 2 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,721,000	
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	201,992,000	
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	114,758,000	
東京三菱銀行 第 5 7 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,854,000	
三菱東京UFJ銀行 第 1 5 9 回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,534,000	
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	302,730,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第 3 回劣後特約付	100,000,000	101,133,000	
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	103,841,000	
三井住友信託銀行 第 1 回劣後特約付	300,000,000	307,578,000	
セブン銀行 第 1 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,860,000	
セブン銀行 第 1 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,596,000	
セブン銀行 第 1 2 回社債間限定同順位特約付	300,000,000	303,498,000	
みずほフィナンシャルグループ 第 1 回劣後特約付	200,000,000	202,790,000	
みずほ銀行 第 7 回劣後特約付	100,000,000	113,578,000	

NTTファイナンス 第2回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,313,000	
トヨタファイナンス 第77回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	99,959,000	
トヨタファイナンス 第81回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	100,035,000	
リコーリース 第28回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	99,480,000	
アコム 第76回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,933,000	
アコム 第77回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,802,000	
ジャックス 第12回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,459,000	
ジャックス 第19回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,861,000	
日立キャピタル 第61回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	99,557,000	
日立キャピタル 第80回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	98,080,000	
三井住友ファイナンス&リース 第 27回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,285,000	
三菱UFJリース 第52回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,166,000	
三菱UFJリース 第75回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	99,723,000	
三菱UFJリース 第30回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,353,000	
大和証券グループ本社 第23回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	102,318,000	
三井不動産 第71回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	197,358,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等 財務上特約無	100,000,000	104,472,000	
三菱地所 第111回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	101,730,000	
三菱地所 第120回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	99,414,000	
東京建物 第25回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,320,000	
ダイビル 第19回特定社債間限定 同順位特約付	100,000,000	96,933,000	
住友不動産 第95回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	102,624,000	
住友不動産 第97回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	204,744,000	
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	102,415,000	
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	116,010,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投 資法人 第5回特定投資法人債	100,000,000	101,674,000	
	200,000,000	210,864,000	

東武鉄道 第102回社債間限定同順位特約付			
相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付	200,000,000	202,518,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,581,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,803,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	214,782,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,571,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	207,560,000	
東日本旅客鉄道 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,437,000	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	200,000,000	235,594,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	116,073,000	
東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,756,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	114,395,000	
東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,844,000	
西日本旅客鉄道 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	114,218,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	300,000,000	345,396,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	237,262,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,813,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	119,974,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	100,206,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	101,408,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	105,919,000	
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	202,570,000	
西日本鉄道 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,298,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,378,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,224,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,453,000	
日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,191,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,481,000	

九州旅客鉄道 第４回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,558,000	
A N Aホールディングス 第３２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	92,455,000	
澁澤倉庫 第８回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,278,000	
K D D I 第２０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,233,000	
K D D I 第２５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,401,000	
東京電力 第５４８回	100,000,000	109,933,000	
東京電力 第５６０回	100,000,000	108,086,000	
中部電力 第５００回	200,000,000	205,624,000	
中部電力 第５２４回	100,000,000	100,847,000	
中部電力 第５３０回	200,000,000	199,542,000	
関西電力 第４９６回	100,000,000	102,959,000	
関西電力 第５０９回	100,000,000	100,707,000	
関西電力 第５１１回	100,000,000	100,245,000	
関西電力 第５１４回	200,000,000	200,256,000	
関西電力 第５２７回	200,000,000	200,606,000	
中国電力 第３７７回	400,000,000	412,200,000	
中国電力 第３７８回	100,000,000	102,823,000	
中国電力 第４００回	100,000,000	100,247,000	
中国電力 第４０２回	300,000,000	300,771,000	
北陸電力 第３０１回	100,000,000	102,772,000	
北陸電力 第３０４回	100,000,000	102,740,000	
北陸電力 第３０７回	100,000,000	104,503,000	
北陸電力 第３０８回	100,000,000	102,435,000	
北陸電力 第３２６回	100,000,000	100,111,000	
東北電力 第４７５回	100,000,000	102,604,000	
東北電力 第４８１回	200,000,000	205,692,000	
東北電力 第４８４回	100,000,000	101,483,000	
東北電力 第４９１回	100,000,000	100,849,000	
四国電力 第２８１回	200,000,000	206,332,000	
九州電力 第４２４回	300,000,000	310,848,000	
九州電力 第４２８回	105,000,000	108,142,650	
九州電力 第４４９回	200,000,000	201,602,000	
九州電力 第４５１回	100,000,000	100,878,000	
九州電力 第４７６回	100,000,000	100,516,000	
北海道電力 第３２１回	100,000,000	102,938,000	
北海道電力 第３２３回	100,000,000	108,224,000	
北海道電力 第３３８回	100,000,000	101,537,000	
北海道電力 第３４５回	300,000,000	300,756,000	
電源開発 第３７回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,018,000	

小計	電源開発 第 3 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,724,000	
	電源開発 第 4 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,749,000	
	電源開発 第 4 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,383,000	
	電源開発 第 5 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,615,000	
	電源開発 第 5 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,304,000	
	東京電力パワーグリッド 第 2 回	100,000,000	100,678,000	
	東京電力パワーグリッド 第 6 回	100,000,000	100,812,000	
	東京電力パワーグリッド 第 1 1 回	300,000,000	300,411,000	
	東京電力パワーグリッド 第 1 4 回	100,000,000	100,541,000	
	東京電力パワーグリッド 第 2 8 回	100,000,000	100,996,000	
	東京瓦斯 第 3 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,230,000	
	東京瓦斯 第 3 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	126,136,000	
	東京瓦斯 第 5 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	93,674,000	
	大阪瓦斯 第 3 6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,391,000	
	東邦瓦斯 第 3 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,308,000	
	北海道瓦斯 第 1 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,176,000	
	北海道瓦斯 第 2 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,779,000	
	広島ガス 第 1 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,033,000	
	東京都競馬 第 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,739,000	
	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	100,681,000	
	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	102,274,000	
	ファーストリテイリング 第 7 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,840,000	
	ソフトバンクグループ 第 5 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,027,000	
	銘柄数：223	28,005,000,000	28,548,705,650	
	組入時価比率：4.2%		4.2%	
合計		28,548,705,650		
合計		681,966,858,207		

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年 6月29日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	65,190,636
コール・ローン	515,059,175
国債証券	578,989,211,330
未収入金	407,304,581
未収利息	4,771,294,805
前払費用	373,208,122
その他未収収益	11,853,765
流動資産合計	585,133,122,414
資産合計	585,133,122,414
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	486,851
未払解約金	690,730,956
未払利息	547
その他未払費用	9,447,326
流動負債合計	700,665,680
負債合計	700,665,680
純資産の部	
元本等	
元本	240,750,404,558
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	343,682,052,176
元本等合計	584,432,456,734
純資産合計	584,432,456,734
負債純資産合計	585,133,122,414

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2020年 6月29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	2.4275円
(10,000口当たり純資産額)	(24,275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	
	152,762,103,247円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	
3. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価	
貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。	
有価証券	160,707,595,364円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 6月29日 至 2020年 6月29日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 6月29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

2020年 6月29日現在

期首	2019年 6月29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	265,778,701,491円
同期中における追加設定元本額	36,412,055,792円
同期中における一部解約元本額	61,440,352,725円
期末元本額	240,750,404,558円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	81,788,029円
バランスセレクト５０	81,936,743円
バランスセレクト７０	68,244,143円
野村外国債券インデックスファンド	289,704,372円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	3,566,500,794円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	23,382,452,301円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	1,474,577,017円
野村資産設計ファンド２０１５	26,224,333円
野村資産設計ファンド２０２０	21,322,196円
野村資産設計ファンド２０２５	45,688,095円
野村資産設計ファンド２０３０	44,014,986円
野村資産設計ファンド２０３５	30,477,330円
野村資産設計ファンド２０４０	55,818,428円
野村外国債券インデックス Ｂコース（野村投資一任口座向け）	102,650,467,371円
のむラップ・ファンド（保守型）	5,673,867,660円
のむラップ・ファンド（普通型）	12,101,601,516円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,504,634,992円
野村外国債券インデックス（野村ＳＭＡ向け）	588,287,430円
野村資産設計ファンド２０４５	7,017,343円
野村インデックスファンド・外国債券	807,079,321円
マイ・ロード	8,673,912,808円
ネクストコア	224,617,607円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	148,726,749円
野村外国債券インデックスＢコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	6,163,581,165円

野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,241,436,860円
野村資産設計ファンド2050	8,787,583円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	5,758,221円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,128,988円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,533,624円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,052,884円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	498,286,850円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	370,542,273円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	2,067,279円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	1,352,839円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	5,388,512円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	1,475,937円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	3,445,122円
野村6資産均等バランス	863,732,707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）	7,384,947,629円
世界6資産分散ファンド	76,074,277円
野村資産設計ファンド2060	2,574,941円
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信	1,984,347,553円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	1,529,339,077円
野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	9,010,051円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,345,564,690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）	316,606,137円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	1,517,341,469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）	1,242,319,801円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	2,731,221円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	8,351,785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）	370,483円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,145,614,085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）	13,812,669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）	72,057,667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）	16,333,969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）	161,654,807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）	174,647,907円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	1,720,370,768円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	103,355,272円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	670,978,683円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券（適格機関投資家専用）	1,607,510,325円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	599,754円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3,706,775円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	6,375,974円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	5,201,938円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	581,630,878円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	5,026,120,703円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	5,668,600,767円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	4,058,591,467円
野村外国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	16,529,689,571円

マイバランスDC30	1,665,974,147円
マイバランスDC50	1,149,151,925円
マイバランスDC70	727,100,852円
野村DC外国債券インデックスファンド	6,103,933,013円
野村DC運用戦略ファンド	3,434,053,260円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	328,337,110円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	145,848,642円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	209,716,918円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	104,197,938円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	9,624,136円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	23,792,413円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	8,715,482円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	4,381,852円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	2,557,934円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	1,532,923円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	55,353,122円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	35,786,661円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	15,700,388円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	18,122,865円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	557,476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(2020年6月29日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2020年6月29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	50,500,000.00	55,934,663.55	
		US TREASURY BOND	38,800,000.00	46,141,685.56	
		US TREASURY BOND	45,100,000.00	49,042,723.18	
		US TREASURY BOND	72,200,000.00	94,835,826.32	
		US TREASURY BOND	10,800,000.00	15,228,000.00	
		US TREASURY BOND	46,200,000.00	64,510,358.22	
		US TREASURY BOND	49,300,000.00	68,357,531.25	
		US TREASURY BOND	27,500,000.00	38,401,170.50	

US TREASURY BOND	100,000.00	155,945.31	
US TREASURY BOND	17,500,000.00	23,045,312.50	
US TREASURY BOND	2,000,000.00	2,996,718.60	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,050,742.00	
US TREASURY N/B	900,000.00	921,339.81	
US TREASURY N/B	32,500,000.00	33,139,843.75	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,615,500.00	
US TREASURY N/B	28,300,000.00	28,716,759.95	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,589,550.65	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	11,657,834.94	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,345,015.41	
US TREASURY N/B	26,100,000.00	26,678,073.24	
US TREASURY N/B	12,200,000.00	12,462,108.46	
US TREASURY N/B	17,900,000.00	18,341,906.25	
US TREASURY N/B	9,650,000.00	9,767,985.72	
US TREASURY N/B	30,400,000.00	31,150,500.00	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,927,757.67	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,231,054.20	
US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,688,964.75	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,024,023.40	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,780,937.50	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,764,250.00	
US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,884,773.27	
US TREASURY N/B	80,000,000.00	82,890,624.00	
US TREASURY N/B	6,400,000.00	6,534,999.68	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,377,343.40	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,343,933.45	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,772,467.52	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,977,968.24	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,598,163.80	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	4,007,554.59	
US TREASURY N/B	500,000.00	514,843.75	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,348,292.92	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,750,685.04	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	26,088,646.54	

US TREASURY N/B	8,800,000.00	9,062,280.48	
US TREASURY N/B	200,000.00	206,515.62	
US TREASURY N/B	900,000.00	927,210.87	
US TREASURY N/B	16,400,000.00	17,043,186.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,140.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,812.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,035,468.70	
US TREASURY N/B	900,000.00	927,878.85	
US TREASURY N/B	19,100,000.00	19,810,281.25	
US TREASURY N/B	900,000.00	931,851.54	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,563,867.15	
US TREASURY N/B	7,600,000.00	7,861,546.40	
US TREASURY N/B	10,200,000.00	10,694,859.12	
US TREASURY N/B	47,900,000.00	49,842,191.72	
US TREASURY N/B	400,000.00	419,093.72	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,704,686.00	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	15,231,733.66	
US TREASURY N/B	400,000.00	414,531.24	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,611,718.00	
US TREASURY N/B	34,800,000.00	36,368,717.88	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,587,405.56	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,957,874.88	
US TREASURY N/B	41,100,000.00	44,343,044.82	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,969,726.40	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,309,601.29	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	36,558,498.24	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	12,362,343.16	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	46,240,966.62	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,802,312.04	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,714,061.00	
US TREASURY N/B	43,000,000.00	46,083,904.10	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,406,031.25	
US TREASURY N/B	800,000.00	873,437.44	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,820,992.06	
US TREASURY N/B	22,000,000.00	23,935,311.40	

US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,937,615.86	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,089,452.84	
US TREASURY N/B	42,700,000.00	46,052,616.12	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,909,093.48	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	37,155,092.04	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,487,234.26	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	18,237,476.14	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	2,117,906.25	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	36,302,107.74	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	38,766,677.10	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	8,760,663.66	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,597,445.21	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	29,305,546.20	
US TREASURY N/B	19,200,000.00	21,864,000.00	
US TREASURY N/B	50,300,000.00	55,400,731.86	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,139,687.40	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	9,589,671.66	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,928,953.08	
US TREASURY N/B	21,100,000.00	22,487,983.32	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,699,374.40	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	6,016,937.36	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	14,279,687.50	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,254,686.00	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,627,750.00	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,033,202.70	
US TREASURY N/B	38,000,000.00	42,904,375.00	
US TREASURY N/B	8,400,000.00	9,438,187.08	
US TREASURY N/B	500,000.00	583,671.85	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,125,406.16	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,452,375.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,165,000.00	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,622,914.02	
US TREASURY N/B	35,300,000.00	52,555,631.93	
US TREASURY N/B	5,850,000.00	8,990,490.01	
US TREASURY N/B	200,000.00	329,406.24	

US TREASURY N/B	100,000.00	158,343.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	142,242.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	155,257.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	160,007.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	158,046.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	162,875.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	158,718.75	
US TREASURY N/B	200,000.00	299,656.24	
US TREASURY N/B	100,000.00	157,000.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	166,710.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	159,835.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	148,304.68	
US TREASURY N/B	300,000.00	408,890.61	
US TREASURY N/B	100,000.00	136,500.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	133,984.37	
US TREASURY N/B	200,000.00	257,968.74	
US TREASURY N/B	1,690,000.00	2,308,698.35	
US TREASURY N/B	100,000.00	147,000.00	
US TREASURY N/B	7,400,000.00	10,914,421.32	
US TREASURY N/B	15,200,000.00	21,655,250.00	
US TREASURY N/B	23,000,000.00	31,599,842.60	
US TREASURY N/B	36,900,000.00	49,783,288.14	
US TREASURY N/B	39,400,000.00	48,976,043.92	
US TREASURY N/B	21,900,000.00	29,657,389.53	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	23,259,960.50	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	5,030,554.41	
US TREASURY N/B	51,500,000.00	64,306,597.70	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	35,272,029.84	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	41,265,232.65	
US TREASURY N/B	14,200,000.00	19,052,405.54	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,336,703.04	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	15,025,733.52	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	12,273,820.08	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	13,116,679.45	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	7,207,734.12	

小計	US TREASURY N/B	10,500,000.00	14,564,647.65	
	US TREASURY N/B	2,470,000.00	3,439,281.84	
	US TREASURY N/B	100,000.00	136,453.12	
	US TREASURY N/B	9,400,000.00	11,404,843.28	
	US TREASURY N/B	300,000.00	373,804.68	
	銘柄数：153	2,141,410,000.00	2,453,706,269.57 (263,135,460,348)	
	組入時価比率：45.0%		45.5%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	5,500,000.00	5,764,385.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	11,750,000.00	12,085,815.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	11,600,000.00	11,767,040.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,006,610.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	301,377.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	6,807,937.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	311,718.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,460,000.00	4,616,412.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,158,971.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	535,425.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	7,379,632.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	17,000,000.00	17,721,310.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	4,043,841.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	320,082.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,250,000.00	11,000,062.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	208,264.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	112,292.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,080,000.00	14,738,976.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,157,160.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	6,837,054.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	6,306,138.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	11,242,850.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	15,573,043.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,870,167.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	765,516.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	163,501.00	
小計	銘柄数：26	116,690,000.00	143,795,579.20	

			(11,280,763,188)	
	組入時価比率：1.9%		1.9%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	95,300,000.00	96,790,005.97	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	84,700,000.00	87,732,963.01	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,400,000.00	45,898,286.88	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	315,405.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	59,548,359.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	48,023,600.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	51,300,000.00	52,545,564.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	112,300,000.00	124,739,471.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	45,300,000.00	53,407,794.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,500,000.00	77,146,070.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	11,293,600.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,300,000.00	75,588,380.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	35,800,000.00	42,198,892.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	66,500,000.00	72,117,255.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	47,846,100.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	87,100,000.00	95,962,425.00	
小計	銘柄数：16	894,100,000.00	991,154,170.86	
	組入時価比率：0.8%		(4,618,778,436)	0.8%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	742,406.00	
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	865,252.00	
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	665,700.00	
	BELGIUM KINGDOM	11,100,000.00	12,054,933.00	
	BELGIUM KINGDOM	2,900,000.00	2,976,415.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,507,200.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,045,040.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,196,500.00	
	BELGIUM KINGDOM	6,000,000.00	7,724,874.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,583,206.00	
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,161,785.60	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,088,297.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,305,238.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,679,520.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	5,167,757.00	

BELGIUM KINGDOM	100,000.00	115,960.00	
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	600,593.50	
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	128,357.42	
BELGIUM KINGDOM	3,400,000.00	6,010,962.00	
BELGIUM KINGDOM	4,400,000.00	7,772,626.40	
BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,574,490.00	
BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	5,229,288.00	
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,837,224.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,580,241.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	16,740,239.50	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	18,841,958.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,100,000.00	5,168,569.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,700,000.00	10,770,470.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,650,000.00	20,530,311.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,350,000.00	4,417,033.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,060,000.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	17,364,894.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,286,251.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	6,139,308.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,600,000.00	17,276,391.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,900,000.00	7,981,920.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	507,790.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	975,807.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	18,779,039.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,598,950.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,467,776.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	30,452,777.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,392,485.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,188,302.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,476,000.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	13,059,060.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,304,441.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	6,549,660.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	2,572,126.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,700,000.00	9,691,242.60	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,100,000.00	16,916,563.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	4,449,200.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,800,000.00	11,928,558.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,700,000.00	2,819,620.00	
BUNDES OblIGATION	100,000.00	100,856.00	
BUNDES OblIGATION	3,700,000.00	3,746,361.00	
BUNDES OblIGATION	750,000.00	762,150.00	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,021,000.00	
BUNDES OblIGATION	2,000,000.00	2,063,000.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	350,000.00	363,846.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	413,808.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	4,198,160.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	734,153.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	413,322.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,200,000.00	9,798,920.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,580,000.00	2,803,944.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	23,900,000.00	29,851,100.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,856,060.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,800,000.00	11,750,400.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000.00	8,687,250.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,856,330.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,918,090.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,800,000.00	22,251,008.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,043,700.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	744,366.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	30,564,822.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	216,972.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,200,000.00	26,935,272.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	1,524,586.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	10,509,299.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,500,000.00	32,459,115.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	10,201,480.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,600,000.00	14,971,722.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000.00	14,512,520.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,800,000.00	7,119,961.20	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	10,908,005.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,430,000.00	2,533,179.22	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	9,540,976.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,200,000.00	18,910,416.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	12,450,000.00	17,096,464.50	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	1,500,000.00	1,515,255.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	1,700,000.00	1,720,179.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,100,000.00	5,127,336.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,335,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,500,000.00	17,440,995.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,900,000.00	6,082,782.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,050,000.00	10,006,182.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,600,000.00	2,683,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,900,000.00	20,480,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,200,000.00	6,326,976.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,942,845.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	406,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,200,000.00	9,156,940.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,187,885.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	31,100,000.00	34,956,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,892,875.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,231,370.47	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	568,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	24,050,070.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,700,000.00	16,850,610.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	315,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,554,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,875,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,081,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	20,155,296.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	828,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,118,155.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,641,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,198,900.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	11,500,000.00	13,840,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,144,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,100,000.00	25,159,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,500,000.00	24,164,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	7,448,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000.00	40,445,730.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,000,000.00	23,358,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	511,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	16,091,670.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,544,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,400,000.00	21,798,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	9,682,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	915,180.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	580,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	7,434,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	237,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	17,491,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	13,143,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,500,000.00	4,252,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,521,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	9,424,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,000,000.00	9,401,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	1,880,623.98	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	505,577.50	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,029.65	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,963.86	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	407,946.00	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	769,895.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,433,400.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	107,419.60	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,115,336.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,131,898.98	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,572,192.80	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	882,668.00	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	232,250.80	

FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,058,316.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	621,717.60	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	395,936.40	
FRANCE (GOVT OF)	6,000,000.00	6,062,001.60	
FRANCE (GOVT OF)	2,600,000.00	2,643,940.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,682,412.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	102,200.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,600,000.00	10,677,364.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,846,139.40	
FRANCE (GOVT OF)	11,000,000.00	11,571,560.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,905,172.20	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,863,920.00	
FRANCE (GOVT OF)	7,700,000.00	8,446,191.60	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,171,692.00	
FRANCE (GOVT OF)	11,600,000.00	12,618,735.20	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,134,790.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,500,000.00	12,053,913.50	
FRANCE (GOVT OF)	10,500,000.00	12,232,563.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	117,140.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	127,622.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	14,726,577.88	
FRANCE (GOVT OF)	3,000,000.00	3,791,124.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	524,084.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,400,000.00	3,574,454.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,500,000.00	9,065,926.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,400,000.00	3,440,659.24	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	18,783,828.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,900,000.00	13,730,904.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	31,409,100.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,311,487.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	26,781,264.18	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,495,300.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000.00	42,098,155.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	5,545,350.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	40,941,747.00	

FRANCE GOVERNMENT 0.A.T	13,500,000.00	15,909,277.50	
FRANCE GOVERNMENT 0.A.T	20,100,000.00	34,581,024.90	
FRANCE GOVERNMENT 0.A.T	10,300,000.00	17,433,780.00	
FRANCE GOVERNMENT 0.A.T	300,000.00	503,661.30	
FRANCE GOVERNMENT 0.A.T	8,100,000.00	14,912,586.00	
FRANCE GOVERNMENT 0.A.T	29,450,000.00	48,877,399.30	
FRANCE GOVERNMENT 0.A.T	4,900,000.00	10,161,840.50	
FRANCE GOVERNMENT 0.A.T	4,700,000.00	10,286,596.72	
IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,100,688.74	
IRISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,341,283.20	
IRISH TSY 0.8% 2022	1,200,000.00	1,227,845.76	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	663,511.80	
IRISH TSY 1.3% 2033	2,400,000.00	2,755,982.40	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,281,010.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	1,500,000.00	1,851,186.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	700,000.00	857,825.50	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,958,280.20	
IRISH TSY 2.4% 2030	3,700,000.00	4,588,438.45	
IRISH TSY 2% 2045	3,100,000.00	4,190,303.48	
IRISH TSY 2022	9,000,000.00	9,110,151.90	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,100,000.00	6,983,935.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT	50,000.00	52,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,514,725.35	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	106,002.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	222,540.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,700,000.00	6,895,860.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	429,475.56	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	102,319.18	
NETHERLANDS GOVERNMENT	8,700,000.00	9,642,210.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,563,900.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	2,021,980.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,721,159.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	17,928,480.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,098,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,400,000.00	3,598,220.00	

小計	NETHERLANDS GOVERNMENT	9,500,000.00	12,832,305.50	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2,200,000.00	3,729,185.68	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	556,040.95	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	2,746,032.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	7,500,000.00	13,037,025.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,587,745.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	734,890.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	3,448,640.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	101,413.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	219,478.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	916,245.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	161,866.65	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,329,835.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	768,730.41	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,421,479.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,076,700.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,155,800.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	11,214,514.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	8,128,200.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,800,000.00	6,427,099.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	673,631.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	5,437,374.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,100,000.00	9,370,580.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,256,758.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	450,000.00	1,039,734.00	
	REPUBLIC OF IRELAND	4,450,000.00	4,990,254.92	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,771,608.00	
	SPANISH GOVERNMENT	31,400,000.00	50,535,160.00	
	SPANISH GOVERNMENT	500,000.00	762,641.40	
	銘柄数：254	1,486,800,000.00	1,925,838,133.33	
			(231,832,394,490)	
	組入時価比率：39.7%		40.0%	
英債券	UK TREASURY	40,000.00	42,998.80	
	UK TREASURY	470,000.00	490,999.60	
	UK TREASURY	650,000.00	694,700.50	

UK TREASURY	2,800,000.00	2,833,348.00	
UK TREASURY	400,000.00	415,960.00	
UK TREASURY	6,000,000.00	6,024,060.00	
UK TREASURY	14,000,000.00	14,348,040.00	
UK TREASURY	4,800,000.00	5,153,424.00	
UK TREASURY	1,600,000.00	1,664,848.00	
UK TREASURY	7,450,000.00	8,326,790.50	
UK TREASURY	9,950,000.00	12,304,269.50	
UK TREASURY	200,000.00	206,580.00	
UK TREASURY	200,000.00	221,722.00	
UK TREASURY	160,000.00	174,963.20	
UK TREASURY	400,000.00	434,924.00	
UK TREASURY	9,630,000.00	12,651,990.30	
UK TREASURY	200,000.00	226,080.00	
UK TREASURY	7,900,000.00	11,809,947.00	
UK TREASURY	6,000,000.00	8,842,200.00	
UK TREASURY	5,550,000.00	8,136,855.00	
UK TREASURY	15,700,000.00	24,595,620.00	
UK TREASURY	2,600,000.00	4,091,100.00	
UK TREASURY	100,000.00	174,300.00	
UK TREASURY	600,000.00	1,003,980.00	
UK TREASURY	500,000.00	853,650.00	
UK TREASURY	400,000.00	451,560.00	
UK TREASURY	920,000.00	1,672,744.00	
UK TREASURY	18,440,000.00	30,466,568.00	
UK TREASURY	6,300,000.00	11,854,080.00	
UK TREASURY	8,200,000.00	9,984,320.00	
UK TREASURY	16,100,000.00	20,836,620.00	
UK TREASURY	5,350,000.00	10,571,600.00	
UK TREASURY	6,750,000.00	12,982,950.00	
UK TREASURY	1,000,000.00	1,321,800.00	
UK TREASURY	1,100,000.00	1,541,430.00	
UK TREASURY	100,000.00	179,140.00	
UK TREASURY	650,000.00	1,475,695.00	
UK TSY 3 1/4% 2044	28,400,000.00	44,670,360.00	

小計	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT	6,800,000.00	14,820,600.00	
	銘柄数：39	198,410,000.00	288,552,817.40 (38,213,049,608)	
	組入時価比率：6.5%		6.6%	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	36,050,000.00	38,699,314.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	7,900,000.00	8,401,586.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	32,250,000.00	36,692,437.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,971,385.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,800,000.00	18,033,556.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	14,300,000.00	15,425,124.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,500,000.00	16,480,275.00	
小計	銘柄数：7	129,800,000.00	146,703,680.20 (1,684,158,248)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,300,000.00	10,827,360.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	38,900,000.00	42,803,615.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	5,002,445.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,980,590.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,384,320.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,985,520.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	22,000,000.00	24,225,300.00	
小計	銘柄数：8	100,100,000.00	109,097,704.50 (1,205,529,634)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	14,400,000.00	15,113,088.00	
	KINGDOM OF DENMARK	400,000.00	408,200.00	
	KINGDOM OF DENMARK	22,770,000.00	24,407,163.00	
	KINGDOM OF DENMARK	32,000,000.00	35,950,400.00	
	KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	16,816,270.00	
	KINGDOM OF DENMARK	21,400,000.00	23,092,740.00	
	KINGDOM OF DENMARK	38,100,000.00	72,070,325.76	
小計	銘柄数：7	144,770,000.00	187,858,186.76 (3,033,909,716)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	51,600,000.00	53,586,600.00	

小計	POLAND GOVERNMENT BOND	34,800,000.00	37,513,342.08	
	POLAND GOVERNMENT BOND	22,000,000.00	24,310,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	16,897,500.00	
	銘柄数：4	123,400,000.00	132,307,442.08	
			(3,563,039,415)	
	組入時価比率：0.6%		0.6%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	10,051,672.82	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,040,000.00	3,378,960.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	80,000.00	83,784.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	6,192,924.12	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,864,200.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	15,200,000.00	17,275,225.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	15,540,781.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,100,000.00	15,463,844.77	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,683,823.68	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,800,000.00	19,893,280.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,440,148.13	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	12,210,773.75	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	15,604,890.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,500,000.00	13,279,561.75	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	10,939,383.07	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,183,574.24	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	5,445,531.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	900,340.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,567,539.22	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	6,751,670.00	
小計	銘柄数：20	144,400,000.00	170,751,907.95	
			(12,574,170,501)	
シンガポールドル	組入時価比率：2.2%		2.2%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	480,000.00	488,424.57	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,427,697.68	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,358,282.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,545,440.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	310,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,600,000.00	3,853,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,531,200.00	

小計	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,096,365.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,196,470.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	759,360.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,596,150.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	567,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	350,790.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,826,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,528,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	2,401,098.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,050,000.00	2,619,751.58	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,319,769.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,143,860.00	
	銘柄数：19	31,080,000.00	34,921,058.33	
			(2,688,921,491)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,132,108.67	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	425,814.92	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,959,176.74	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3,800,000.00	4,006,176.22	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	460,639.24	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	408,647.64	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,200,000.00	6,352,889.52	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	510,769.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,714,724.92	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	517,299.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,926,955.05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,635,998.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,295,729.92	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	6,181,336.66	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	642,092.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,486,794.24	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,908,486.12	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,343,098.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,327,788.32	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	3,153,983.67	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	302,325.32	

	小計	MALAYSIAN GOVERNMENT	12,700,000.00	14,254,593.03	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,848,307.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	433,303.52	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	842,783.36	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	984,038.85	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	3,267,256.72	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	11,130,912.96	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4,100,000.00	4,552,005.73	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	343,555.26	
		銘柄数：30	108,580,000.00	117,349,592.38	
				(2,931,392,817)	
		組入時価比率：0.5%		0.5%	
	新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	2,600,000.00	2,825,282.98	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,067,435.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,137,527.50	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,564,352.50	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,223,483.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,662,267.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,370,873.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	6,838,308.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,530,092.50	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,698,298.00	
		ISRAEL FIXED BOND	2,000,000.00	2,072,068.40	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	8,937,736.50	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	7,402,517.00	
		銘柄数：13	59,600,000.00	71,330,241.38	
				(2,227,643,438)	
		組入時価比率：0.4%		0.4%	
	小計				
合計				578,989,211,330	
				(578,989,211,330)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(3)貸付有価証券の明細(2020年 6月29日現在)

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

国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	1,700,000	
		US TREASURY N/B	10,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	1,500,000	
		US TREASURY N/B	10,227,000	
		US TREASURY N/B	6,400,000	
		US TREASURY N/B	5,000,000	
		US TREASURY N/B	8,925,000	
		US TREASURY N/B	18,000,000	
		US TREASURY N/B	31,000,000	
		US TREASURY N/B	10,000,000	
		US TREASURY BOND	23,000,000	
		US TREASURY BOND	41,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY BOND	36,000,000	
		US TREASURY BOND	50,000,000	
		US TREASURY BOND	9,403,000	
		US TREASURY BOND	1,000,000	
		US TREASURY BOND	32,000,000	
		US TREASURY BOND	25,000,000	
		US TREASURY N/B	3,655,000	
		US TREASURY N/B	29,000,000	
		US TREASURY N/B	9,265,000	
		US TREASURY N/B	9,600,000	
		US TREASURY N/B	1,700,000	
		US TREASURY N/B	1,530,000	
		US TREASURY N/B	12,500,000	
		US TREASURY N/B	17,000,000	
		US TREASURY N/B	7,000,000	
		US TREASURY N/B	25,000,000	
		US TREASURY N/B	10,030,000	
		US TREASURY N/B	29,000,000	
		US TREASURY N/B	17,000,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	40,000,000	
		US TREASURY N/B	765,000	
		US TREASURY N/B	16,000,000	
		US TREASURY N/B	5,000,000	
		US TREASURY N/B	425,000	
		US TREASURY N/B	22,000,000	
		US TREASURY N/B	20,600,000	
		US TREASURY N/B	2,000,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	1,350,000	
		US TREASURY N/B	25,000,000	
		US TREASURY N/B	21,000,000	
		US TREASURY N/B	5,000,000	
		US TREASURY N/B	20,000,000	

		US TREASURY N/B	36,000,000	
		US TREASURY N/B	8,670,000	
		US TREASURY N/B	7,140,000	
		US TREASURY N/B	6,826,000	
		US TREASURY N/B	19,700,000	
		US TREASURY N/B	9,755,000	
		US TREASURY N/B	33,000,000	
		US TREASURY N/B	1,000,000	
		US TREASURY N/B	35,000,000	
		US TREASURY BOND	38,000,000	
		US TREASURY BOND	335,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	4,925,000	
		US TREASURY N/B	41,000,000	
		US TREASURY N/B	27,000,000	
		US TREASURY N/B	1,105,000	
		US TREASURY N/B	12,000,000	
		US TREASURY N/B	155,000	
		US TREASURY N/B	26,000,000	
		US TREASURY N/B	36,000,000	
		US TREASURY N/B	34,000,000	
		US TREASURY N/B	1,530,000	
		US TREASURY N/B	25,000,000	
		US TREASURY N/B	15,626,000	
		US TREASURY N/B	1,020,000	
	豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,000,000	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,000,000	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,100,000	
	ユーロ	FRANCE (GOVT OF)	2,000,000	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	5,100,000	

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 6月29日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	343,558,149	—	344,045,000	△486,851
米ドル	139,198,956	—	139,399,000	△200,044
ユーロ	204,359,193	—	204,646,000	△286,807
合計	343,558,149	—	344,045,000	△486,851

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）

2020年7月31日現在

I 資産総額	948,725,228円
II 負債総額	1,282,891円
III 純資産総額（I－II）	947,442,337円
IV 発行済口数	932,461,162口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.0161円

（参考）国内株式マザーファンド

2020年7月31日現在

I 資産総額	457,819,442,162円
II 負債総額	38,156,511,629円
III 純資産総額（I－II）	419,662,930,533円
IV 発行済口数	273,760,682,235口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.5330円

（参考）外国株式MSCI－KOKUSA Iマザーファンド

2020年7月31日現在

I 資産総額	676,801,504,439円
II 負債総額	1,158,495,036円
III 純資産総額（I－II）	675,643,009,403円
IV 発行済口数	232,422,050,975口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.9070円

（参考）国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

2020年7月31日現在

I 資産総額	690,091,278,333円
II 負債総額	2,169,319,751円
III 純資産総額（I－II）	687,921,958,582円
IV 発行済口数	516,376,605,831口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3322円

（参考）外国債券マザーファンド

2020年7月31日現在

I 資産総額	589,993,040,993円
II 負債総額	560,317,346円
III 純資産総額（I－II）	589,432,723,647円
IV 発行済口数	239,219,319,154口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.4640円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③委託者は、上記①の振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取扱い

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

2020年8月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間ににおける主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

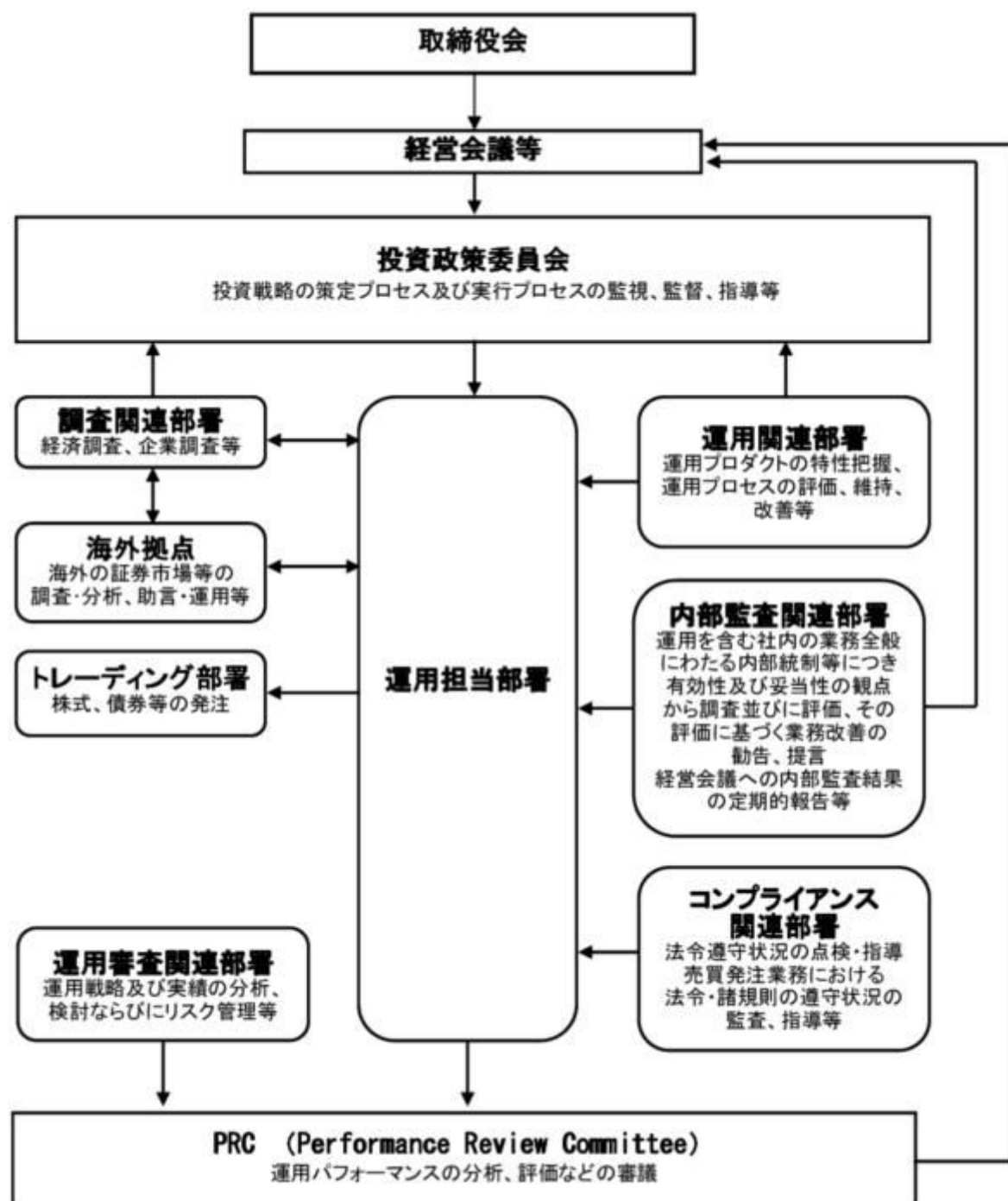
代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2020年7月31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	995	29,361,957
単位型株式投資信託	185	838,713
追加型公社債投資信託	14	5,664,415
単位型公社債投資信託	461	1,604,845
合計	1,655	37,469,931

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(2019年4月1日から2020年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

		前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金			1,562		2,626
金銭の信託			45,493		41,524
有価証券			19,900		24,399
前払費用			27		106
未収入金			500		522
未収委託者報酬			25,246		23,936
未収運用受託報酬			5,933		4,336
その他			269		71
貸倒引当金			△15		△14
流動資産計			98,917		97,509
固定資産					
有形固定資産			714		645
建物	※ 2	320		295	
器具備品	※ 2	393		349	
無形固定資産			6,438		5,894
ソフトウェア		6,437		5,893	
その他		0		0	

投資その他の資産			18,608		16,486
投資有価証券		1,562		1,437	
関係会社株式		12,631		10,171	
従業員長期貸付金		-		16	
長期差入保証金		235		329	
長期前払費用		22		19	
前払年金費用		2,001		1,545	
繰延税金資産		2,694		2,738	
その他		168		229	
貸倒引当金		-		△0	
投資損失引当金		△707		-	
固定資産計			25,761		23,026
資産合計			124,679		120,536

		前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			145		157
未払金			16,709		15,279
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		25		3	
未払手数料		7,724		6,948	
関係会社未払金		7,422		7,262	
その他未払金		1,535		1,063	
未払費用	※ 1		11,704		10,290
未払法人税等			1,560		1,564
前受収益			29		26
賞与引当金			3,792		3,985
その他			-		67
流動負債計			33,942		31,371
固定負債					
退職給付引当金			3,219		3,311
時効後支払損引当金			558		572
固定負債計			3,777		3,883
負債合計			37,720		35,254
(純資産の部)					
株主資本			86,924		85,270
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			56,014		54,360
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		55,329		53,675	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,723		29,069	
評価・換算差額等			33		10
その他有価証券評価差額金			33		10

純資産合計			86,958		85,281
負債・純資産合計			124,679		120,536

(2) 【損益計算書】

		前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
区分	注記 番号	金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		119,196	115,736
運用受託報酬		21,440	17,170
その他営業収益		355	340
営業収益計		140,992	133,247
営業費用			
支払手数料		42,675	39,435
広告宣伝費		1,210	1,006
公告費		0	-
調査費		30,082	26,833
調査費		5,998	5,696
委託調査費		24,083	21,136
委託計算費		1,311	1,342
営業雑経費		5,435	5,823
通信費		92	75
印刷費		970	958
協会費		86	92
諸経費		4,286	4,696
営業費用計		80,715	74,440
一般管理費			
給料		11,113	11,418
役員報酬		379	109
給料・手当		7,067	7,173
賞与		3,666	4,134
交際費		107	86
旅費交通費		514	391
租税公課		1,048	1,029
不動産賃借料		1,223	1,227
退職給付費用		1,474	1,486
固定資産減価償却費		2,835	2,348
諸経費		10,115	10,067
一般管理費計		28,433	28,055
営業利益		31,843	30,751

		前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
--	--	--	--

区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	※ 1	6,538		4,936	
受取利息		0		0	
その他		424		309	
営業外収益計			6,964		5,246
営業外費用					
支払利息	※ 1	1		-	
金銭の信託運用損		489		230	
投資事業組合等評価損		-		146	
時効後支払損引当金繰入額		43		18	
為替差損		34		23	
その他		17		23	
営業外費用計			585		443
経常利益			38,222		35,555
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		21	
関係会社清算益	※ 3	29		-	
株式報酬受入益		85		59	
特別利益計			135		81
特別損失					
投資有価証券等評価損		938		119	
関係会社株式評価損		161		1,591	
固定資産除却損	※ 2	310		67	
投資損失引当金繰入額		707		-	
特別損失計			2,118		1,778
税引前当期純利益			36,239		33,858
法人税、住民税及び事業税			10,196		9,896
法人税等調整額			370		△34
当期純利益			25,672		23,996

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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 資 本 合 計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金		利 益 剰余金 合 計	
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	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 項目の当期変動 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		純資産合計
	その他有価証 券評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	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 の当期変動額（純 額）	21	21	21
当期変動額合計	21	21	868
当期末残高	33	33	86,958

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株 主 資 本 合 計
		資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金		利 益 剰余金 合 計	
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924
当期変動額									
剰余金の配当							△25,650	△25,650	△25,650
当期純利益							23,996	23,996	23,996
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）									
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	△1,653	△1,653	△1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(単位：百万円)

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

[重要な会計方針]

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

5. 消費税等の会計処理方法 6. 連結納税制度の適用	(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 ① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。 連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。
---	--

[未適用の会計基準等]

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

(1) 概要

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

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「会計方針の開示、会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 2020年3月31日）

(1) 概要

関連する会計基準等の定めが明らかでない場合に、採用した会計処理の原則及び手続きの概要を示すことを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

- ・「会計上の見積りの開示に関する会計基準（企業会計基準第31号 2020年3月31日）」

(1) 概要

当年度の財務諸表に計上した金額が会計上の見積りによるもののうち、翌年度の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目における会計上の見積りの内容について、財務諸表利用者の理解に資する情報を開示することを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

[注記事項]

◇ 貸借対照表関係

前事業年度末 (2019年3月31日)	当事業年度末 (2020年3月31日)
※ 1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 1,434百万円	※ 1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 1,296百万円

※ 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額	※ 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額
建物 736百万円	建物 761百万円
器具備品 3,106	器具備品 2,347
合計 3,842	合計 3,109

◇ 損益計算書関係

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
※ 1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 6,531百万円 支払利息 1	※ 1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,931百万円
※ 2. 固定資産除却損 器具備品 3百万円 ソフトウェア 307 合計 310	※ 2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソフトウェア 59 合計 67
※ 3. 関係会社清算益 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 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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

◇ 金融商品関係

前事業年度(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

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 5年以内	5年超 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	-	-	-

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
--	----------	----	----

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

 その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

ます。

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

◇ 有価証券関係

前事業年度（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 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	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。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

4. その他有価証券(2020年3月31日)

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

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

◇ 退職給付関係

前事業年度(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	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

① 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

② 長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

①年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

◇ 税効果会計関係

前事業年度末 (2019年3月31日)		当事業年度末 (2020年3月31日)	
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
繰延税金資産	百万円	繰延税金資産	百万円
賞与引当金	1,175	賞与引当金	1,235
退職給付引当金	998	退職給付引当金	1,026
関係会社株式評価減	51	関係会社株式評価減	762
投資有価証券評価減	708	投資有価証券評価減	462
未払事業税	288	未払事業税	285
時効後支払損引当金	172	時効後支払損引当金	177
減価償却超過額	171	減価償却超過額	171
ゴルフ会員権評価減	192	ゴルフ会員権評価減	167
関係会社株式売却損	148	関係会社株式売却損	148
未払社会保険料	82	未払社会保険料	97
その他	633	その他	219
繰延税金資産小計	4,625	繰延税金資産小計	4,754
評価性引当額	△1,295	評価性引当額	△1,532
繰延税金資産合計	3,329	繰延税金資産合計	3,222
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	15	その他有価証券評価差額金	4
前払年金費用	620	前払年金費用	478
繰延税金負債合計	635	繰延税金負債合計	483
繰延税金資産の純額	2,694	繰延税金資産の純額	2,738

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 (調整)	法定実効税率 (調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	受取配当金等永久に益金に算入されない項目
タックスヘイブン税制	タックスヘイブン税制
外国税額控除	外国税額控除
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税
その他	その他
税効果会計適用後の法人税等の負担率	税効果会計適用後の法人税等の負担率
31.0%	31.0%
0.1%	0.0%
△5.6%	△4.4%
2.6%	2.6%
△0.6%	△0.7%
0.3%	0.2%
1.3%	0.4%
29.1%	29.1%

◇ セグメント情報等

前事業年度(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

① 売上高

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 売上高

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

◇ 関連当事者情報

前事業年度(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 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借及び購入等	資金の借入 (*1)	3,000	短期借入金	-
							資金の返済	3,000		
						役員の兼任	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 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	—	当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (*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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

（イ）子会社等

該当はありません。

（ウ）兄弟会社等

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

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

野村ホールディングス(株)（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、

ニューヨーク証券取引所に上場）

（２）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

◇ １株当たり情報

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,882円89銭	1株当たり純資産額	16,557円31銭
1株当たり当期純利益	4,984円30銭	1株当たり当期純利益	4,658円88銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	25,672百万円	損益計算書上の当期純利益	23,996百万円
普通株式に係る当期純利益	25,672百万円	普通株式に係る当期純利益	23,996百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。		該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

4【利害関係人との取引制限】

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

- ①自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。)又は子法人等(委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ④委託者の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

- ⑤上記③④に掲げるもののほか、委託者の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託者

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

*2020年7月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社 S M B C 日興証券株式会社 損保ジャパン D C 証券株式会社	10,000百万円 10,000百万円 3,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村信託銀行株式会社 三菱 U F J 信託銀行株式会社 株式会社横浜銀行	35,000百万円 324,279百万円 215,628百万円	

*2020年7月末現在

2【関係業務の概要】

(1)受託者

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

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1)受託者

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年 9月19日	有価証券届出書
2019年 9月19日	有価証券報告書
2020年 3月18日	有価証券届出書の訂正届出書
2020年 3月18日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2020年6月10日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀井 純子
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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
--------------------	-------	--------

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成すること

が適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

2020年8月7日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀井純子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤志保

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマイターゲット2045（確定拠出年金向け）の2019年6月29日から2020年6月29日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マイターゲット2045（確定拠出年金向け）の2020年6月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
 - ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
 - ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
 - ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
- 監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以 上

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